

附件

“乾元一天长利久”开放式资产组合型人民币理财产品 月度投资管理报告

报告日：2017 年 9 月 30 日

“乾元-天长利久”开放式资产组合型人民币理财产品于 2016 年 3 月 2 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 528195168.06 元。

一、报告期投资者实际收益率

根据产品说明书的约定，2016 年 3 月 2 日至 2016 年 5 月 11 日投资者实际收益率如下表所示：

投资期	$1 \leq T < 32$	$32 \leq T < 63$	$63 \leq T < 93$	$93 \leq T < 120$	$120 \leq T < 270$	$270 \leq T < 365$	$T \geq 365$
投资者实际收益率	2.05%	3.15%	3.35%	3.60%	3.75%	4.05%	4.25%

其中：T 为投资期，单位：天

2016 年 5 月 12 日至 2016 年 7 月 14 日投资者实际收益率如下表所示：

投资期	$1 \leq T < 32$	$32 \leq T < 63$	$63 \leq T < 93$	$93 \leq T < 180$	$180 \leq T < 365$	$365 \leq T < 730$	$T \geq 730$
投资者实际收益率	2.05%	3.15%	3.25%	3.60%	3.75%	4.05%	4.25%

其中：T 为投资期，单位：天

2016 年 7 月 15 日至 2016 年 8 月 15 日投资者实际收益率如下表所示：

投资期	$1 \leq T < 30$	$30 \leq T < 60$	$60 \leq T < 90$	$90 \leq T < 180$	$180 \leq T < 365$	$T \geq 365$
投资者实际收益率	1.95%	2.55%	3.05%	3.40%	3.60%	3.80%

其中：T 为投资期，单位：天

2016 年 8 月 16 日至 2017 年 2 月 21 日投资者实际收益率如下表所示：

投资期	$1 \leq T < 30$	$30 \leq T < 60$	$60 \leq T < 90$	$90 \leq T < 180$	$180 \leq T < 365$	$T \geq 365$
-----	-----------------	------------------	------------------	-------------------	--------------------	--------------

投资者实际收益率	1.95%	2.35%	2.85%	3.05%	3.35%	3.55%
----------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

其中：T 为投资期，单位：天

2017 年 2 月 22 日至 2017 年 6 月 9 日投资者实际收益率如下表所示：

投资期	$1 \leq T < 30$	$30 \leq T < 60$	$60 \leq T < 90$	$90 \leq T < 180$	$180 \leq T < 365$	$T \geq 365$
投资者实际收益率	2.10%	2.45%	3.00%	3.20%	3.45%	3.55%

其中：T 为投资期，单位：天

2017 年 6 月 10 日至 2017 年 8 月 31 日投资者实际收益率如下表所示：

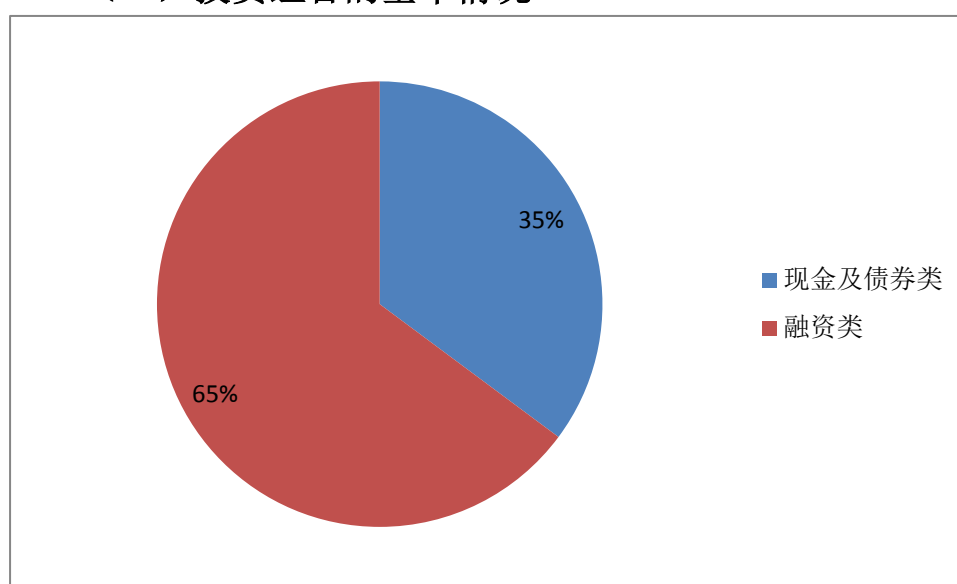
投资期	$1 \leq T < 7$	$7 \leq T < 14$	$14 \leq T < 30$	$30 \leq T < 60$	$60 \leq T < 90$	$90 \leq T < 180$	$90 \leq T < 180$	$T \geq 365$
投资者实际收益率	2.30%	2.50%	2.80%	3.30%	3.40%	3.50%	3.70%	4.00%

其中：T 为投资期，单位：天

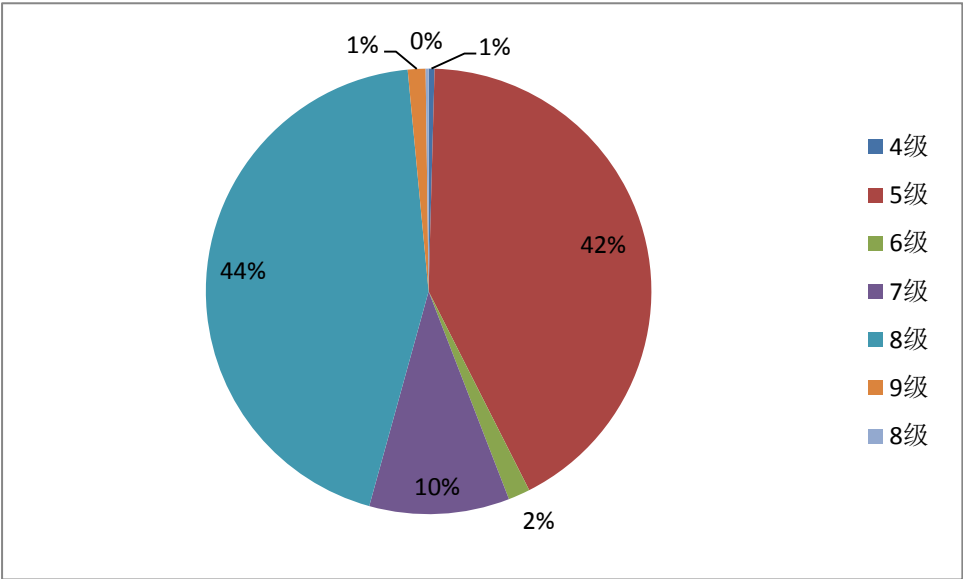
相关收益及计算方法，请具体查阅对应的收益率调整公告及产品说明书。

二、产品投资组合详细情况

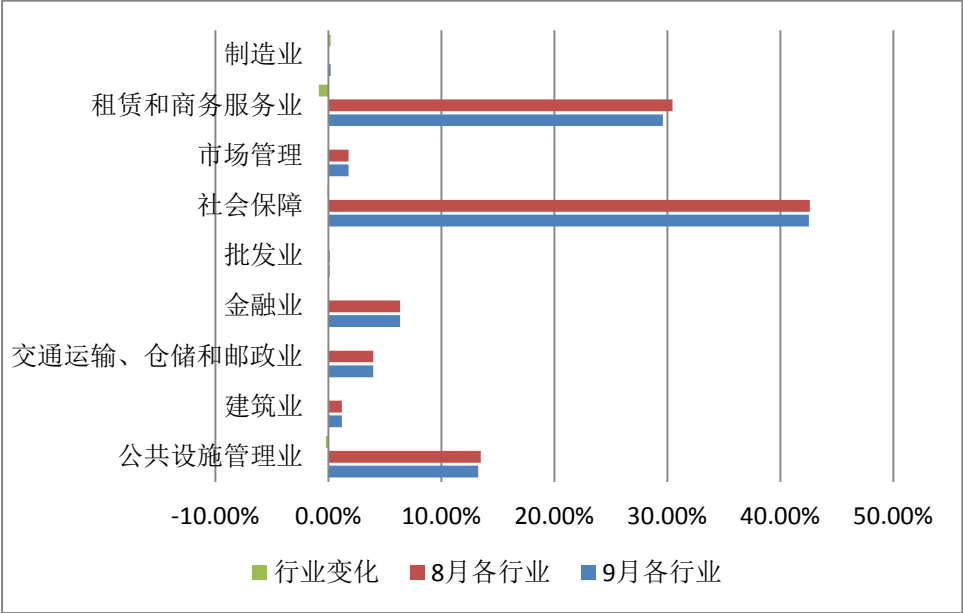
（一）投资组合的基本情况



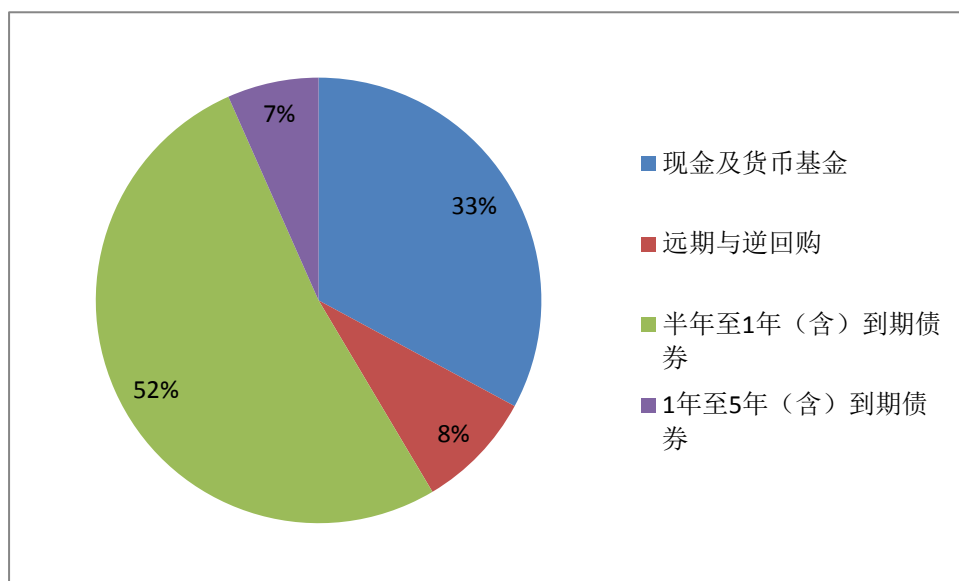
（二）融资类资产的行内评级构成



（三）融资类资产的行业占比构成及当月增减变化情况



（四）现金及债券类资产的期限结构



三、产品整体运作情况

（1）自本产品成立起至本报告日，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。

（2）截至本报告日，所有项目均能正常还本付息，按预期收益兑付客户。

（3）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形。

中国建设银行辽宁省分行

2017年9月30日