

“乾元一天天盈”（按日）开放式资产组合型人民币理财 产品季度投资管理报告

报告日：2019年9月30日

“乾元一天天盈”（按日）开放式资产组合型人民币理财产品于2014年10月9日正式成立。截至报告日，本产品规模为11,301,967,810.51元，杠杆水平符合监管要求。

一、报告期投资者实际收益率

根据产品说明书的约定，本报告期内，投资者实际收益率如下表所示：

（一）2018年11月30日（含）至2019年7月24日投资者实际收益率如下表所示：

投资期	1≤T<30	30≤T<60	60≤T<120	120≤T<270	270≤T<365	≥365
投资者实际收益率	2.8%	3.00%	3.25%	3.40%	3.90%	4.50%

（二）2019年7月24日（含）起至2019年9月4日（含）投资者实际收益率如下表所示：

投资期	1≤T<30	30≤T<60	60≤T<120	120≤T<270	270≤T<365	≥365
投资者实际收益率	2.8%	2.9%	3.10%	3.20%	3.70%	4.30%

（三）2019年9月5日（含）起投资者实际收益率如下表所示：

投资期	1≤T<30	30≤T<60	60≤T<120	120≤T<270	270≤T<365	≥365
投资者实际收益率	2.5%	2.80%	3.10%	3.20%	3.50%	3.90%

相关收益及计算方法，请具体查阅对应的收益率调整公告及产品说明书。

二、产品投资组合详细情况

产品名称	募集起始日	募集结束日	产品成立日	产品到期日
------	-------	-------	-------	-------

“乾元一天天盈”（按日）开放式资产组合型人民币理财产品	2014/9/29	2014/10/8	2014/10/9	无固定期限
-----------------------------	-----------	-----------	-----------	-------

理财产品管理人：中国建设银行股份有限公司天津市分行

理财产品托管人：中国建设银行股份有限公司天津市分行

三、期末资产持仓

资产类别	穿透前金额 (万元)	占全部产品总资产 的比例 (%)	穿透后金额 (万元)	占全部产品总资产 的比例 (%)
现金及银行存款	216996.68	18	216996.68	18
同业存单				
拆放同业及买入返售				
债券	421489.00	36	421489.00	36
理财直接融资工具				
新增可投资资产				
非标准化债权类资产	415704.44	35	415704.44	35
权益类投资				
金融衍生品				
代客境外理财投资 QDII				
商品类资产				
另类资产				
公募基金	1000.00	0	1000.00	0
私募基金				
资产管理产品	130000.00	11	130000.00	11
委外投资——协议方式				
合计	1185190.12	100	1185190.12	100

四、前十大投资资产明细

序号	资产名称	资产规模 (元)	资产占比 (%)
----	------	----------	----------

1	活期存款	2169966770.83	18.30
2	14 津滨海新城 AB017	1000000000.00	8.43
3	19 渤海银行永续债	750000000.00	6.33
4	15 广成投资 PPN002	532463854.30	4.48
5	18 津建信资本安鑫 0I001	500000000.00	4.22
6	19 津建信资本安鑫 0I001	500000000.00	4.22
7	17 津十八局优 A	427000000.00	3.60
8	15 滨建投 MTN001	413603057.36	3.48
9	17 津中冶天工 AB018	400000000.00	3.37
10	19 津保障房 AB005	392269287.33	3.31

注：本表列示穿透后投资规模占比较高的前十项资产

五、产品的流动性风险分析

产品存续期内，客户可在工作日进行实时申赎，产品管理人会根据产品申赎情况合理调整资产配置，以满足产品的兑付资金需求，故投资组合流动性风险较低。

六、托管人报告（公募产品半年报及年度报告需提供）

无

七、投资账户信息

序号	账户类型	账户编号	账户名称	开户单位
1				
2				
.....				

八、报告期内关联交易情况

（一）产品持有关联方发行或承销的证券

序号	证券简称	证券类别	证券代码	交易数量	交易净价	关联方名称	关联方角色
1							

2							
.....							

(二) 其他重大关联交易

无

九、投资非标准化债权及股权类资产清单（见附录一）

十、产品整体运作情况

（一）本产品自成立至本报告日，产品管理人恪尽职守、勤勉尽责、谨慎管理，忠实履行有关法律、行政法规和相关文件的规定。

（二）截至本报告日，资产 16 天津航空 EB007 风险状态由正常调整至关注，该笔资产尚能正常付息，不影响产品正常兑付。其余投资资产正常运营，未发现异常情况或者不利情况。

（三）本产品自成立至本报告日，没有发生涉诉及诉讼等损害投资者利益的情况。

特此公告

中国建设银行天津市分行
2019 年 10 月 15 日

附录一

“乾元一天天盈”（按日）开放式资产组合型人民币理财产品投资非标准化债权及股权类资产清单

报告日：2019年9月30日

我行依照监管要求，现对“乾元一天天盈”（按日）开放式资产组合型人民币理财产品投资非标准化债权及股权类资产清单披露如下：

融资客户名称	交易结构	剩余融资期限（天）	风险状态
天津滨海新城建设发展有限公司	非标准化债权类资产	58	正常
天津市双港经济发展管理服务中心	非标准化债权类资产	52	正常
天津鑫泰鼎实投资发展有限公司	非标准化债权类资产	182	正常

中铁十八局集团高速公路项目管理有限公司	非标准化债权类资产	273	正常
中铁十八局集团高速公路项目管理有限公司	非标准化债权类资产	273	正常
天津市保障住房建设投资有限公司	非标准化债权类资产	1095	正常
中铁十八局集团有限公司	非标准化债权类资产	51	正常
中铁十八局集团有限公司	非标准化债权类资产	68	正常
中冶天工集团有限公司	非标准化债权类资产	88	正常
天津市建工工程总承包有限公司	非标准化债权类资产	193	正常
天津市保障住房建设投资有限公司	非标准化债权类资产	458	正常
天津市塘沽海洋高新技术开发总公司	非标准化债权类资产	397	正常
天津滨海泰达航母旅游集团股份有限公司	非标准化债权类资产	394	正常
天津航空有限责任公司	带回购条款的股权性融资	347	关注
天津市南开资产管理运营有限公司	带回购条款的股权性融资	427	正常
天津海泰控股集团有限公司	带回购条款的股权性融资	385	正常
京津冀城际铁路投资有限公司	产业基金	2940	正常
天津宝星工贸有限公司	带回购条款的股权性融资	688	正常
天津保税区投资控股集团有限公司	产业基金	389	正常

除上述资产外，产品投资其他资产的风险状况：正常

到期收益分配详见产品说明书。