**乾元-福润潇湘开放式资产组合型理财产品半年度投资管理报告**

报告日：2020年06月30日

乾元-福润潇湘开放式资产组合型理财产品于2016年11月16日正式成立。截至报告日，本产品规模为4,432,261,239.14元，杠杆水平符合监管要求。

窗体底端**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） | 30359天 |
| 投资者实际收益率 | (年化) |

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-福润潇湘开放式资产组合型理财产品 | 20161111 | 20161115 | 20161116 | 20991230 |

理财产品管理人：中国建设银行湖南省分行

理财产品托管人：中国建设银行湖南省分行

**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） | 占全部产品总资产的比例（%） |
| 现金及银行存款 | 389,879,351.45 | 8.86% | 389,879,351.45 | 8.86% |
| 同业存单 |  |  |  |  |
| 拆放同业及买入返售 |  |  |  |  |
| 债券 | 3,734,239,781.69 | 84.90% | 3,734,239,781.69 | 84.90% |
| 理财直接融资工具 |  |  |  |  |
| 新增可投资资产 |  |  |  |  |
| 非标准化债权类资产 | 262,156,197.02 | 5.96% | 262,156,197.02 | 5.96% |
| 权益类投资 | 191,137,903.98 | 4.35% | 191,137,903.98 | 4.35% |
| 金融衍生品 |  |  |  |  |
| 代客境外理财投资QDII |  |  |  |  |
| 商品类资产 |  |  |  |  |
| 另类资产 |  |  |  |  |
| 公募基金 |  |  |  |  |
| 私募基金 | 1,397,197,829.42 | 31.76% |  |  |
| 资产管理产品 |  |  |  |  |
| 委外投资——协议方式 |  |  |  |  |
| 合计 | 5,974,611,063.56 | 135.83% | 4,577,413,234.14 | 104.07% |

**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 | 20农业银行永续债01 | 600,000,000.00 | 13.64% |
| 2 | 19中联重科MTN001 | 600,000,000.00 | 13.64% |
| 3 | 18农业银行二级01 | 500,000,000.00 | 11.37% |
| 4 | 现金及活期存款 | 389,879,351.45 | 8.86% |
| 5 | 17中国银行二级02 | 356,503,493.26 | 8.10% |
| 6 | 19湘潭九华MTN001 | 300,000,000.00 | 6.82% |
| 7 | 19振湘国资PPN001 | 240,000,000.00 | 5.46% |
| 8 | 18湘张家界交投AB001 | 221,123,992.56 | 5.03% |
| 9 | 20三一MTN002 | 200,000,000.00 | 4.55% |
| 10 | 19三一MTN002 | 177,400,000.00 | 4.03% |

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**

|  |
| --- |
| 1、协助委托人按照约定在托管人处开立托管账户；  2、管理该托管账户，保管托管账户内的一切财产，保证投资计划财产的独立、安全和完整；  3、根据委托人通知，接受委托人的资金划拨，及时托管投资计划财产；  4、保存投资计划资金收款通知、划款指令、收益计算、支付及分配的会计账册、报表等； |

**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 | 43050186363600000184-0008 | 中国建设银行股份有限公司湖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湖南省分行营业部 |

**八、报告期内关联交易情况**

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

2020年06月30日

**附录一**

**乾元-福润潇湘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06月30日

我行依照监管要求，现对乾元-福润潇湘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** |
| 股权投资类（带回购） | 张家界市交通建设投资集团有限公司 | 18湘张家界交投AB001 | 2,377 | 正常 |
| 资产收益权类 | 湖南郴电国际发展股份有限公司 | 17湘郴电国际AB001 | 1,552 | 正常 |
| 产业基金 | 长沙天心城市建设投资开发集团有限公司 | 17湘天心城投AB002 | 1,276 | 正常 |
| 产业基金 | 张家界市经济发展投资集团有限公司 | 18湘张家界经投OB001 | 636 | 正常 |
| 股权投资类(非回购) | 永州市顺发投资建设有限责任公司 | 17永州经投AB001 | 358 | 正常 |
| 股权投资类（带回购） | 湖南天环经济开发有限责任公司 | 16湘天心城投AB002 | 350 | 正常 |
| 股权投资类(非回购) | 步步高投资集团股份有限公司 | 17湘步步高AB001 | 342 | 正常 |
| 产业基金 | 长沙市芙蓉城市建设投资集团有限公司 | 16芙蓉城投AB002 | 253 | 正常 |
| 产业基金 | 长沙市城北投资有限公司 | 18湘城北OB001 | 244 | 正常 |
| 股权投资类(非回购) | 湘电集团有限公司 | 18湘湘电集团AB001 | 202 | 正常 |
| 产业基金 | 株洲市国有资产投资控股集团有限公司 | 15湘株国投AB001 | 140 | 正常 |
| 产业基金 | 株洲市国有资产投资控股集团有限公司 | 17湘株国投AB001 | 140 | 正常 |
| 股权投资类(非回购) | 中国水利水电第八工程局有限公司 | 17湘水电八局AB001 | 92 | 正常 |

除上述资产外，产品投资其他资产的风险状况：

到期收益分配详见产品说明书。