**中国建设银行云南省分行“乾元-稳赢” (公募) 2019年第1期封闭式净值型人民币理财产品2019年3季度投资管理报告**

报告日：2019年9月30日

中国建设银行云南省分行“乾元-稳赢” (公募) 2019年第1期封闭式净值型人民币理财产品于2019年8月30日正式成立。截至报告日，本产品规模为300608618.28元，杠杆水平符合监管要求。窗体顶端

窗体底端**一、报告期投资者实际收益率**

截至2019年9月30日，产品单位净值为1.004037。本报告期内，产品存续规模如下：

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 日期 | 份额净值 | 累计净值 | 资产净值 |
| 2019年9月30日 | 1.004037 | 1.004037 | 300608618.28 |
| 2019年8月31日 | 1.000252 | 1.000252 | 299475520.86 |

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 |
| 中国建设银行云南省分行“乾元-稳赢” (公募) 2019年第1期封闭式固定收益类净值型人民币理财产品 | 2019-8-23 | 2019-8-29 | 2019-8-30 | 2020-12-25 |

理财产品管理人：中国建设银行股份有限公司云南省分行

理财产品托管人：中国建设银行股份有限公司云南省分行

**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（%） |
| 非标准化债权类资产 | 29940.00 | 100 | 29940.00 | 100 |
| 合计 | 29940.00 | 100 | 29940.00 | 100 |

**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 | 19云滇城投AB001 | 299400000.00 | 100 |

注：本表列示穿透后投资规模占比较高的前十项资产

**五、风险分析**

（一）产品的流动性风险情况

|  |
| --- |
| 如：由于产品存续期内，客户无提前终止权，不可赎回本期产品，且所投组合内所有非标资产到期日均不晚于产品到期日，故投资组合流动性风险较低。 |

（二）产品的投资风险情况

1.产品债券持仓风险及价格波动情况

|  |
| --- |
| 本产品未投资于债券资产。 |

2.产品股票持仓风险及价格波动情况（针对权益类及混合类产品）

|  |
| --- |
| 本产品未投资于股票资产。 |

3.产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况（针对商品及金融衍生品类与混合类产品）

|  |
| --- |
| 本产品未投资于衍生品。 |

**六、托管人报告**（公募产品半年报及年度报告需提供）

|  |
| --- |
| 2019年第3季度托管人报告中国建设银行股份有限公司云南省分行（以下简称管理人）于2019年8月成立云南省分行“乾元-稳赢” (公募) 2019年第1期封闭式净值型人民币理财产品，托管人为中国建设银行股份有限公司云南省分行（以下简称托管人）。托管人于2019年8月30日开始履行托管职责。2019年第3季度，托管人在执行本理财产品的托管过程中，根据银监会的要求，严格遵守有关法律和保管合同的约定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何违背保管合同的行为。2019年第3季度，托管人未发现管理人有违背理财产品说明书约定的行为。中国建设银行股份有限公司云南省分行托管分中心 2019年 10月14日 |

**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 | 托管户 | 53050187503600000060-0060 | 中国建设银行股份有限公司云南省分行投资银行理财产品托管专户 | 中国建设银行股份有限公司昆明祥云支行 |

**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

无

（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

 中国建设银行云南省分行

2019年10月15日

**附录一**

**中国建设银行云南省分行“乾元-稳赢” (公募) 2019年第1期封闭式净值型人民币理财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，现对中国建设银行云南省分行“乾元-稳赢” (公募) 2019年第1期封闭式净值型人民币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** |
| 本期理财产品募集资金投资于云南滇中城市建设投资开发有限责任公司持有至到期的资产收益权（海益二号债券投资集合资金信托计划），用于云南滇中城市建设投资开发有限责任公司滇中空港商务广场配套酒店装修使用，由云南省滇中产业发展集团有限责任公司提供连带责任保证。 | 云南滇中城市建设投资开发有限责任公司 | 云南滇中城市建设投资开发有限责任公司非标准化债权资产 | 452 | 正常 |

 到期收益分配详见产品说明书。