

上海行智盈2019年第61期固定期限产品季度投资管理报告

报告日：2019年9月30日

上海行智盈2019年第61期固定期限产品于2019年3月27日正式成立。截至报告日，本产品规模为377550000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：

| | |
|----------|-------|
| 投资期(天) | 278 |
| 投资者实际收益率 | 4.35% |

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 |
|----------------------|-----------|-----------|-----------|------------|
| 上海行智盈2019年第61期固定期限产品 | 2019/3/20 | 2019/3/26 | 2019/3/27 | 2019/12/30 |

理财产品管理人：中国建设银行上海市分行

理财产品托管人：中国建设银行上海市分行

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 | 1,503.75 | 3.90% | 2,257.46 | 5.85% |
| 同业存单 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 拆放同业及买入返售 | 0.00 | 0.00% | 10.73 | 0.03% |
| 债券 | 0.00 | 0.00% | 13,096.61 | 33.93% |
| 理财直接融资工具 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 新增可投资资产 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 非标准化债权类资产 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 权益类投资 | 21,995.69 | 56.99% | 23,231.61 | 60.19% |
| 金融衍生品 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 代客境外理财投资QDII | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 商品类资产 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 另类资产 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 公募基金 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 私募基金 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 资产管理产品 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |

| | | | | |
|------------|-----------|---------|-----------|---------|
| 委外投资——协议方式 | 15,096.99 | 39.11% | 0.00 | 0.00% |
| 合计 | 38,596.42 | 100.00% | 38,596.42 | 100.00% |

注：截止报告日本产品募集本金及应付投资者收益合计38596.42万元

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 | 16沪中科EB002 | 219956850 | 56.99% |
| 2 | 15融信01 | 6776652.698 | 1.76% |
| 3 | 15新湖债 | 5927273.77 | 1.54% |
| 4 | 18恒逸CP002 | 4694825.817 | 1.22% |
| 5 | 19漳九01 | 4062771.988 | 1.05% |
| 6 | 深圳证券清算款 | 3888510.788 | 1.01% |
| 7 | 结算备付金 | 3599550.242 | 0.93% |
| 8 | 18电投07 | 3417839.634 | 0.89% |
| 9 | 19复星高科MTN001 | 3414150.474 | 0.88% |
| 10 | 18海淀国资MTN002 | 3404089.126 | 0.88% |

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

由于产品存续期内，客户无提前终止权，不可赎回本期产品，产品管理人会根据产品到期时间合理调整资产配置，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

见附件。

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 | 人民币专用存款账户 | 31001550400050042595-0802 | 中国建设银行股份有限公司上海市分行 投资银行理财产品托管专户 | 建设银行上海市分行 |

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 | 16七匹狼MTN001 | 一般中期票据 | 101654091.IB | 20,000.00 | 97.9194 | 中国建设银行 | 主承销商 |

(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，所有投资资产正常运营，未发现异常情况或不利情况。

(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
2019年9月30日

附录一

上海行智盈2019年第61期固定期限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，现对上海行智盈2019年第61期固定期限产品投资非标准化债权及股权类资产清单披露如下：

| 交易结构 | 融资客户名称 | 项目名称 | 剩余融资期限 (天) | 风险状况 |
|------------|------------------------|------------|---------------|------|
| 股权投资类(非回购) | 中科招商投资管理集团（上海）资产管理有限公司 | 16沪中科EB002 | 1213 | 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。

托 管 报 告

2019年第三季度

2019 年第三季度托管人报告

中国建设银行股份有限公司资产管理业务中心：

我行作为中国建设银行上海分行非净值型理财产品的托管人，根据理财产品说明书履行托管职责。

本报告期内，托管人在执行非净值型理财产品的托管过程中，严格遵守了国家有关法律法规、托管协议、和其他有关规定，勤勉尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在损害理财产品持有人的行为。

本报告期内，托管人对非净值型理财产品估值的计算等方面进行了复核，对非净值型理财产品的投资运作进行了监督，管理人能够按照法规、合同协议等要求进行规范投资，投资比例监督指标正常，未发现违规行为。

托管人复核了本报告中的有关内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国建设银行股份有限公司基金托管部上海分部



2019年10月8日