

建信理财“恒赢”（按日）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“恒赢”（按日）开放式净值型人民币理财产品于 2018 年 08 月 15 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 36,965,143,056.67 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 1.000000。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)	1.000000	1.000000	36,965,143,056.67
一个月前	1.000000	1.000000	44,644,154,438.18
二个月前	1.000000	1.000000	47,646,035,144.21
三个月前	1.000000	1.000000	60,057,022,484.64
六个月前	1.000000	1.000000	58,742,745,575.72
一年前	1.122588	1.122588	77,224,777,988.31

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“恒赢”（按日）开放式净值型人民币理财产品	2018-08-14	2018-08-14	2018-08-15	-

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	516,288.58	13.96%	1,475,642.29	35.77%
同业存单	0.00	0.00%	1,668,483.00	40.45%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	44,748.38	1.08%
债券	0.00	0.00%	935,954.62	22.69%
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%	0.00	0.00%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	3,181,466.44	86.04%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	3,697,755.02	100.00%	4,124,828.29	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	22 平安银行 CD055	998,486,473.65	2.41%
2	22 交通银行 CD205	646,171,682.10	1.56%
3	20 京投 02	513,502,369.89	1.24%
4	22 平安银行 CD045	499,869,598.37	1.21%

5	20 上润金泰 ABN001 优先	409,901,926.29	0.99%
6	中建 5 期 A	406,305,981.58	0.98%
7	GC001	400,000,000.00	0.97%
8	22 江苏银行 CD047	399,505,157.55	0.96%
9	22 天津银行 CD120	349,905,017.20	0.84%
10	22 农业银行 CD052	348,799,325.49	0.84%

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。本产品在本季度期间流动性指标符合监管相关规定，未出现流动性问题。

（二）产品的投资风险情况

1. 产品债券持仓风险及价格波动情况（针对固收类及混合类产品）

截至本报告期末，产品固定收益部分投资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，债券组合整体票息尚可，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。本产品所投资资产，于本季度未发生违约等重大风险事件。

2. 产品股票持仓风险及价格波动情况（针对权益类及混合类产品）

产品无股票持仓。

3. 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况（针对商品及金融衍生品品类与混合类产品）

产品无衍生品持仓。

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。

在报告期间内，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	44050186320100002273-0002	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	22 桂投资 CP001	企业债务融资工具	042280458. IB	2,700,000	99.2849	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
2	20 苏沙钢 MTN004	企业债务融资工具	102000600. IB	600,000	100.0052	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
3	21 常熟发投 PPN001	企业债务融资工具	032100115. IB	600,000	100.5931	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

						公司	
4	23 宁河西 CP001	企业债务 融资工具	042380133. IB	1, 000, 000	100. 0001	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
5	21 浏阳城 建 PPN001	企业债务 融资工具	032100084. IB	2, 200, 000	100. 8878	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
6	20 三一 MTN003	企业债务 融资工具	102000739. IB	1, 200, 000	100. 0138	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
7	22 桂铁投 SCP006	企业债务 融资工具	012283554. IB	200, 000	100. 0004	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
8	22 陕西金 控 SCP003	企业债务 融资工具	012283848. IB	220, 000	99. 9115	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
9	20 中化工 MTN010	企业债务 融资工具	102001094. IB	1, 000, 000	100. 1229	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
10	20 上润金 泰 ABN001 优先	资产支持 证券	082000845. IB	4, 000, 000	100. 6689	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
11	22 广州地 铁 SCP009	企业债务 融资工具	012284012. IB	100, 000	100. 0008	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
12	22 重庆发 展 SCP002	企业债务 融资工具	012282834. IB	280, 000	100. 0001	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
13	22 南山开 发 ABN001 优先	资产支持 证券	082280820. IB	300, 000	99. 5951	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
14	20 鞍钢 MTN002	企业债务 融资工具	102000789. IB	200, 000	100. 0303	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
15	20 陕高速 MTN001	企业债务 融资工具	102001978. IB	800, 000	100. 8672	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
16	18 津城建 MTN009	企业债务 融资工具	101800378. IB	100, 000	100. 0191	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
17	22 粤环保 SCP003	企业债务 融资工具	012282373. IB	470, 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
18	20 兴业银 行小微债 05	商业性金 融债券	2028030. IB	3, 200, 000	100. 5096	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
19	20 鲁信	企业债务	102001370. IB	1, 500, 000	100. 4404	中国建设银	主承销商或

	MTN001	融资工具				行股份有限 公司	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
2023-03-31	20 恒赢 90 天薪安理得 1 号	赎回	300000000	300000000	建信基金管理有限责任公司
2023-03-30	建信保险资管安鑫 8 号资产管理产品	赎回	1212147206.89	1212147206.89	建信保险资产管理有限公司
2023-03-30	建信基金安心宝 2 号集合资产管理计划	申购	2000000000	2000000000	建信基金管理有限责任公司
2023-03-29	20 恒赢 90 天薪安理得 1 号	赎回	700000000	700000000	建信基金管理有限责任公司
2023-03-29	建信资本稳盈 18 号单一资产管理计划	赎回	300000000	299632084.76	建信资本管理有限责任公司
2023-03-29	建信资本安鑫恒赢 3 号专项资产管理计划	赎回	300000000	231155630.52	建信资本管理有限责任公司
2023-03-29	建信恒赢 13 号	赎回	1600000000	1545878365.58	建信基金管理有限责任公司
2023-03-29	18 恒赢建信恒赢 5 号 0I001	赎回	250000000	223579292.88	建信基金管理有限责任公司
2023-03-29	建信保险资管安鑫 8 号资产管理产品	申购	1000000000	1000000000	建信保险资产管理有限公司
2023-03-28	建信信托日日通宝 3 号单一资金信托计划	赎回	195332338.44	195332338.44	建信信托有限责任公司

2023-03-28	建信资本稳盈 18 号单一资产管理计划	赎回	500000000	499417185.14	建信资本管理有限责任公司
2023-03-28	建信资本安鑫恒赢 1 号专项资产管理计划	赎回	100000000	87216798.66	建信资本管理有限责任公司
2023-03-28	建信恒赢 13 号	赎回	700000000	676341839.75	建信基金管理有限责任公司
2023-03-27	建信基金惠众添添赢 18 号单一资产管理计划	赎回	590000000	579546436.94	建信基金管理有限责任公司
2023-03-27	建信资本安鑫恒赢 3 号专项资产管理计划	赎回	1900000000	1464373443.47	建信资本管理有限责任公司
2023-03-27	建信资本安鑫恒赢 1 号专项资产管理计划	赎回	100000000	87236621.08	建信资本管理有限责任公司
2023-03-27	20 恒赢 90 天薪安理得 1 号	赎回	500000000	500000000	建信基金管理有限责任公司
2023-03-27	18 恒赢建信恒赢 1 号 0I001	赎回	1350000000	1166807792.79	建信基金管理有限责任公司
2023-03-24	20 恒赢 90 天薪安理得 1 号	赎回	500000000	500000000	建信基金管理有限责任公司
2023-03-24	建信信托日日通宝 3 号单一资金信托计划	赎回	488477308.76	488477308.76	建信信托有限责任公司
2023-03-23	建信信托日日通宝 3 号单一资金信托计划	赎回	488519307.75	488519307.75	建信信托有限责任公司

2023-03-23	20 恒赢 90 天 薪安理得 1 号	赎回	100000000	100000000	建信基金管理有 限责任公司
2023-03-22	建信信托日 日通宝 3 号 单一资金信 托计划	赎回	488557017.54	488557017.54	建信信托有限责 任公司
2023-03-22	建信资本安 鑫恒赢 3 号 专项资产管 理计划	赎回	250000000	192714120.46	建信资本管理有 限责任公司
2023-03-20	18 恒赢建信 恒赢 5 号 0I001	赎回	300000000	268517556.99	建信基金管理有 限责任公司
2023-03-20	建信恒赢 13 号	赎回	100000000	96683166.97	建信基金管理有 限责任公司
2023-03-20	18 恒赢建信 恒赢 1 号 0I001	赎回	100000000	86466871.87	建信基金管理有 限责任公司
2023-03-20	建信资本安 鑫恒赢 3 号 专项资产管 理计划	赎回	400000000	308416343.53	建信资本管理有 限责任公司
2023-03-17	建信资本安 鑫恒赢 3 号 专项资产管 理计划	赎回	400000000	308434208.22	建信资本管理有 限责任公司
2023-03-17	18 恒赢建信 恒赢 1 号 0I001	申购	400000000	400000000	建信基金管理有 限责任公司
2023-03-17	建信恒赢 13 号	申购	1000000000	1000000000	建信基金管理有 限责任公司
2023-03-14	18 恒赢建信 恒赢 5 号 0I001	申购	100000000	100000000	建信基金管理有 限责任公司

2023-03-14	建信恒赢 13 号	申购	600000000	600000000	建信基金管理有限责任公司
2023-03-14	18 恒赢建信恒赢 1 号 0I001	赎回	1000000000	864890207.55	建信基金管理有限责任公司
2023-03-10	18 恒赢建信恒赢 1 号 0I001	赎回	150000000	129762597.68	建信基金管理有限责任公司
2023-03-10	建信资本安鑫恒赢 3 号专项资产管理计划	赎回	300000000	231418866.25	建信资本管理有限责任公司
2023-03-10	18 恒赢建信恒赢 5 号 0I001	申购	200000000	200000000	建信基金管理有限责任公司
2023-03-09	建信资本稳盈 18 号单一资产管理计划	申购	1500000000	1500000000	建信资本管理有限责任公司
2023-03-09	建信资本安鑫恒赢 3 号专项资产管理计划	赎回	700000000	540008309.18	建信资本管理有限责任公司
2023-03-09	18 恒赢建信恒赢 5 号 0I001	赎回	300000000	268699267.95	建信基金管理有限责任公司
2023-03-09	建信恒赢 13 号	赎回	400000000	386959282.57	建信基金管理有限责任公司
2023-03-06	18 恒赢建信恒赢 5 号 0I001	申购	200000000	200000000	建信基金管理有限责任公司
2023-03-02	建信恒赢 13 号	申购	600000000	600000000	建信基金管理有限责任公司

2023-03-01	18 恒赢建信恒赢 1 号 0I001	赎回	200000000	173105278.55	建信基金管理有限责任公司
2023-02-28	建信资本稳盈 28 号单一资产管理计划	申购	100000000	100000000	建信资本管理有限责任公司
2023-02-28	建信基金惠众添添赢 18 号单一资产管理计划	赎回	100000000	98403405.73	建信基金管理有限责任公司
2023-02-28	建信资本安鑫恒赢 3 号专项资产管理计划	赎回	350000000	270058998.63	建信资本管理有限责任公司
2023-02-28	18 恒赢建信恒赢 5 号 0I001	赎回	320000000	287103018.39	建信基金管理有限责任公司
2023-02-23	建信恒赢 13 号	赎回	150000000	145240774.98	建信基金管理有限责任公司
2023-02-23	建信基金安心宝 2 号集合资产管理计划	申购	150000000	150000000	建信基金管理有限责任公司
2023-02-22	20 恒赢 90 天薪安理得 1 号	赎回	200000000	200000000	建信基金管理有限责任公司
2023-02-21	18 恒赢建信恒赢 5 号 0I001	赎回	200000000	179571795.79	建信基金管理有限责任公司
2023-02-20	建信信托日日通宝 3 号单一资金信托计划	赎回	250000000	244787974.45	建信信托有限责任公司
2023-02-17	建信资本安鑫恒赢 3 号专项资产管理计划	赎回	100000000	77208191.33	建信资本管理有限责任公司

2023-02-15	18 恒赢建信 恒赢 1 号 0I001	赎回	200000000	173257147.66	建信基金管理有 限责任公司
2023-02-14	建信恒赢 13 号	赎回	200000000	193765443.77	建信基金管理有 限责任公司
2023-02-14	18 恒赢建信 恒赢 5 号 0I001	赎回	100000000	89838304.89	建信基金管理有 限责任公司
2023-02-14	18 恒赢建信 恒赢 1 号 0I001	申购	200000000	200000000	建信基金管理有 限责任公司
2023-02-14	建信资本安 鑫恒赢 1 号 专项资产管 理计划	赎回	200000000	174782075.15	建信资本管理有 限责任公司
2023-02-13	18 恒赢建信 恒赢 5 号 0I001	赎回	50000000	44929955.95	建信基金管理有 限责任公司
2023-02-13	建信恒赢 13 号	赎回	240000000	232563795.88	建信基金管理有 限责任公司
2023-02-13	建信资本安 鑫恒赢 3 号 专项资产管 理计划	申购	200000000	200000000	建信资本管理有 限责任公司
2023-02-09	建信资本安 鑫恒赢 3 号 专项资产管 理计划	申购	100000000	100000000	建信资本管理有 限责任公司
2023-02-07	建信信托日 日通宝 3 号 单一资金信 托计划	赎回	245007242.41	245007242.41	建信信托有限责 任公司
2023-02-07	建信资本安 鑫恒赢 3 号 专项资产管 理计划	申购	200000000	200000000	建信资本管理有 限责任公司

2023-02-03	建信恒赢 13 号	赎回	150000000	145427540	建信基金管理有限责任公司
2023-02-03	18 恒赢建信恒赢 5 号 0I001	申购	400000000	400000000	建信基金管理有限责任公司
2023-02-01	建信恒赢 13 号	申购	1700000000	1700000000	建信基金管理有限责任公司
2023-02-01	建信资本安鑫恒赢 3 号 专项资产管理计划	赎回	1700000000	1313758760.57	建信资本管理有限责任公司
2023-01-31	建信恒赢 13 号	赎回	1800000000	1745405360.99	建信基金管理有限责任公司
2023-01-31	建信资本安鑫恒赢 3 号 专项资产管理计划	申购	1900000000	1900000000	建信资本管理有限责任公司
2023-01-20	18 恒赢建信恒赢 5 号 0I001	赎回	200000000	180044741.12	建信基金管理有限责任公司
2023-01-20	建信恒赢 13 号	赎回	200000000	194040087.81	建信基金管理有限责任公司
2023-01-17	建信恒赢 13 号	赎回	700000000	679241687.98	建信基金管理有限责任公司
2023-01-17	建信资本安鑫恒赢 3 号 专项资产管理计划	赎回	500000000	386726426.01	建信资本管理有限责任公司
2023-01-17	建信信托日通宝 3 号 单一资金信托计划	赎回	300000000	294532880.67	建信信托有限责任公司

2023-01-17	18 恒赢建信 恒赢 1 号 0I001	赎回	300000000	260355047.05	建信基金管理有 限责任公司
2023-01-10	建信资本安 鑫恒赢 3 号 专项资产管 理计划	赎回	1000000000	773760362.39	建信资本管理有 限责任公司
2023-01-10	建信资本安 鑫恒赢 1 号 专项资产管 理计划	赎回	280000000	245285831.89	建信资本管理有 限责任公司
2023-01-10	18 恒赢建信 恒赢 5 号 0I001	赎回	380000000	342353772.64	建信基金管理有 限责任公司
2023-01-09	建信保险资 管安鑫 8 号 资产管理产 品	申购	600000000	600000000	建信保险资产管 理有限公司
2023-01-06	建信资本安 鑫恒赢 3 号 专项资产管 理计划	赎回	1500000000	1160901892.3	建信资本管理有 限责任公司
2023-01-06	18 恒赢建信 恒赢 5 号 0I001	赎回	1000000000	901210422.03	建信基金管理有 限责任公司
2023-01-04	建信资本安 鑫恒赢 3 号 专项资产管 理计划	赎回	800000000	619217169.55	建信资本管理有 限责任公司
2023-01-04	18 恒赢建信 恒赢 5 号 0I001	赎回	800000000	721081261.35	建信基金管理有 限责任公司
2023-01-03	建信资本安 鑫恒赢 3 号 专项资产管 理计划	赎回	1500000000	1161311349.06	建信资本管理有 限责任公司

（三）其他关联交易

无。

九、期末现金管理类产品前十名份额持有人情况

序号	投资人类别	持有份额(万份)	占总份额比例(%)
1	普通个人	7,268.33	0.20%
2	普通个人	6,143.06	0.17%
3	普通个人	4,557.79	0.12%
4	普通个人	4,528.45	0.12%
5	普通个人	4,410.91	0.12%
6	普通个人	3,441.23	0.09%
7	普通个人	3,162.65	0.09%
8	普通个人	2,880.13	0.08%
9	普通个人	2,533.32	0.07%
10	普通个人	2,451.42	0.07%

十、投资非标准化债权及股权类资产清单（见附录一）

十一、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“恒赢”（按日）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“恒赢”（按日）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。