

2017 半年度投资运作报告

产品编号	成立日	到期日	存续期限	挂钩标的	2017年6月30号挂钩标的定盘价格	收益表现	销售手续费	托管费	投资管理费	实际投资资产种类及投资比例
TLG170039	2017/3/15	2018/3/15	365	1288+2800+1398	1288. HK 3.69 2800. HK 26.25 1398. HK 5.27	N/A	0.20%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于港股衍生产品市场。
TLG170086	2017/5/24	2018/5/24	365	1288+2800+1398	1288. HK 3.69 2800. HK 26.25 1398. HK 5.27	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于港股衍生产品市场。
TLG170105	2017/6/23	2017/12/27	187	1288+2800+1398	1288. HK 3.69 2800. HK 26.25 1398. HK 5.27	N/A	0.20%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于港股衍生产品市场。
TLG170023	2017/2/24	2017/8/25	182	1398+939+2601	1398. HK 5.27 939. HK 6.05 2601. HK 31.9	N/A	0.20%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于港股衍生产品市场。
TLG170070	2017/4/28	2017/10/30	185	1398+939+2800	2800. HK 26.25 1398. HK 5.27 939. HK 6.05	N/A	0.20%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于港股衍生产品市场。
TLG170080	2017/5/12	2017/11/14	186	1398+939+2800	2800. HK 26.25 1398. HK 5.27 939. HK 6.05	N/A	0.20%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于港股衍生产品市场。
TLG170092	2017/6/2	2017/12/4	185	1398+939+2800	2800. HK 26.25 1398. HK 5.27 939. HK 6.05	N/A	0.20%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行

										通过掉期交易，投资于港股衍生产品市场。
TLG160484	2016/11/23	2017/11/22	364	2601+700+1398	2601. HK 31.9 700. HK 279.2 1398. HK 5.27	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于港股衍生产品市场。
TLG170040	2017/3/17	2017/9/15	182	2800+1288+1398	1288. HK 3.69 2800. HK 26.25 1398. HK 5.27	N/A	0.20%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于港股衍生产品市场。
TLG170045	2017/3/24	2017/9/22	182	2800+1288+1398	1288. HK 3.69 2800. HK 26.25 1398. HK 5.27	N/A	0.20%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于港股衍生产品市场。
TLG170057	2017/4/12	2018/4/12	365	2800+1288+1398	1288. HK 3.69 2800. HK 26.25 1398. HK 5.27	N/A	0.20%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于港股衍生产品市场。
TLG170063	2017/4/19	2018/4/19	365	2800+1288+1398	1288. HK 3.69 2800. HK 26.25 1398. HK 5.27	N/A	0.20%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于港股衍生产品市场。
TLG170074	2017/5/5	2017/11/6	185	2800+1288+1398	1288. HK 3.69 2800. HK 26.25 1398. HK 5.27	N/A	0.20%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于港股衍生产品市场。
TLG170084	2017/5/19	2017/11/20	185	2800+1288+1398	1288. HK 3.69 2800. HK 26.25 1398. HK 5.27	N/A	0.20%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于港股衍生产品市场。

										股衍生产品市场。
TLG170100	2017/6/16	2017/12/18	185	2800+1288+1398	1288. HK 3.69 2800. HK 26.25 1398. HK 5.27	N/A	0.20%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于港股衍生产品市场。
TLG170068	2017/4/26	2018/4/26	365	3988+2800+939	3988. HK 3.83 2800. HK 26.25 939. HK 6.05	N/A	0.20%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于港股衍生产品市场。
TLG170077	2017/5/10	2018/5/10	365	3988+2800+939	3988. HK 3.83 2800. HK 26.25 939. HK 6.05	N/A	0.20%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于港股衍生产品市场。
TLG160524	2017/1/4	2017/7/5	182	3M LIBOR	1.30%	N/A	0.00%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于利率衍生产品市场。
TLG170001	2017/1/9	2017/7/10	182	3M LIBOR	1.30%	N/A	0.00%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于利率衍生产品市场。
TLG170005	2017/1/16	2017/7/17	182	3M LIBOR	1.30%	N/A	0.00%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于利率衍生产品市场。
TLG170009	2017/1/23	2017/7/24	182	3M LIBOR	1.30%	N/A	0.00%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于利率

										率衍生产品市场。
TLG170014	2017/2/13	2017/8/14	182	3M LIBOR	1.30%	N/A	0.00%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于利率衍生产品市场。
TLG170019	2017/2/20	2017/8/21	182	3M LIBOR	1.30%	N/A	0.00%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于利率衍生产品市场。
TLG170024	2017/2/27	2017/8/28	182	3M LIBOR	1.30%	N/A	0.00%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于利率衍生产品市场。
TLG170029	2017/3/6	2017/9/5	183	3M LIBOR	1.30%	N/A	0.00%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于利率衍生产品市场。
TLG170032	2017/3/8	2017/7/7	121	3M LIBOR	1.30%	N/A	0.00%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于利率衍生产品市场。
TLG170036	2017/3/13	2017/9/11	182	3M LIBOR	1.30%	N/A	0.00%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于利率衍生产品市场。
TLG170038	2017/3/15	2017/7/14	121	3M LIBOR	1.30%	N/A	0.00%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于利率衍生产品市场。
TLG170041	2017/3/20	2017/9/18	182	3M LIBOR	1.30%	N/A	0.00%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做

										保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于利率衍生产品市场。
TLG170043	2017/3/22	2017/7/21	121	3M LIBOR	1.30%	N/A	0.00%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于利率衍生产品市场。
TLG160456	2016/10/27	2017/10/27	365	3M LIBOR	1.30%	N/A	0.00%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于利率衍生产品市场。
TLG160489	2016/11/24	2017/11/24	365	3M LIBOR	1.30%	N/A	0.00%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于利率衍生产品市场。
XLG170002	2017/2/21	2017/8/22	182	3M LIBOR	1.30%	N/A	0.10%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于利率衍生产品市场。
XLG170004	2017/2/28	2018/2/28	365	3M LIBOR	1.30%	N/A	0.15%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于利率衍生产品市场。
XLG170007	2017/3/21	2017/9/19	182	3M LIBOR	1.30%	N/A	0.10%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于利率衍生产品市场。
TLG170007	2017/1/19	2018/1/19	365	AXEHREE	127.96	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产

										生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG170034	2017/3/9	2018/3/9	365	OMEAEHA	1.33	N/A	0.40%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160331	2016/7/5	2017/7/5	365	AXEHREE	127.96	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160321	2016/7/6	2017/7/7	366	40%BSADA2E+60%MLCORA2	BSADA2E 120.17 MLCORA2 16.33	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160335	2016/7/12	2017/7/12	365	40%BSADA2E+60%MLCORA2	BSADA2E 120.17 MLCORA2 16.33	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160352	2016/7/21	2017/7/21	365	AXEHREE	127.96	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160362	2016/7/28	2017/7/28	365	INVECBE	17.26	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160373	2016/8/2	2017/8/2	365	AXEHREE	127.96	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海

										外基金衍生产品市场。
TLG160416	2016/8/9	2017/8/9	365	AXEHREE	127.96	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160387	2016/8/16	2017/8/16	365	AXEHREE	127.96	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160394	2016/8/23	2017/8/23	365	AXEHREE	127.96	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160403	2016/8/30	2017/8/30	365	AXEHREE	127.96	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160410	2016/9/6	2017/9/6	365	AXEHREE	127.96	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160422	2016/9/13	2017/9/13	365	CSBACRE	122.76	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160434	2016/9/27	2017/9/27	365	CSBACRE	122.76	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供100%本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160469	2016/11/9	2017/11/9	365	ALS15IT LX	1037.85	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做

										保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160479	2016/11/17	2017/11/17	365	AXEHREE	127.96	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160488	2016/11/25	2017/11/27	367	AXEHREE	127.96	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160494	2016/12/1	2017/12/1	365	AXEHREE	127.96	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160503	2016/12/8	2017/12/8	365	FRTGRBI LX	12.47	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160509	2016/12/15	2017/12/15	365	MLCORA2	16.33	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160517	2016/12/22	2017/12/22	365	AXEHREE	127.96	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG160521	2016/12/29	2017/12/29	365	OMEAEHA	1.33	N/A	0.30%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产

										生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于海外基金衍生产品市场。
TLG170051	2017/4/5	2017/7/6	92	GOLDLNP	1242.25	N/A	0.20%	0.01%	N/A	产品所募集的本金部分做保本投资，我行提供 100% 本金安全；本金投资所产生的预期收益部分由我行通过掉期交易，投资于黄金衍生产品市场。