

建信理财“安鑫”（最低持有 180 天）按日开放固定收益类净值型人民币理财产品 2022 年四季度暨年度投资管理报告

报告日：2022 年 12 月 31 日

建信理财“安鑫”（最低持有 180 天）按日开放固定收益类净值型人民币理财产品于 2018 年 11 月 08 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 29,424,879,317.12 元。

一、报告期投资者实际收益率

截至 2022 年 12 月 31 日，产品单位净值为 1.132382。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
报告日 (报告期末最后一个市场 交易日)	1.132382	1.132382	29,424,879,317.12
一个月前	1.137326	1.137326	34,648,383,129.10
二个月前	1.147816	1.147816	36,945,580,852.77
三个月前	1.144550	1.144550	33,829,498,359.79
六个月前	1.136603	1.136603	28,851,319,643.97
一年前	1.123608	1.123608	37,856,630,361.59

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
建信理财“安鑫”（最低持有 180 天）按日开放固定收益类净值型人民币理财产品	2018-11-02	2018-11-07	2018-11-08	-

理财产品管理人：建信理财有限责任公司

理财产品托管人：中国建设银行股份有限公司广东省分行

三、期末资产持仓穿透后穿透前

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	341,285.62	11.58%	566,816.44	18.34%
同业存单	0.00	0.00%	5.86	0.00%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	0.00	0.00%
债券	0.00	0.00%	2,459,445.76	79.59%
理财直接融资工具	0.00	0.00%	0.00	0.00%
新增可投资资产	0.00	0.00%	0.00	0.00%
非标准化债权类资产	0.00	0.00%	0.00	0.00%
权益类投资	0.00	0.00%	0.00	0.00%
金融衍生品	0.00	0.00%	0.00	0.00%
代客境外理财投资 QDII	0.00	0.00%	0.00	0.00%
商品类资产	0.00	0.00%	0.00	0.00%
另类资产	0.00	0.00%	0.00	0.00%
公募基金	0.00	0.00%	63,906.63	2.07%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	2,606,676.47	88.42%	0.00	0.00%
委托投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	2,947,962.09	100.00%	3,090,174.69	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.19%

注：杠杆比例=期末穿透前资产合计/期末资产净值。

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	22 农行二级资本债 02A	930,526,301.37	2.96%

2	21 农发 02	621,521,260.27	1.98%
3	22 宁波银行二级资本债 01	457,299,159.17	1.45%
4	22 农业银行永续债 01	404,091,178.08	1.29%
5	22 中行二级资本债 02A	390,177,424.66	1.24%
6	19 进出 05	311,674,684.93	0.99%
7	18 宜昌绿色债 NPB	307,094,383.56	0.98%
8	21 鲁能 01	300,464,958.90	0.96%
9	21 中国信达债 01	299,890,684.93	0.95%
10	21 甘公投 MTN003	295,724,958.90	0.94%

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

本理财产品主要投资于银行存款、国债、政策性金融债、银行存单及信用债等资产，产品的流动性相对较好，流动性风险可控。

（二）产品的投资风险情况

本产品募集资金主要投资于银行存款、国债、政策性金融债、银行存单及信用债等资产，截止报告日产品债券持仓风险分类正常，风险可控。

六、托管人报告

在报告期间内，本托管人严格按照国家法律法规、托管协议和其他有关规定，对产品财产估值的计算等方面进行了认真复核。

本托管人根据理财产品管理机构的委托，复核了投资管理报告中的份额净值、累计净值、资产净值、产品投资组合详细情况等内容。

在报告期内，本托管人及时准确地执行投资清算指令，办理托管资产名下的资金往来。并对照托管协议及理财产品说明书完成了对相应产品的会计核算及投资监督，未发现存在损害委托人利益的行为。

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	4405018632010002329-0003	中国建设银行股份有限公司广东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广东省分行

八、报告期内关联交易情况

(一) 理财产品投资与本公司或托管机构有重大利害关系的机构发行或承销的证券

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	22 中国银行永续债 01	商业性金融债券	2228023. IB	744, 568	100. 0428	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
2	21 工商银行永续债 01	商业性金融债券	2128021. IB	150	101. 7874	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
3	21 泉州台商 MTN001	企业债务融资工具	102100690. IB	500, 090	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
4	20 新都香城 MTN001	企业债务融资工具	102001424. IB	60	101. 0907	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
5	20 声赫鞍钢 ABN001 优先	资产支持证券	082000940. IB	300	100. 0000	建信信托有限责任公司, 中国建设银行股份有限公司	计划管理人, 主承销商或联席承销商
6	21 北部湾 MTN002	企业债务融资工具	102100618. IB	1, 000, 150	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
7	21 晋能煤业 MTN001	企业债务融资工具	102101951. IB	120	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

8	21 威经开 MTN001	企业债务融资工具	102100556. IB	150	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
9	21 莆田国资 PPN001	企业债务融资工具	032100070. IB	400,060	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
10	21 闽建工 MTN002	企业债务融资工具	102100930. IB	30	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
11	19 平安银行永续债 01	商业性金融债券	1928038. IB	300	101.6823	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
12	20 飞驰建瓯 ABN001 优先	资产支持证券	082000628. IB	240	100.0000	建信信托有限责任公司, 中国建设银行股份有限公司	计划管理人, 主承销商或联席承销商
13	20 上润金泰 ABN001 优先	资产支持证券	082000845. IB	3	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
14	21 株洲高科 MTN002	企业债务融资工具	102101233. IB	1,400,210	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
15	21 淮安国投 MTN002	企业债务融资工具	102101239. IB	600,270	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
16	21 甬工投 MTN002	企业债务融资工具	102101779. IB	383,600	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
17	20 威经开 MTN001	企业债务融资工具	102000852. IB	125,400	99.2931	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
18	22 淮北建投 MTN003	企业债务融资工具	102281419. IB	41,800	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
19	22 津城建 CP004	企业债务融资工具	042280222. IB	125,400	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
20	21 飞驰淮安 ABN001 优先 A1	资产支持证券	082100172. IB	209,000	100.0000	建信信托有限责任公司, 中国建设银行股份有限公司	计划管理人, 主承销商或联席承销商
21	22 云投 MTN001	企业债务融资工具	102281793. IB	41,800	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

22	18 威经开 MTN001	企业债务 融资工具	101800643. IB	125, 400	102. 6798	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
23	21 太仓科 教 PPN001	企业债务 融资工具	032100370. IB	241, 800	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
24	21 甘国投 MTN002	企业债务 融资工具	102101785. IB	1, 276, 201	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
25	21 光穗华 能 ABN001 优先	资产支持 证券	082100470. IB	334, 401	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
26	21 前海北 投 ABN001 优先	资产支持 证券	082100552. IB	330, 221	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
27	21 南京新 港 PPN002	企业债务 融资工具	032100481. IB	209, 000	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
28	20 新海连 PPN003	企业债务 融资工具	032000898. IB	104, 500	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
29	22 农业银 行永续债 01	商业性金 融债券	2228011. IB	4, 000, 000	99. 9946	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
30	21 成都产 投 MTN001	企业债务 融资工具	102100745. IB	900, 000	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
31	17 国开 10	政策性金 融债券	170210. IB	800, 000	106. 4680	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
32	21 厦门火 炬 MTN001	企业债务 融资工具	102101207. IB	400, 000	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
33	21 常熟交 通 PPN003	企业债务 融资工具	032100420. IB	280, 000	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
34	22 中行二 级资本债 02A	商业性金 融债券	092280108. IB	4, 000, 000	100. 0792	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
35	21 湘投 MTN001	企业债务 融资工具	102101348. IB	900, 000	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
36	20 青岛海 科 MTN001	企业债务 融资工具	102002211. IB	750, 000	102. 5319	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
37	21TCL 集 MTN001 (高 成长债)	企业债务 融资工具	102100966. IB	400, 000	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商

38	21 国贸地产 MTN001	企业债务融资工具	102100811. IB	500,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
39	21 津地铁 MTN001	企业债务融资工具	102101453. IB	300,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
40	21 莆田国资 PPN002	企业债务融资工具	032100441. IB	1,000,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
41	21 昆承湖 PPN001	企业债务融资工具	032100281. IB	200,000	99.4632	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
42	21 远东租赁 MTN001	企业债务融资工具	102100363. IB	200,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
43	21 厦国贸控 MTN001	企业债务融资工具	102100313. IB	500,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
44	21 株洲高科 MTN001	企业债务融资工具	102100282. IB	700,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
45	21 新建元 MTN001	企业债务融资工具	102101303. IB	200,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
46	21 山东海洋 MTN001	企业债务融资工具	102100158. IB	800,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
47	21 厦门特房 MTN001	企业债务融资工具	102100851. IB	300,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
48	22 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2228029. IB	2,042,269	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
49	22 工商银行二级 03	商业性金融债券	2228024. IB	1,900,000	100.5815	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
50	20 西安高新 MTN001	企业债务融资工具	102000486. IB	448,159	98.6829	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
51	18 柳州投资 MTN002	企业债务融资工具	101800844. IB	300,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
52	20 华融租赁债 01	商业性金融债券	2022026. IB	1,000,000	94.5332	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
53	21 新都香城 MTN001	企业债务融资工具	102101718. IB	400,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

54	22 新建元 MTN003	企业债务融资工具	102282480. IB	500,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
55	21 威海城投 MTN002	企业债务融资工具	102101545. IB	2,900,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
56	21 中国信达债 01	商业性金融债券	092100008. IB	3,000,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
57	21 成都交子 ABN001 优先	资产支持证券	082180076. IB	360,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
58	22 滨江城建 MTN002	企业债务融资工具	102200258. IB	600,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
59	21 运和城投 MTN001	企业债务融资工具	102101446. IB	300,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
60	21 粤澳 ABN001 优先	资产支持证券	082180078. IB	60,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
61	21 湖南发展 MTN002	企业债务融资工具	102101540. IB	1,000,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
62	18 海尔金控 MTN001	企业债务融资工具	101801448. IB	1,800,000	102.8370	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
63	21 桂交投 MTN001	企业债务融资工具	102100374. IB	1,100,000	101.2106	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
64	22 匈牙利债 01BC	外国债券	092280143. IB	300,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
65	22 联发集 MTN002	企业债务融资工具	102281663. IB	148,895	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
66	22 云南交投 MTN001	企业债务融资工具	102280415. IB	99,263	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
67	20 厦门火炬 MTN001	企业债务融资工具	102000117. IB	148,895	100.8515	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
68	22 洛阳城乡 MTN001	企业债务融资工具	102282164. IB	49,631	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
69	22 乌高新 MTN002	企业债务融资工具	102281994. IB	49,631	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

70	21 达州投资 PPN001(革命老区)	企业债务 融资工具	032191462. IB	248, 159	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
71	22 津城建 MTN008	企业债务 融资工具	102281425. IB	99, 263	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
72	22 娄城高 新 MTN002	企业债务 融资工具	102281833. IB	49, 631	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
73	22 威宁投 资 MTN001	企业债务 融资工具	102280258. IB	99, 263	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
74	22 新都香 城 MTN001	企业债务 融资工具	102280341. IB	99, 263	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
75	22 苏州资 产 MTN002	企业债务 融资工具	102281507. IB	248, 159	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
76	22 苏州文 旅 MTN002	企业债务 融资工具	102280518. IB	99, 263	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
77	22 金合盛 MTN003(科 创票据)	企业债务 融资工具	102281243. IB	148, 895	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
78	22 苏州资 产 MTN001	企业债务 融资工具	102280562. IB	297, 791	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
79	22 国贸房 产 MTN001	企业债务 融资工具	102281839. IB	148, 895	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
80	22 渝医药 MTN001	企业债务 融资工具	102280164. IB	148, 895	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
81	22 渝兴永 MTN001	企业债务 融资工具	102280163. IB	19, 852	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
82	22 北部湾 MTN001	企业债务 融资工具	102280032. IB	148, 895	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
83	21 河钢集 MTN008	企业债务 融资工具	102103281. IB	397, 054	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
84	22 晋能煤 业 PPN006	企业债务 融资工具	032280247. IB	297, 791	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商

85	22 甘金控 MTN001	企业债务 融资工具	102280551. IB	124, 079	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
86	21 建发 MTN002	企业债务 融资工具	102103276. IB	843, 741	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
87	22 杭州湾 新 MTN002	企业债务 融资工具	102281484. IB	99, 263	99. 8587	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
88	22 淮北建 投 MTN004	企业债务 融资工具	102281832. IB	49, 631	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
89	22 农行永 续债 02	商业性金 融债券	092280086. IB	496, 318	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
90	22 泉州台 商 MTN002	企业债务 融资工具	102280528. IB	198, 527	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
91	18 宿迁城 投 MTN002	企业债务 融资工具	101801311. IB	16, 998	101. 7263	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
92	18 泉州台 商 MTN002	企业债务 融资工具	101800116. IB	59, 493	100. 7528	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
93	20 瘦西湖 MTN001	企业债务 融资工具	102001399. IB	84, 990	100. 5140	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
94	22 宁波经 开 CP002	企业债务 融资工具	042280471. IB	25, 497	99. 2403	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
95	20 汾湖投 资 MTN001	企业债务 融资工具	102002118. IB	16, 998	100. 7172	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
96	21 宿迁水 务 MTN001	企业债务 融资工具	102100441. IB	25, 497	101. 7829	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
97	18 谷财 MTN002	企业债务 融资工具	101800993. IB	50, 994	100. 5999	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
98	19 娄城高 新 MTN001	企业债务 融资工具	101900041. IB	25, 497	102. 5639	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
99	18 谷财 MTN001	企业债务 融资工具	101800851. IB	8, 499	100. 7677	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
100	22 宿迁水 务 MTN001	企业债务 融资工具	102281053. IB	33, 996	99. 5554	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商

101	20 常德城投 MTN003	企业债务融资工具	102002333. IB	16,998	101.3928	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
102	19 娄底高新 MTN002	企业债务融资工具	101900108. IB	8,499	102.8424	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
103	18 娄底高新 MTN001	企业债务融资工具	101800328. IB	59,493	101.1717	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
104	22 吴江交投 PPN001	企业债务融资工具	032281094. IB	16,998	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
105	22 成都高新 MTN002	企业债务融资工具	102282555. IB	3,925	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

（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

无，本产品未投资非标准化债权及股权类资产。

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。

十一、其他

本报告披露的产品净值及份额净值经过安永华明会计师事务所
(特殊普通合伙) 审计确认。

特此公告

建信理财有限责任公司

2022 年 12 月 31 日