

建信理财“嘉鑫”（7天）定期开放固收类净值型人民币理财产品第1期 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“嘉鑫”（7天）定期开放固收类净值型人民币理财产品第1期于2020年02月06日正式成立。截至报告日，本产品规模为6,694,577,625.61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1.087554。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)	1.087554	1.087554	6,694,577,625.61
一个月前	1.087328	1.087328	9,120,029,858.95
二个月前	1.090131	1.090131	11,110,104,770.41
三个月前	1.087467	1.087467	11,510,937,555.31
六个月前	1.079732	1.079732	12,319,782,801.35
一年前	1.064618	1.064618	5,326,224,009.22

超额业绩报酬暂估测算：报告日预测超额业绩报酬暂估计提金额256,617.94元，计提后单位净值1.087512。

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“嘉鑫”（7天）定期开放固收类净值型人民币理财产品第1期	2020-01-16	2020-02-05	2020-02-06	-

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深圳市分行

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	80,131.08	11.96%	211,178.77	27.45%
同业存单	0.00	0.00%	29,291.00	3.81%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	14,357.22	1.87%
债券	0.00	0.00%	508,335.77	66.08%
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%	6,068.32	0.79%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	590,020.75	88.04%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	670,151.83	100.00%	769,231.07	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.11%

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	20 上润金泰 ABN001 优先	406,883,835.62	5.23%
2	20 中核华瑞 ABN001 优先	284,984,383.56	3.66%

3	22 证金 D55	249,590,878.13	3.21%
4	22 证金 D97	248,575,740.12	3.19%
5	19 即墨 01	172,510,643.84	2.22%
6	R007	143,572,185.51	1.84%
7	20 飞驰创信 ABN001 优先	136,637,933.03	1.75%
8	22 证金 D53	124,753,269.44	1.60%
9	22 证金 D52	124,701,099.10	1.60%
10	18 天津银行二级	108,175,062.42	1.39%

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、高流动性信用债、政策性金融债及银行存单等高流动性资产，故产品的流动性较好、风险较低。

（二）产品的投资风险情况

截至 2022 年 12 月末，产品固定收益部分投资严格遵守合同规定的投资范围和比例限制，债券整体风险可控、价格波动可控。总体来看，债券组合整体票息较高，估值较为稳定，持仓债券风险可控，组合债券仓位总体净值平稳。

六、托管人报告

在本报告期间，托管人对管理人的投资运作行为进行了监督，未发现存在损害本产品利益的行为。

在本报告期间，托管人以诚实信用、勤勉尽责的原则认真办理理财资金托管事项，履行托管人职责。

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	4425010000020003361-0002	建信理财有限责任公司理财产品托管专户	中国建设银行股份有限公司深圳市分行

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	20 飞驰创信 ABN001 优先	资产支持证券	082000253. IB	1,400,000	95.6793	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
2	21 晋能煤业 MTN002	企业债务融资工具	102102030. IB	200,000	100.1446	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
3	21 晋能煤业 MTN001	企业债务融资工具	102101951. IB	300,000	100.2195	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
4	20 上润金泰 ABN001 优先	资产支持证券	082000845. IB	4,000,000	101.5653	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
5	20 中电西藏 ABN001 优先	资产支持证券	082000312. IB	45,019	99.2625	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
6	20 海门城发 ABN001 优先 A5	资产支持证券	082000582. IB	188,839	100.8552	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
7	20 飞驰建瓴 ABN001 优先	资产支持证券	082000628. IB	66,272	101.9715	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
8	21 五冶集 ABN001 优先	资产支持证券	082101493. IB	182,512	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 成都交子 ABN001 优先	资产支持证券	082180076. IB	219,015	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	22 粤澳 ABN001 优 先	资产支持 证券	082280418. IB	109, 507	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	22 珠海华 发 ABN001 优先	资产支持 证券	082282014. IB	36, 917	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	17 淄博资 运 MTN002	企业债务 融资工具	101754118. IB	304, 188	105. 6634	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
13	19 大连港 MTN001	企业债务 融资工具	101900528. IB	203, 197	103. 7742	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
14	20 柳钢集 团 MTN001	企业债务 融资工具	102000315. IB	24, 335	101. 7766	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
15	20 云能投 MTN003	企业债务 融资工具	102000696. IB	121, 675	98. 0495	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
16	20 中建五 局 MTN001	企业债务 融资工具	102000785. IB	365, 025	99. 6741	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
17	20 中交一 公 MTN001	企业债务 融资工具	102000786. IB	182, 512	100. 0190	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
18	20 中金集 MTN002	企业债务 融资工具	102000857. IB	365, 025	100. 1141	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
19	20 辽交投 MTN001	企业债务 融资工具	102000898. IB	206, 847	100. 1163	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
20	20 陕煤化 MTN002	企业债务 融资工具	102001002. IB	60, 837	99. 0516	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
21	20 赣投 MTN002	企业债务 融资工具	102001030. IB	170, 345	100. 3096	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
22	20 鲁黄金 MTN001	企业债务 融资工具	102001102. IB	121, 675	101. 2128	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
23	20 云能投 MTN004	企业债务 融资工具	102001253. IB	121, 675	98. 1940	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
24	20 首钢 MTN004	企业债务 融资工具	102001267. IB	85, 172	101. 4988	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
25	20 大连城 乡 MTN001	企业债务 融资工具	102001368. IB	158, 177	100. 3648	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商

26	20 新都香城 MTN001	企业债务融资工具	102001424. IB	85, 172	103. 5179	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
27	20 川交投 MTN001	企业债务融资工具	102002154. IB	547, 538	101. 8980	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
28	21 佛燃能源 MTN001	企业债务融资工具	102100007. IB	85, 172	101. 4446	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
29	21 渝富 MTN001	企业债务融资工具	102100024. IB	121, 675	101. 1390	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
30	21 河钢集 MTN001	企业债务融资工具	102100195. IB	97, 340	103. 1207	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
31	21 南山开发 MTN001	企业债务融资工具	102100397. IB	12, 167	101. 9313	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
32	21 昆明轨道 MTN004(绿色)	企业债务融资工具	102103149. IB	139, 926	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 江门高新 MTN001	企业债务融资工具	102103204. IB	60, 837	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 东方电气 MTN003(碳中和债)	企业债务融资工具	102103318. IB	12, 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
35	22 华能集 MTN001	企业债务融资工具	102280399. IB	170, 345	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	22 城投公路 MTN001	企业债务融资工具	102280459. IB	12, 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
37	22 苏州文旅 MTN002	企业债务融资工具	102280518. IB	12, 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
38	22 平安租赁 MTN003	企业债务融资工具	102280782. IB	304, 464	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 汇理汽车债 01	商业性金融债券	2122001. IB	691	100. 5807	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
40	22 中国银行永续债 01	商业性金融债券	2228023. IB	138	98. 2304	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

41	19 兴业银行二级 01	商业性金融债券	1928022. IB	829	101.1223	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
42	19 平安银行二级	商业性金融债券	1928010. IB	2,764	101.5437	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
43	21 宝龙 MTN001	企业债务融资工具	102101036. IB	829	35.5663	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
44	21 福新能源 GN002(可持续挂钩)	企业债务融资工具	132100051. IB	276	101.6162	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
45	22 广西旅发 MTN002(绿色乡村振兴)	企业债务融资工具	102282467. IB	55	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 陆金开 MTN001	企业债务融资工具	102100303. IB	1,382	100.6675	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
47	22 晋能煤业 MTN013(科创票据)	企业债务融资工具	102281337. IB	1,797	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	20 青岛城投 MTN004	企业债务融资工具	102002241. IB	3,041	101.8745	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
49	21 成都益民 MTN001(乡村振兴)	企业债务融资工具	102100514. IB	552	102.1171	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
50	20 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2028048. IB	552	101.5397	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
51	19 工商银行永续债	商业性金融债券	1928018. IB	365,249	101.4013	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
52	21 湖南发展 MTN001	企业债务融资工具	102100519. IB	74,774	102.1198	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 CP004	企业债务融资工具	042280222. IB	1,105	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	21 锡产业 MTN001	企业债务融资工具	102100491. IB	829	101.9910	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

55	21 夏商 MTN001	企业债务融资工具	102100193. IB	552	102. 1965	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
56	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	293, 458	99. 0958	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
57	19 平安银行永续债 01	商业性金融债券	1928038. IB	16, 779	100. 3280	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
58	21 苏新国资 MTN002	企业债务融资工具	102100114. IB	276	101. 9552	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
59	22 海沧投资 SCP002	企业债务融资工具	012282056. IB	1, 797	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 交子金融 GN001	企业债务融资工具	132100007. IB	552	102. 1348	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
61	22 建安投资 CP003	企业债务融资工具	042280259. IB	1, 244	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 泰达投资 SCP004	企业债务融资工具	012281977. IB	76, 295	98. 0367	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
63	21 淮南矿 MTN001	企业债务融资工具	102100093. IB	276	100. 9336	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
64	21 飞驰惟安 ABN001 优先 A1	资产支持证券	082100172. IB	552	101. 3921	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
65	21 浙资运营 MTN001	企业债务融资工具	102100529. IB	691	101. 9697	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
66	22 江苏水源 SCP001	企业债务融资工具	012283652. IB	14, 785	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	建信荣瑞一年定开	债券基金	007830. OF	51, 750, 841	1. 0000	建信基金管理有限责任公司	基金管理人
68	19 建元 12A2_bc	资产支持证券	1989574. IB	98, 962	45. 2842	建信信托有限责任公司	计划管理人
69	20 建元 1A3_bc	资产支持证券	2089065. IB	49, 481	69. 3974	建信信托有限责任公司	计划管理人
70	19 中盈万家 4A2	资产支持证券	1989396. IB	178, 131	33. 3284	建信信托有限责任公司, 中国建	计划管理人, 主承销

						设银行股份有限公司	商或联席承销商
71	19 中盈万家 3A2	资产支持证券	1989328. IB	242, 457	17. 0351	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
72	19 中盈万家 1A2	资产支持证券	1989018. IB	123, 702	3. 9200	建信信托有限责任公司	计划管理人
73	21 工商银行永续债 02	商业性金融债券	2128044. IB	4, 948	101. 5189	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
74	18 中盈万家 2A2	资产支持证券	1889408. IB	158, 339	4. 7789	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
75	20 江铃汽车 MTN001	企业债务融资工具	102001917. IB	123, 702	100. 9123	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
76	20 长沙经开 MTN001	企业债务融资工具	102001746. IB	19, 792	101. 5579	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
77	19 农盈 4A2	资产支持证券	1989340. IB	371, 107	27. 4469	建信信托有限责任公司	计划管理人
78	21 成都产投 MTN001	企业债务融资工具	102100745. IB	14, 844	102. 0213	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
79	21 广西机场 MTN001	企业债务融资工具	102100530. IB	24, 740	101. 9564	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
80	21 大悦城 MTN001	企业债务融资工具	102100647. IB	49, 481	101. 2522	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
81	18 太仓资产 MTN002	企业债务融资工具	101801025. IB	29, 688	103. 5604	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
82	21 中方财团 MTN001 (权益出资)	企业债务融资工具	102100797. IB	24, 740	101. 9175	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
83	22 融信产融 ABN001 优先 B	资产支持证券	082280913. IB	54, 429	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	19 中盈万家 5A2	资产支持证券	1989508. IB	426, 526	37. 4215	建信信托有限责任公司	计划管理人

85	20 漳州开发 MTN002	企业债务融资工具	102001701. IB	74, 221	101. 5514	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
86	21 贵州高速 MTN001	企业债务融资工具	102100743. IB	44, 532	101. 8349	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
87	20 建发地产 MTN001	企业债务融资工具	102001046. IB	54, 429	101. 3337	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
88	20 绿原国资 MTN001	企业债务融资工具	102000960. IB	29, 688	100. 5245	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
89	22 榆林能源 CP002	企业债务融资工具	042280433. IB	14, 844	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	20 农业银行永续债 02	商业性金融债券	2028032. IB	24, 740	104. 4949	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
91	19 农盈 2A2	资产支持证券	1989123. IB	395, 848	17. 7380	建信信托有限责任公司	计划管理人
92	19 珠海港 MTN003	企业债务融资工具	101901427. IB	74, 221	103. 4524	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
93	19 珠海港 MTN002	企业债务融资工具	101900992. IB	74, 221	103. 1271	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
94	22 欣荣 1 优先	资产支持证券	2289125. IB	258, 785	67. 2000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
95	20 苏新国资 MTN001	企业债务融资工具	102001499. IB	19, 792	100. 6152	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
96	18 宿迁城投 MTN002	企业债务融资工具	101801311. IB	34, 636	101. 8739	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
97	21 江铜 GN001 (碳中和债)	企业债务融资工具	132100038. IB	13, 359	101. 8271	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
98	19 建元 11A2_bc	资产支持证券	1989546. IB	98, 962	50. 7306	建信信托有限责任公司	计划管理人
99	19 沪城投 MTN001	企业债务融资工具	101900542. IB	148, 443	103. 2737	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
100	20 苏州资产 (疫情防控债) PPN001	企业债务融资工具	032000235. IB	30, 925	100. 9810	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

101	20 河南交规 MTN001	企业债务融资工具	102001464. IB	4,948	101.5555	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（见附录一）

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。

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

附录一

建信理财“嘉鑫”（7 天）定期开放固收类净值型人民币理财产品第 1 期投资
非标准化债权及股权类资产清单

报告日：2022 年 12 月 31 日

我司依照监管要求，现对建信理财“嘉鑫”（7 天）定期开放固收类净值型人民币理财产品第 1 期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
------	--------	------	-----------	------

除上述资产外，产品投资其他资产的风险状况：正常

到期收益分配详见产品说明书。