

中国建设银行江苏省分行“乾元添利”开放式资产组合型人民币理财产品 2015 年 12 月月度投资管理报告

报告日：2015 年 12 月 31 日

中国建设银行江苏省分行“乾元添利”(按日)开放式资产组合型人民币理财产品于 2014 年 1 月 7 日成立。本次公布的信息为自产品成立日至 2015 年 12 月的投资管理情况,供投资者参阅。

一、产品基本情况

产品管理人：中国建设银行江苏省分行

产品托管人：中国建设银行江苏省分行

产品成立日：2014 年 1 月 7 日

产品到期日：无固定期限，中国建设银行有权提前终止产品

二、报告期投资者实际收益率

截至 2015 年 12 月 31 日，产品运作期为 724 个自然日。根据产品说明书的约定，2015 年 12 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日投资者实际收益率如下表所示：

| 投资期 | 1≤ T<7 | 7≤ T<14 | 14≤ T<31 | 31≤ T<61 | 61≤ T<91 | 91≤ T<121 | 121≤ T<181 | 181≤ T<365 | T≥ 365 |
|----------|-----------|------------|-------------|-------------|-------------|--------------|---------------|---------------|-----------|
| 投资者实际收益率 | 2.30% | 2.50% | 2.80% | 3.52% | 3.88% | 4.00% | 4.20% | 4.30% | 4.55% |

其中：T 为投资期，单位：天

相关收益及计算方法，请具体查阅产品说明书或收益率调整公告（如有）。

三、产品投资组合详细情况

（一）月度投资组合的基本情况

| | |
|-----------|--------|
| 债券和货币市场工具 | 79.65% |
|-----------|--------|

| | |
|-------|--------|
| 融资类资产 | 20.35% |
|-------|--------|

(二) 月度配置融资类资产的建行内部评级构成 (占比)

| BBB- | BBB+ | A | A+ | AA- | AA | AA+ | AAA |
|-------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|-------|
| 1.26% | 1.80% | 4.21% | 26.63% | 49.76% | 5.45% | 9.09% | 1.80% |

(三) 月度配置融资类资产的行业占比构成

| 月度 | 2015 年 12 月 |
|---------------------|-------------|
| 电力、热力、燃气及水生产和供应业(D) | 3.30% |
| 房地产业(K) | 1.80% |
| 公共管理、社会保障和社会组织(S) | 6.09% |
| 建筑业(E) | 3.51% |
| 交通运输、仓储和邮政业(G) | 1.91% |
| 农、林、牧、渔业(A) | 0.10% |
| 水利、环境和公共设施管理业(N) | 10.08% |
| 制造业(C) | 5.57% |
| 租赁和商务服务业(L) | 67.64% |
| 合计 | 100.00% |

(四) 债券和货币市场工具的期限结构

| 月度 | 2015 年 12 月 |
|-----------------|-------------|
| 半年 (含) 内到期 | 87.83% |
| 半年至 1 年 (含) 到期 | 6.33% |
| 1 年至 5 年 (含) 到期 | 5.84% |
| 5 年以上到期 | - |

四、产品整体运作情况

(一) 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。

(二) 截至本报告日, 所有投资资产正常运营, 未发现有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形。

中国建设银行江苏省分行

2016 年 1 月 6 日