

附件

“乾元一天长利久”开放式资产组合型人民币理财产品 月度投资管理报告

报告日：2017年6月30日

“乾元-天长利久”开放式资产组合型人民币理财产品于2016年3月2日正式成立。截至报告日，本产品规模为4367858328.67元。

一、报告期投资者实际收益率

根据产品说明书的约定，2016年3月2日至2016年5月11日投资者实际收益率如下表所示：

投资期	$1 \leq T < 32$	$32 \leq T < 63$	$63 \leq T < 93$	$93 \leq T < 120$	$120 \leq T < 270$	$270 \leq T < 365$	$T \geq 365$
投资者实际收益率	2.05%	3.15%	3.35%	3.60%	3.75%	4.05%	4.25%

其中：T为投资期，单位：天

2016年5月12日至2016年7月14日投资者实际收益率如下表所示：

投资期	$1 \leq T < 32$	$32 \leq T < 63$	$63 \leq T < 93$	$93 \leq T < 180$	$180 \leq T < 365$	$365 \leq T < 730$	$T \geq 730$
投资者实际收益率	2.05%	3.15%	3.25%	3.60%	3.75%	4.05%	4.25%

其中：T为投资期，单位：天

2016年7月15日至2016年8月15日投资者实际收益率如下表所示：

投资期	$1 \leq T < 30$	$30 \leq T < 60$	$60 \leq T < 90$	$90 \leq T < 180$	$180 \leq T < 365$	$T \geq 365$
投资者实际收益率	1.95%	2.55%	3.05%	3.40%	3.60%	3.80%

其中：T为投资期，单位：天

2016年8月16日至2017年2月21日投资者实际收益率如下表所示：

投资期	$1 \leq T < 30$	$30 \leq T < 60$	$60 \leq T < 90$	$90 \leq T < 180$	$180 \leq T < 365$	$T \geq 365$
-----	-----------------	------------------	------------------	-------------------	--------------------	--------------

投资者实际收益率	1.95%	2.35%	2.85%	3.05%	3.35%	3.55%
----------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

其中：T 为投资期，单位：天

2017 年 2 月 22 日至 2017 年 3 月 31 日投资者实际收益率如下表所示：

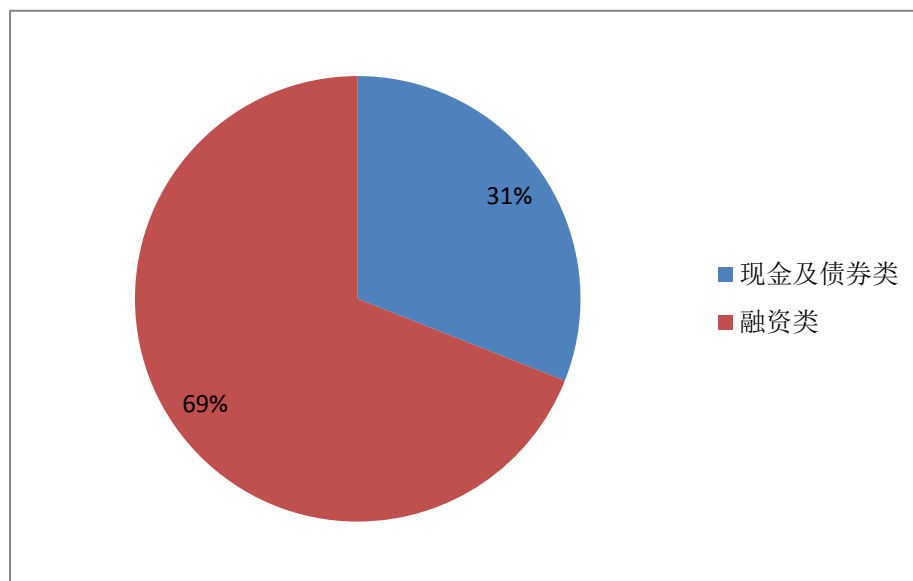
投资期	$1 \leq T < 30$	$30 \leq T < 60$	$60 \leq T < 90$	$90 \leq T < 180$	$180 \leq T < 365$	$T \geq 365$
投资者实际收益率	2.10%	2.45%	3.00%	3.20%	3.45%	3.55%

其中：T 为投资期，单位：天

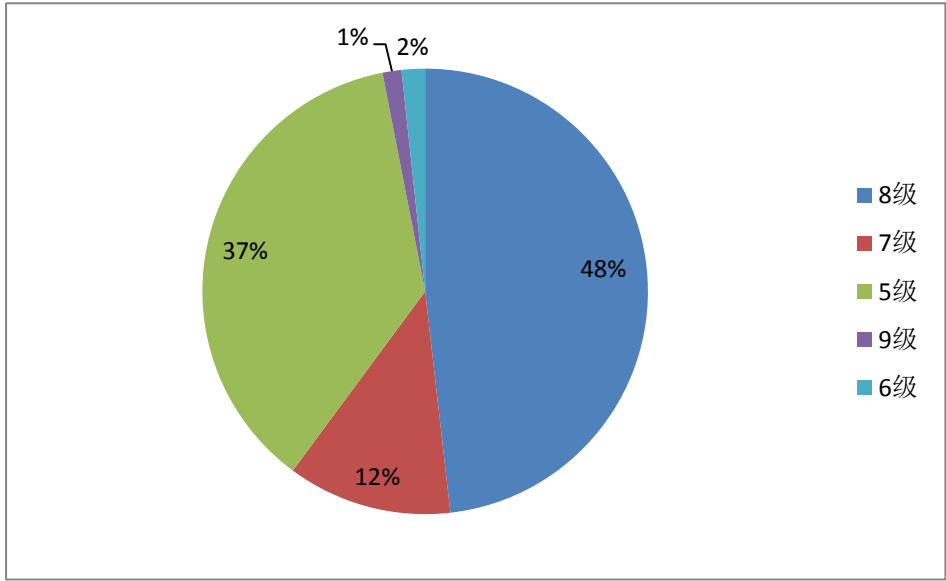
相关收益及计算方法，请具体查阅对应的收益率调整公告及产品说明书。

二、产品投资组合详细情况

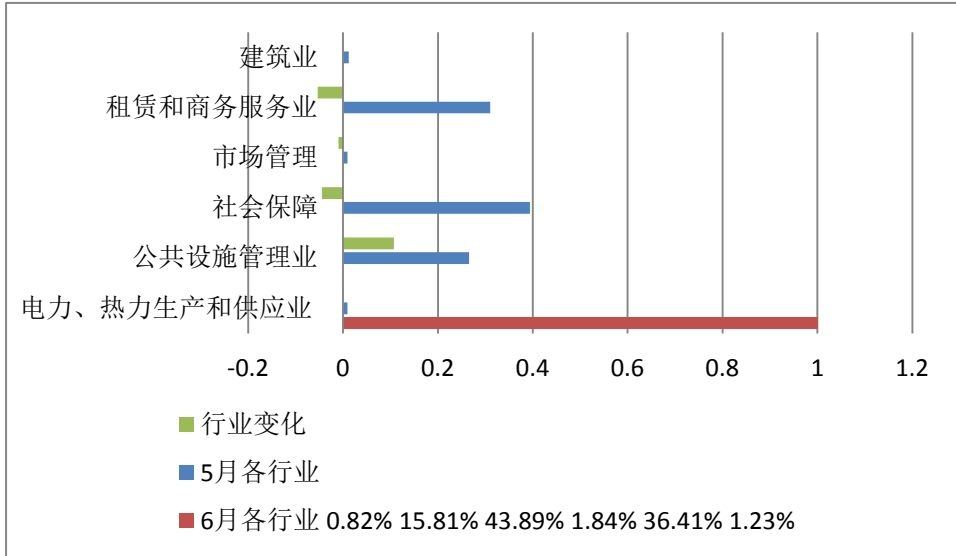
（一）投资组合的基本情况



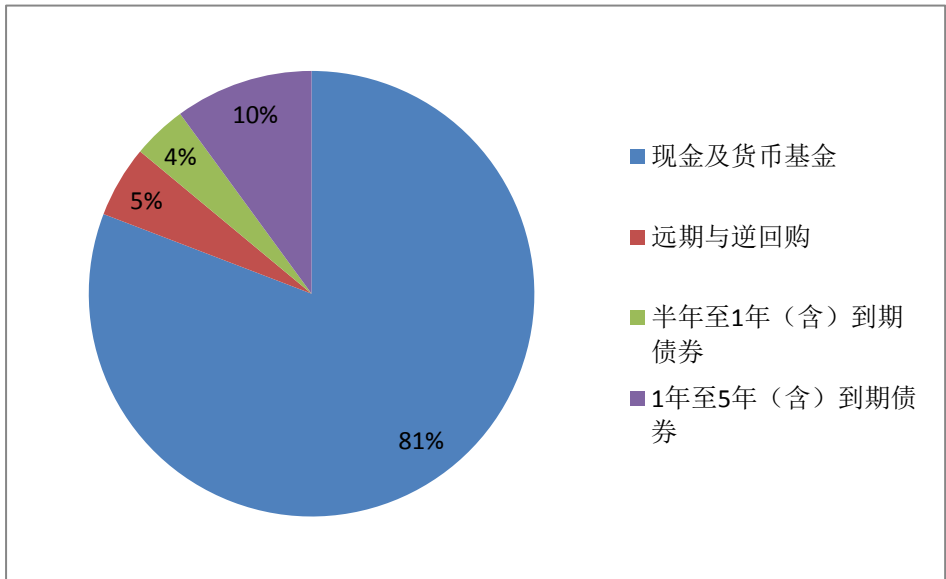
（二）融资类资产的行内评级构成



(三) 融资类资产的行业占比构成及当月增减变化情况



(四) 现金及债券类资产的期限结构



三、投资非标准化债权资产清单（见附录）

四、产品整体运作情况

（1）自本产品成立起至本报告日，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。

（2）截至本报告日，所有项目均能正常还本付息，按预期收益兑付客户。

（3）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形。

中国建设银行辽宁省分行

2017年6月30日

附录

“乾元一天长利久”开放式资产组合型人民币理财产品 投资非标准化债权资产清单

我行依照《中国银监会关于规范商业银行理财业务投资运作有关问题的通知》（银监发【2013】8号）要求，现对“乾元一天长利久”开放式资产组合型人民币理财产品投资非标准化债权资产清单披露如下：

交易结构	融资客户名称	剩余融资期限（天）
委托贷款	14 辽锦州城投 OI001	876
股权投资	14 辽建信广汇 EI001	891
资产收益权	15 辽盘辽滨 AB001	486
资产收益权	15 辽盘辽滨 AB004	542
委托贷款	14 辽万润南站 OI001	873
委托贷款	14 辽万润鑫鸿 OI001	873
资产收益权	15 辽国有 AB001	1224
资产收益权	15 辽盘辽滨 AB003	525
资产收益权	15 辽万赢 AB001	539
资产收益权	15 辽万赢 AB002	539
股权投资	16 辽本城 EI001	1453
股权投资	14 辽富诚资产 EI001	877
股权投资	14 辽天水物产 EI001	912
专户理财	16 辽悦享 OI001	751
专户理财	16 辽悦享 OI002	792

资产收益权	16 辽盘鑫诚 AB001	809
委托贷款	16 辽本社保 OI001	2282
委托贷款	16 辽抚社保 OI001	2301
资产收益权	15 辽盘建投 AB002	483
股权投资	16 辽万晟 EI001	2310
股权投资	16 辽万晟 EI002	2310
股权投资	16 辽万晟 EI003	2310
股权投资	16 辽万晟 EI004	2310
股权投资	16 辽万晟 EI005	2310
委托贷款	16 辽铁社保 TL001	2313
委托贷款	16 辽丹社保 TL001	2314
资产收益权	15 辽万润 AB002	1635
委托贷款	16 辽阳社保 TL001	2336
股权投资	16 辽葫资 EI001	1610
股权投资	16 辽葫城 EI001	1610
股权投资	16 辽铁资 EI001	880
委托贷款	16 辽阜社保 TL001	2356
委托贷款	16 辽营社保 TL001	2363
委托贷款	16 辽朝社保 TL001	2370
委托贷款	16 辽葫社保 TL001	2372
股权投资	16 辽五爱 EI001	1641
资产收益权	17 辽市政 AB001	918
股权投资	17 辽五爱 EI001	1641
委托贷款	17 辽阜社保 TL001	2356
资产收益权	16 辽盘建投 AB001	601
资产收益权	16 辽盘辽滨 AB003	1342
股权投资	16 辽山盟 EI001	1358
股权投资	17 辽产业 EI001	2492
承兑汇票类	17 辽鼎力 AD001	117
承兑汇票类	17 辽鸿亿 AD001	298
委托贷款	17 辽铁社保 TL001	2492
私募基金	17 辽安鑫 OI001	1039
私募基金	17 辽安鑫 OI002	1052
股权收益权	17 辽拓源 EB001	692
资产收益权	17 辽中天 AB001	210
股权投资	17 辽交投 EI001	3645
委托贷款	14 辽锦州城投 OI001	876
股权投资	14 辽建信广汇 EI001	891
资产收益权	15 辽盘辽滨 AB001	486
资产收益权	15 辽盘辽滨 AB004	542
委托贷款	14 辽万润南站 OI001	873
委托贷款	14 辽万润鑫鸿 OI001	873
资产收益权	15 辽国有 AB001	1224
资产收益权	15 辽盘辽滨 AB003	525

资产收益权	15 辽万赢 AB001	539
资产收益权	15 辽万赢 AB002	539
股权投资	16 辽本城 EI001	1453
股权投资	14 辽富诚资产 EI001	877
股权投资	14 辽天水物产 EI001	912
专户理财	16 辽悦享 OI001	751
专户理财	16 辽悦享 OI002	792
资产收益权	16 辽盘鑫诚 AB001	809
委托贷款	16 辽本社保 OI001	2282
委托贷款	16 辽抚社保 OI001	2301
资产收益权	15 辽盘建投 AB002	483
股权投资	16 辽万晟 EI001	2310
股权投资	16 辽万晟 EI002	2310
股权投资	16 辽万晟 EI003	2310
股权投资	16 辽万晟 EI004	2310
股权投资	16 辽万晟 EI005	2310
委托贷款	16 辽铁社保 TL001	2313
委托贷款	16 辽丹社保 TL001	2314
资产收益权	15 辽万润 AB002	1635
委托贷款	16 辽阳社保 TL001	2336
股权投资	16 辽葫资 EI001	1610
股权投资	16 辽葫城 EI001	1610
股权投资	16 辽铁资 EI001	880
委托贷款	16 辽阜社保 TL001	2356
委托贷款	16 辽营社保 TL001	2363
委托贷款	16 辽朝社保 TL001	2370
委托贷款	16 辽葫社保 TL001	2372
股权投资	16 辽五爱 EI001	1641
资产收益权	17 辽市政 AB001	918
股权投资	17 辽五爱 EI001	1641
委托贷款	17 辽阜社保 TL001	2356
资产收益权	16 辽盘建投 AB001	601
资产收益权	16 辽盘辽滨 AB003	1342
股权投资	16 辽山盟 EI001	1358
股权投资	17 辽产业 EI001	2492
承兑汇票类	17 辽鼎力 AD001	117
承兑汇票类	17 辽鸿亿 AD001	298
委托贷款	17 辽铁社保 TL001	2492
私募基金	17 辽安鑫 OI001	1039
私募基金	17 辽安鑫 OI002	1052
股权收益权	17 辽拓源 EB001	692
资产收益权	17 辽中天 AB001	210

到期收益分配详见产品说明书