

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 2023 年一季度投资管理报告

报告日：2023 年 03 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 23,452,038,500.76 元。

一、报告期投资者实际收益率

截至 2023 年 03 月 31 日，产品单位净值为 1.144593。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)	1.144593	1.144593	23,452,038,500.76
一个月前	1.139812	1.139812	25,655,455,694.20
二个月前	1.135567	1.135567	26,888,648,439.57
三个月前	1.132382	1.132382	29,424,879,317.12
六个月前	1.144550	1.144550	33,829,498,359.79
一年前	1.126457	1.126457	29,918,678,123.39

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	262,346.53	11.17%	468,690.16	20.07%
同业存单	0.00	0.00%	19.69	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%	1,786,504.36	76.52%
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%	79,599.78	3.41%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	2,086,064.21	88.83%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	2,348,410.74	100.00%	2,334,814.00	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.14%

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	657,341,917.81	2.77%
2	21 农发 02	605,596,557.38	2.55%

3	22 中行二级资本债 02A	396,876,054.79	1.67%
4	18 宜昌绿色债 NPB	310,870,684.93	1.31%
5	19 中国银行永续债 01	306,103,150.68	1.29%
6	21 中国信达债 01	305,875,479.45	1.29%
7	21 甘公投 MTN003	304,347,698.63	1.28%
8	21 威海城投 MTN002	296,521,345.21	1.25%
9	定期存款	280,244,992.90	1.18%
10	定期存款	276,113,969.12	1.16%

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	100	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 农业银行永续债01	商业性金融债券	2128038. IB	100	99.0120	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
3	19 平安银行永续债01	商业性金融债券	1928038. IB	336	101.6823	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
4	21 泉州台商MTN001	企业债务融资工具	102100690. IB	200,100	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
5	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
6	20 新都香城 MTN001	企业债务融资工具	102001424. IB	67	101.0907	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
7	21 闽建工 MTN002	企业债务融资工具	102100930. IB	33	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	20 声赫鞍钢 ABN001 优先	资产支持证券	082000940. IB	336	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

9	21 株洲高科 MTN002	企业债务融资工具	102101233. IB	1,400,235	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 莆田国资 PPN001	企业债务融资工具	032100070. IB	400,067	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	21 威经开 MTN001	企业债务融资工具	102100556. IB	168	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
12	21 淮安国投 MTN002	企业债务融资工具	102101239. IB	600,302	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
13	22 津城建 CP004	企业债务融资工具	042280222. IB	141,871	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 飞驰惟安 ABN001 优先 A1	资产支持证券	082100172. IB	236,451	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
15	18 威经开 MTN001	企业债务融资工具	101800643. IB	141,871	102.6798	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
16	21 甘国投 MTN002	企业债务融资工具	102101785. IB	1,325,613	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	21 光穗华能 ABN001 优先	资产支持证券	082100470. IB	378,323	100.0000	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	47,290	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	20 威经开 MTN001	企业债务融资工具	102000852. IB	141,871	99.2931	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
20	20 新海连 PPN003	企业债务融资工具	032000898. IB	118,225	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
21	21 南京新港 PPN002	企业债务融资工具	032100481. IB	236,451	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	21 前海北投 ABN001 优先	资产支持证券	082100552. IB	373,594	100.0000	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	247,290	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	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
25	21 甬工投 MTN002	企业债务融资工具	102101779. IB	300,000	98.6992	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
26	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
27	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
28	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
29	22 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2228011. IB	2,500,000	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 莆田国资 PPN002	企业债务融资工具	032100441. 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
31	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
32	21 成都产投 MTN001	企业债务融资工具	102100745. 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
33	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
34	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
35	23 苏州文旅 MTN002	企业债务融资工具	102380282. IB	100,000	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	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
37	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
38	22 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2228029. 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
39	22 工商银行二级 03	商业性金融债券	2228024. IB	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

40	20 西安高新 MTN001	企业债务融资工具	102000486. IB	478,611	98.6829	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
41	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
42	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
43	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
44	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
45	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
46	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
47	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
48	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
49	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
50	22 乌高新 MTN002	企业债务融资工具	102281994. IB	55,722	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
51	22 淮北建投 MTN004	企业债务融资工具	102281832. IB	55,722	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	21 达州投资 PPN001 (革命老区)	企业债务融资工具	032191462. IB	278,611	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
53	22 津城建 MTN008	企业债务融资工具	102281425. IB	111,444	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 苏州文旅 MTN002	企业债务融资工具	102280518. IB	111,444	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	22 金合盛 MTN003 (科创票据)	企业债务融资工具	102281243. IB	167, 167	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	22 泉州台商 MTN002	企业债务融资工具	102280528. IB	222, 889	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	22 渝兴永 MTN001	企业债务融资工具	102280163. IB	22, 288	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	23 苏城投 SCP001	企业债务融资工具	012380116. IB	55, 722	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	23 苏新国资 MTN001	企业债务融资工具	102380238. IB	222, 889	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	22 渝医药 MTN001	企业债务融资工具	102280164. IB	167, 167	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	22 晋能煤业 PPN006	企业债务融资工具	032280247. IB	334, 334	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	22 威宁投资 MTN001	企业债务融资工具	102280258. IB	111, 444	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
63	21 建发 MTN002	企业债务融资工具	102103276. IB	947, 280	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
64	22 新都香城 MTN001	企业债务融资工具	102280341. IB	111, 444	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 云南交投 MTN001	企业债务融资工具	102280415. IB	111, 444	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	23 连云城建 PPN001	企业债务融资工具	032380031. IB	167, 167	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	22 洛阳城乡 MTN001	企业债务融资工具	102282164. IB	55, 722	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
68	19 工商银行永续债	商业性金融债券	1928018. IB	1, 030, 248	101. 8607	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
69	18 谷财 MTN001	企业债务融资工具	101800851. IB	21, 920	100. 7677	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
70	18 娄城高新 MTN001	企业债务融资工具	101800328. IB	153, 441	101. 1717	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

71	20 汾湖投 资 MTN001	企业债务 融资工具	102002118. IB	43,840	100.7172	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
72	20 常德城 投 MTN003	企业债务 融资工具	102002333. IB	43,840	101.3928	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
73	19 娄城高 新 MTN001	企业债务 融资工具	101900041. IB	65,760	102.5639	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
74	22 宁波经 开 CP002	企业债务 融资工具	042280471. IB	65,760	99.2403	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
75	22 吴江交 投 PPN001	企业债务 融资工具	032281094. IB	43,840	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	20 瘦西湖 MTN001	企业债务 融资工具	102001399. IB	219,201	100.5140	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
77	19 娄城高 新 MTN002	企业债务 融资工具	101900108. IB	21,920	102.8424	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
78	18 谷财 MTN002	企业债务 融资工具	101800993. IB	131,521	100.5999	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
79	18 宿迁城 投 MTN002	企业债务 融资工具	101801311. IB	43,840	101.7263	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
80	22 成都高 新 MTN002	企业债务 融资工具	102282555. IB	12,564	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。

特此公告

建信理财有限责任公司

2023年03月31日