

建信理财“安鑫”（七天）固定收益类开放式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”（七天）固定收益类开放式净值型人民币理财产品于 2018 年 07 月 04 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 9,265,774,505.28 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 1.154474。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)	1.154474	1.154474	9,265,774,505.28
一个月前	1.152345	1.152345	10,334,049,865.21
二个月前	1.149829	1.149829	11,147,702,385.88
三个月前	1.144716	1.144716	12,369,042,202.52
六个月前	1.147115	1.147115	21,017,274,018.62
一年前	1.132497	1.132497	27,258,142,539.70

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 0 元，计提后单位净值 1.154474。

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”（七天）固定收益类开放式净值型人民币理财产品	2018-06-26	2018-07-03	2018-07-04	-

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	72,036.57	7.77%	240,443.88	23.09%
同业存单	0.00	0.00%	25,427.60	2.44%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	157,306.02	15.11%
债券	40,781.01	4.40%	617,955.60	59.36%
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%	-22.50	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%	0.00	0.00%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	814,132.15	87.83%	0.00	0.00%
委托投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	926,949.73	100.00%	1,041,110.60	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.05%

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	R007	1,552,398,171.98	14.75%
2	23 国开 01	450,836,557.38	4.28%

3	23 农发 01	250,619,726.03	2.38%
4	22 证金 D97	232,680,180.92	2.21%
5	21 吉利 01	208,252,638.36	1.98%
6	22 浦发银行 CD154	207,489,948.82	1.97%
7	21 国开 07	206,054,246.58	1.96%
8	20 声赫鞍钢 ABN001 优先	204,578,698.36	1.94%
9	19 国开 03	202,586,849.32	1.93%
10	21 兴光黄金 ABN001 优先	202,143,876.21	1.92%

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

报告期内，产品管理人通过合理安排资产配置结构，预留充足现金头寸，保持一定比例的高流动性资产，控制资产久期，管控产品流动性风险，对于关键时点的规模变动和资金面波动都有充足准备，且融资渠道畅通多元，产品流动性平稳运行。

（二）产品的投资风险情况

截至 2023 年 3 月末，本理财产品主要投资于固定收益类资产。产品固定收益部分主要投资于高等级债券，债券整体风险可控、价格波动可控，组合债券仓位总体净值平稳。

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	4405018632010002075-0002	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	21 中广核租 GN001 (碳中和债)	企业债务融资工具	132100053. 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
2	21 青岛海科 MTN001	企业债务融资工具	102100226. 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
3	20 声赫鞍钢 ABN001 优先	资产支持证券	082000940. IB	1,997,000	99.2462	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
4	22 华电山能 ABN001 优先	资产支持证券	082280296. IB	20,662	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	22 飞驰财信 ABN001 优先	资产支持证券	082280456. IB	20,662	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	21 粤澳 ABN001 优先	资产支持证券	082180078. IB	151,521	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 光穗铜冠 ABN001 优先	资产支持证券	082101007. IB	261,718	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 昆明轨道	企业债务融资工具	102103149. IB	39,078	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

	MTN004 (绿色)					公司	
9	22 融信元泰 ABN001 优先 A	资产支持证券	082280019. IB	309,622	30.7900	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
10	20 飞驰光信 ABN001 优先	资产支持证券	082001078. IB	265,390	102.1092	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
11	23 建安投资 PPN001	企业债务融资工具	032380205. IB	22,616	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	20 海门城发 ABN001 优先 A5	资产支持证券	082000582. IB	164,775	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
13	20 飞驰建瓯 ABN001 优先	资产支持证券	082000628. IB	36,563	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
14	21 成都交子 ABN001 优先	资产支持证券	082180076. IB	203,545	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	22 粤澳 ABN001 优先	资产支持证券	082280418. IB	101,772	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	22 珠海华发 ABN001 优先	资产支持证券	082282014. IB	33,924	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	17 淄博资运 MTN002	企业债务融资工具	101754118. IB	282,702	105.6634	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
18	19 大连港 MTN001	企业债务融资工具	101900528. IB	188,845	103.7742	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
19	20 云能投 MTN003	企业债务融资工具	102000696. IB	113,081	98.0495	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
20	20 中金集 MTN002	企业债务融资工具	102000857. IB	339,243	100.1141	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
21	20 辽交投 MTN001	企业债务融资工具	102000898. IB	192,237	100.1163	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
22	20 赣投 MTN002	企业债务融资工具	102001030. IB	158,313	100.3096	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

23	20 鲁黄金 MTN001	企业债务 融资工具	102001102. IB	113,081	101.2128	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
24	20 云能投 MTN004	企业债务 融资工具	102001253. IB	113,081	98.1940	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
25	20 首钢 MTN004	企业债务 融资工具	102001267. IB	79,156	101.4988	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	79,156	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	282,702	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	79,156	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 南山开 发 MTN001	企业债务 融资工具	102100397. IB	11,308	101.9313	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
30	21 江门高 新 MTN001	企业债务 融资工具	102103204. IB	56,540	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 东方电 气 MTN003 (碳 中和债)	企业债务 融资工具	102103318. IB	11,308	100.0000	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
32	22 苏州文 旅 MTN002	企业债务 融资工具	102280518. IB	11,308	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	22 平安租 赁 MTN003	企业债务 融资工具	102280782. IB	282,702	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	20 江苏沿 海 MTN001	企业债务 融资工具	102001182. IB	3,741	99.7202	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
35	20 秀湖集 团 MTN001	企业债务 融资工具	102000708. IB	6,122	99.8247	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
36	22 盛世融 迪 5 优先 _bc	资产支持 证券	2289352. IB	442,163	75.1600	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
37	22 江铜 MTN005	企业债务 融资工具	102282504. IB	663,245	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 闽建工 MTN002	企业债务 融资工具	102100930. IB	44,216	102.6468	中国建设银行 股份有限	主承销商或 联席承销商

						公司	
39	22 广西旅发 MTN002 (绿色乡村振兴)	企业债务融资工具	102282467. IB	44, 216	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	22 上海能科 ABN001 优先 A	资产支持证券	082280795. IB	88, 432	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	23 中铁科创 ABN001 优先	资产支持证券	082380081. IB	44, 216	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
42	23 淮北建投 MTN001	企业债务融资工具	102380033. IB	44, 216	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	22 山西清能 ABN001 优先	资产支持证券	082280800. IB	221, 081	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 上海能科 ABN001 优先 B	资产支持证券	082280796. IB	110, 540	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	20 中交投资 ABN001 优先	资产支持证券	082001046. IB	48, 297	101. 7679	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
46	21 华靖资产 MTN001	企业债务融资工具	102101368. IB	74, 253	100. 4627	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
47	21 北部湾 MTN002	企业债务融资工具	102100618. IB	74, 253	101. 1008	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
48	21 淮安国投 MTN003	企业债务融资工具	102103248. IB	129, 943	98. 6976	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
49	22 中铁四局 ABN001 优先 (科创票据)	资产支持证券	082280776. IB	37, 126	97. 8627	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
50	21 常德城投 MTN001	企业债务融资工具	102100309. IB	148, 506	100. 3968	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
51	21 越秀小微 ABN003 优先 A2	资产支持证券	082101398. IB	66, 827	18. 7574	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
52	20 建元 1A3_bc	资产支持证券	2089065. IB	10, 231	69. 3974	建信信托有限责任公司	计划管理人

53	19 平安银行永续债 01	商业性金融债券	1928038. IB	3,069	103.1014	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
54	22 欣荣 1 优先	资产支持证券	2289125. IB	53,511	48.5700	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
55	19 珠海港 MTN003	企业债务融资工具	101901427. IB	15,347	103.4524	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
56	21 江铜 GN001(碳中和债)	企业债务融资工具	132100038. IB	716	101.8271	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
57	18 宿迁城投 MTN002	企业债务融资工具	101801311. IB	1,023	101.8739	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
58	21 中方财团 MTN001(权益出资)	企业债务融资工具	102100797. IB	5,115	101.9175	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
59	19 建元 11A2_bc	资产支持证券	1989546. IB	20,463	47.3222	建信信托有限责任公司	计划管理人
60	20 河南交规 MTN001	企业债务融资工具	102001464. IB	1,023	101.5555	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
61	23 六安城投 MTN001	企业债务融资工具	102380254. IB	1,023	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	19 沪城控 MTN001	企业债务融资工具	101900542. IB	30,695	103.2737	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
63	20 漳州开发 MTN002	企业债务融资工具	102001701. IB	15,347	101.5514	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
64	20 苏新国资 MTN001	企业债务融资工具	102001499. IB	4,092	100.6152	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
65	19 珠海港 MTN002	企业债务融资工具	101900992. IB	15,347	103.1271	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
66	22 融信产融 ABN001 优先 B	资产支持证券	082280913. IB	11,254	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	19 建元 12A2_bc	资产支持证券	1989574. IB	20,463	36.7934	建信信托有限责任公司	计划管理人
68	21 成都产投 MTN001	企业债务融资工具	102100745. IB	3,069	102.0213	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

(二) 理财产品投资关联方发行的资产管理产品

日期	资产管理产品名称	投资类型	金额	份额	关联方名称
2023/1/4	建信信托凤鸣尊享日日盈 3 号集合信托计划	赎回	512622000	500000000	建信信托有限责任公司
2023/1/5	建信信托凤鸣尊享日日盈 3 号集合信托计划	申购	200000000	200000000	建信信托有限责任公司
2023/1/11	建信资本惠众配置 3 号集合资产管理计划	赎回	504305835	500000000	建信资本管理有限责任公司
2023/1/11	建信信托凤鸣尊享日日盈 3 号集合信托计划	赎回	307768800	300000000	建信信托有限责任公司
2023/1/12	建信信托凤鸣尊享日日盈 3 号集合信托计划	申购	500000000	500000000	建信信托有限责任公司
2023/1/16	建信资本惠众配置 3 号集合资产管理计划	赎回	302559534	300000000	建信资本管理有限责任公司
2023/2/1	建信信托凤鸣尊享日日盈 3 号集合信托计划	赎回	205513200	200000000	建信信托有限责任公司
2023/2/6	建信资本惠众配置 2 号集合资产管理计划	申购	400000000	400000000	建信资本管理有限责任公司
2023/2/15	建信信托凤鸣尊享日日盈 3 号集合信托计划	赎回	205741000	200000000	建信信托有限责任公司
2023/2/20	建信信托凤鸣尊享日日盈 3 号集合信托计划	赎回	421934280	410000000	建信信托有限责任公司
2023/2/22	建信专享日盈 2 号现金管理特定多个客户资产管理计划	赎回	330815196	300000000	建信基金管理有限责任公司
2023/2/23	建信信托凤鸣尊享日日盈 13 号集合信托计划	申购	150000000	150000000	建信信托有限责任公司
2023/2/23	建信信托凤鸣尊享日日盈 3 号集合信托计划	申购	450000000	450000000	建信信托有限责任公司
2023/2/28	建信信托凤鸣尊享日日盈 7 号集合信托计划	申购	850000000	850000000	建信信托有限责任公司
2023/2/28	建信信托凤鸣尊享日日盈 3 号集合信托计划	赎回	895898160	870000000	建信信托有限责任公司

2023/3/1	建信专享日盈 2 号现金管理特定多个客户资产管理计划	赎回	408307679.9	370000000	建信基金管理有限责任公司
2023/3/1	建信信托凤鸣尊享日日盈 3 号集合信托计划	申购	850000000	850000000	建信信托有限责任公司
2023/3/1	建信信托凤鸣尊享日日盈 7 号集合信托计划	赎回	847412500	833333333.33	建信信托有限责任公司
2023/3/2	建信信托凤鸣尊享日日盈 3 号集合信托计划	申购	200000000	200000000	建信信托有限责任公司
2023/3/2	建信信托凤鸣尊享日日盈 13 号集合信托计划	申购	100000000	100000000	建信信托有限责任公司
2023/3/3	建信信托凤鸣尊享日日盈 13 号集合信托计划	申购	400000000	400000000	建信信托有限责任公司
2023/3/9	建信基金-汇益增强 1 号集合资产管理计划	申购	260000000	260000000	建信基金管理有限责任公司
2023/3/9	建信信托凤鸣尊享日日盈 3 号集合信托计划	赎回	515299000	500000000	建信信托有限责任公司
2023/3/10	建信信托凤鸣尊享日日盈 8 号集合信托计划	赎回	47450.96	46771.1	建信信托有限责任公司
2023/3/13	建信基金惠众称心回报 1 号集合资产管理计划	赎回	620508960	600000000	建信基金管理有限责任公司
2023/3/15	建信信托凤鸣尊享日日盈 13 号集合信托计划	赎回	608382000	600000000	建信信托有限责任公司
2023/3/20	建信资本惠众配置 2 号集合资产管理计划	赎回	312850467	300000000	建信资本管理有限责任公司
2023/3/20	建信信托凤鸣尊享日日盈 3 号集合信托计划	赎回	412591200	400000000	建信信托有限责任公司
2023/3/23	建信基金向日葵纯债 1 号	申购	200000000	200000000	建信基金管理有限责任公司
2023/3/29	建信信托凤鸣尊享日日盈 3 号集合信托计划	赎回	167624894.64	162394807.47	建信信托有限责任公司
2023/3/29	建信信托凤鸣尊享日日盈 13 号集合信托计划	赎回	42262942.92	41644644.88	建信信托有限责任公司
2023/3/29	建信基金惠众称心回报 1 号集合	赎回	301253841.78	291331197.34	建信基金管理有限责任公司

	资产管理计划				
2023/3/30	建信信托凤鸣尊享日日盈 12 号集合信托计划	赎回	40008780	45000000	建信信托有限责任公司
2023/3/31	建信信托凤鸣尊享日日盈 7 号集合信托计划	申购	1480000000	1480000000	建信信托有限责任公司

（三）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）

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

附录一

建信理财“安鑫”（七天）固定收益类开放式净值型人民币理财产品投资非标准化债权及股权类资产清单

报告日：2023 年 03 月 31 日

我司依照监管要求，现对建信理财“安鑫”（七天）固定收益类开放式净值型人民币理财产品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。