乾元日日盈开放式资产组合型理财产品年度投资管理报告

报告日：2020年12月31日

乾元日日盈开放式资产组合型理财产品于2014年04月03日正式成立。截至报告日，本产品规模为11,263,780,150.00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（或档期设置）　　31318天

投资者实际收益率

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
乾元日日盈开放式资产组合型理财产品	20140328	20140402	20140403	20991231

理财产品管理人：

理财产品托管人：

三、期末资产持仓

资产类别	穿透前金额（元）	占全部产品总资产的比例（%）	穿透后金额（元）	全部产品总资产的比例（%
现金及银行存款	2,154,100,973.73	19.81%	2,173,848,197.43	20.00%
债券	6,365,562,600.00	58.55%	6,386,382,909.61	58.75%
非标准化债权类资产	308,500,000.00	2.84%	308,500,000.00	2.84%
公募基金	2,002,438,681.12	18.42%	2,002,438,681.12	18.42%
委外投资——协议方式	40,567,533.31	0.37%	0.00	0.00%
合计	**10,871,169,788.16**	**100.00%**	**10,871,169,788.16**	**100.00%**

四、前十大投资资产明细

序号	资产名称	投资规模（元）	资产占比（%）
1	现金及活期存款	2,154,100,973.73	19.81%
2	建信天添益C（建信基金）	2,002,438,681.12	18.42%
3	17工商银行二级01	1,167,000,000.00	10.73%
4	18农业银行二级01	1,100,000,000.00	10.12%
5	18旭辉02	800,000,000.00	7.36%
6	20飞驰建瓴ABN001优先	510,000,000.00	4.69%
7	20农业银行永续债01（上海分行）	500,000,000.00	4.60%
8	上海分行16东航集MTN001(101654049)	336,000,000.00	3.09%
9	上海分行16沪公积金2次(061608002)	335,100,000.00	3.08%
10	16沪苏州恒翌CD001	308,500,000.00	2.84%

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

六、托管人报告（公募产品半年报及年度报告需提供）

（一）报告期内本理财产品托管人遵规守信情况声明
本报告期内，中国建设银行股份有限公司在对理财产品的托管过程中，严格遵守了国家有关法律法规、本理财产品合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害资产委托人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。
（二）托管人对报告期内本理财产品运作遵规守信、合规投资的情况说明
本报告期内，本托管人严格按照国家法律法规、本理财产品合同、托管协议和其他有关规定，对本理财产品的投资运作方面进行了监督，未发现管理人存在损害资产委托人利益的行为。
（三）托管人对本报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人复核了本报告中的理财产品规模等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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	托管账户	31001550400050042595-0001	国建设银行股份有限公司上海市分行投	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东航集MTN001	中期票据	101654049	7000000	100	中国建设银行股份有限公司	承销商
2	16沪公积金2A	资产支持证券	061608001	660000	40.68	中国建设银行股份有限公司	承销商
3	16中航租赁PPN003	定向工具	031654013	2000000	100	中国建设银行股份有限公司	承销商
4	16建信人寿	金融债	1623001	1750000	100	中国建设银行股份有限公司	承销商
5	16沪公积金2次	资产支持证券	061608002	3351000	100	中国建设银行股份有限公司	承销商
6	18光大幸福PPN001	定向工具	031800071	1800000	100	中国建设银行股份有限公司	承销商
7	18致达MTN001	中期票据	101800365	1000000	100	中国建设银行股份有限公司	承销商
8	20农业银行永续债01	金融债	2028017	5000000	100	中国建设银行股份有限公司	承销商
9	20沪建工MTN001	中期票据	102001466	1000000	100	中国建设银行股份有限公司	承销商
10	20飞驰建瓴ABN001优先	资产支持证券	082000628	5100000	100	中国建设银行股份有限公司	承销商

（二）其他重大关联交易

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，未发现有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

2020年12月31日

附录一

乾元日日盈开放式资产组合型理财产品投资非标准化债权及股权类资产清单

报告日：2020年12月31日

我行依照监管要求，现对乾元日日盈开放式资产组合型理财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
委托债权	苏州恒翌房地产开发有限责任公司	16沪苏州恒翌CD001	236	正常

除上述资产外，产品投资其他资产的风险状况：

项目名称	风险状况

到期收益分配详见产品说明书。

)