

## 上海行乾元—日日增利开放式产品季度投资管理报告

报告日：2021年03月31日

上海行乾元—日日增利开放式产品于2017年11月24日正式成立。截至报告日，本产品规模为8,124,343,646.39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） 2922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
上海行乾元—日日增利开放式产品	20171121	20171123	20171124	20251124

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）	部产品总资产的比例（%）
现金及银行存款	214,794,394.10	2.34%	2,498,794,496.60	27.17%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	753,000,000.00	8.19%
债券	749,700,000.00	8.15%	749,700,000.00	8.15%
非标准化债权类资产	5,193,981,007.16	56.48%	5,193,981,007.16	56.48%
公募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
委托投资——协议方式	3,037,000,102.50	33.03%	0.00	0.00%
<b>合计</b>	<b>9,195,475,503.76</b>	<b>100.00%</b>	<b>9,195,475,503.76</b>	<b>100.00%</b>

### 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	17沪协信EB001	1,012,000,000.00	11.01%
2	结算备付金	787,201,036.64	8.56%
3	16沪聚博EI001	785,000,000.00	8.54%
4	R-001	753,000,000.00	8.19%
5	17沪华闻EB001	619,775,744.00	6.74%
6	16沪坤安EI001	596,000,000.00	6.48%
7	18沪世茂建设EI001	579,605,263.16	6.30%
8	上海证券清算款	507,781,703.39	5.52%
9	17沪景绰EI002	490,170,000.00	5.33%
10	银行存款_活期_银行存款	409,352,222.90	4.45%

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）

## 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	31001550400050042595-0338	中国建设银行股份有限公司上海市分行投资	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
----	------	------	------	------	------	-------	-------

### （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  
2021年03月31日

## 附录一

### 上海行乾元—日日增利开放式产品投资非标准化债权及股权类资产清单

报告日：2021年03月31日

我行依照监管要求，现对上海行乾元—日日增利开放式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（带回购）	上海聚博房地产开发有限公司	16沪聚博EI001	1,906	正常
股权投资类（带回购）	上海景绰企业发展有限公司	17沪景绰EI001	1,606	正常
股权投资类（带回购）	上海景绰企业发展有限公司	17沪景绰EI002	1,606	正常
股权收益权类（带回购）	山南华闻创业投资有限公司	17沪华闻EB001	1,248	正常
股权收益权类（带回购）	山南华闻创业投资有限公司	17沪华闻EB002	1,248	正常
股权收益权类（带回购）	上海协信进瀚投资有限公司	17沪协信EB001	994	正常
股权投资类（带回购）	上海世茂建设有限公司	18沪世茂建设EI001	729	正常

股权投资类（带回购）	上海临港经济发展(集团)有限公司	15临港园开基金OB002	609	正常
股权收益权类（带回购）	上海隆源资产经营有限公司	17沪隆源EB001	579	正常
股权投资类（带回购）	上海三湘文化发展有限公司	17沪三湘EB001	542	正常
股权投资类（带回购）	上海临港经济发展(集团)有限公司	15临港园开基金OB001	448	正常
股权投资类（带回购）	建银国际资产管理（上海）有限公司	17沪建曦基金OB001	448	正常
股权投资类（带回购）	正荣集团有限公司	16沪正荣EB001	170	正常
股权投资类（带回购）	上海坤安置业有限公司	16沪坤安EI001	103	正常
股权投资类（带回购）	上海建工集团股份有限公司	17沪建工股权激励OI001	55	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
17中民G1	资产本金已逾期超过90天
17中民G1（二级市场购买）	资产本金已逾期超过90天
18中民G1	资产利息已逾期超过90天

到期收益分配详见产品说明书。



