

上海行乾元—日日增利开放式产品年度投资管理报告

报告日：2020年12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11,460,400,007.14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）	与全部产品总资产的比例（%）
现金及银行存款	2,451,988,760.70	19.68%	2,593,283,866.64	20.81%
同业存单	0.00	0.00%	182,688,269.49	1.47%
债券	955,000,000.00	7.66%	3,280,261,943.77	26.33%
非标准化债权类资产	5,219,205,263.16	41.89%	5,219,205,263.16	41.89%
权益类投资	0.00	0.00%	156,172,490.11	1.25%
公募基金	1,002,066,361.00	8.04%	1,027,688,742.29	8.25%
委外投资——协议方式	2,831,040,190.60	22.72%	0.00	0.00%
合计	12,459,300,575.46	100.00%	12,459,300,575.46	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	2,451,988,760.70	19.68%
2	16沪坤安EI001	2,147,000,000.00	17.23%
3	16沪聚博EI001	785,000,000.00	6.30%
4	19沪绿地金控EB001	750,000,000.00	6.02%
5	建信现金增利货币B（建信基金）	501,041,991.42	4.02%
6	建信现金添益货币A（建信基金）	501,024,369.58	4.02%
7	17沪景绰EI002	420,170,000.00	3.37%
8	17中民G1（二级市场购买）	300,000,000.00	2.41%
9	18中民G1	300,000,000.00	2.41%
10	17沪绿地EB002	240,000,000.00	1.93%

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	31001550400050042595-0338	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
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中航租赁PPN001	定向工具	031654013	2000000	100	中国建设银行股份有限公司	承销商
3	20均瑶SCP006	短期融资券	012002484	1000000	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，产品管理人格尽职守、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
2020年12月31日

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：2020年12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	1,996	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	1,696	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	1,696	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	1,338	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	1,084	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	819	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	669	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	538	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	538	正常
股权投资类（带回购）	正荣集团有限公司	16沪正荣EB001	260	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	193	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	145	正常
股权收益权类（带回购）	绿地控股集团有限公司	17沪绿地EB002	89	正常
股权投资类（带回购）	绿地金融投资控股集团有限公司	19沪绿地金控EB001	64	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。

