**稳赢扶享（公募）四川2018年第1期净值型理财产品**

**季度投资管理报告**

报告日：2019年9月30日

中国建设银行稳赢扶享（公募）四川2018年第1期净值型理财产品（产品编码：SC052018038360D01）于2018年9月14日正式成立。截至报告日，本产品规模为93712500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1.001521。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 |
| 2019/9/30 | 1.001521 | 1.057934 | 93,854,997.41 |
| 2019/8/30 | 1.010796 | 1.053220 | 94,724,220.15 |
| 2019/7/30 | 1.006082 | 1.048507 | 125,709,945.90 |
| 2019/6/30 | 1.001521 | 1.043945 | 125,140,048.95 |

（注：本产品于2019年8月20日提前部分终止了25%的产品份额，导致8月20日后资产净值下降。）

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“乾元-稳赢-扶享”(公募)四川2018年第1期封闭式固定收益类净值型人民币理财产品 | 2018-9-7 | 2018-9-13 | 2018-9-14 | 2020-6-12 |

理财产品管理人：中国建设银行股份有限公司四川省分行

理财产品托管人：中国建设银行股份有限公司四川省分行

**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（%） |
| 现金及银行存款 |  |  |  |  |
| 同业存单 |  |  |  |  |
| 拆放同业及买入返售 |  |  |  |  |
| 债券 |  |  |  |  |
| 理财直接融资工具 |  |  |  |  |
| 新增可投资资产 |  |  |  |  |
| 非标准化债权类资产 | 9371.25 | 100 | 9371.25 | 100 |
| 权益类投资 |  |  |  |  |
| 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 |  |  |  |  |
| 资产管理产品 |  |  |  |  |
| 委外投资——协议方式 |  |  |  |  |
| 合计 | 9371.25 | 100 | 9371.25 | 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 | 川发颐丰公司土地增减挂钩项目资产收益权 | 93712500 | 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

|  |
| --- |
| 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早于产品到期日，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（针对固收类及混合类产品）

|  |
| --- |
| 无 |

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）

|  |
| --- |
| 无 |

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）

|  |
| --- |
| 无 |

**六、托管人报告**

|  |
| --- |
| 本季度无。 |

**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 | 一般账户 | / | 四川省川发颐丰实业有限公司 | 四川省川发颐丰实业有限公司 |

**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 | / | / | / | / | / | / | / |
| 2 | / | / | / | / | / | / | / |
| …… | / | / | / | / | / | / | / |

（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

2019年10月21日

**附录一**

**稳赢扶享（公募）四川2018年第1期净值型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，现对稳赢扶享（公募）四川2018年第1期净值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** |
| 资产收益权 | 四川省川发颐丰实业有限公司 | 四川省泸州市叙永县及合江县城乡建设用地增减挂钩项目 | 256 | 正常 |

除上述资产外，产品投资其他资产的风险状况：无其他资产。

到期收益分配详见产品说明书。