

## 北京乾元20年028期标准组合对公理财季度投资管理报告

报告日：2020年03月31日

北京乾元20年028期标准组合对公理财于2020年03月25日正式成立。截至报告日，本产品规模为80,000,000.00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） 91天  
投资者实际收益率 3.55%

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
北京乾元20年028期标准组合对公理财			20200325	20200624

理财产品管理人：中国建设银行北京市分行

理财产品托管人：中国建设银行北京市分行

### 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	98,410.96	0.15%	1,291,618.84	1.95%
同业存单	0.00	0.00%	6,007,107.03	9.09%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	3,599,524.20	5.45%
债券	0.00	0.00%	51,506,069.98	77.92%
权益类投资	0.00	0.00%	3,694,090.92	5.59%
委托投资——协议方式	66,000,000.00	99.85%	0.00	0.00%
合计	66,098,410.96	100.00%	66,098,410.96	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	GC007	3,599,524.20	5.45%
2	19苏城投SCP002	2,302,975.31	3.48%
3	19东航股SCP014	1,829,062.12	2.77%
4	19杭金投SCP009	1,733,838.35	2.62%
5	19豫交投SCP003	1,489,514.01	2.25%
6	人民币	1,193,207.88	1.81%
7	19国开03	1,174,688.50	1.78%
8	19温交投SCP002	1,156,649.44	1.75%
9	19中节能SCP002	1,156,245.37	1.75%
10	19常城建SCP013	1,153,783.01	1.75%

注：本表列示穿透后投资规模占比较高的前十名资产

### 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（公募产品半年报及年度报告需提供）

### 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	11050137510000006434	中国建设银行股份有限公司北京市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北京复兴支行

### 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

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
----	------	------	------	------	------	-------	-------

（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

无

### 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03月31日