

# 建信理财“睿鑫”最低持有 270 天开放理财产品第 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“睿鑫”最低持有 270 天开放理财产品第 1 期于 2020 年 06 月 03 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 12,491,621,207.04 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 1.098851。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)	1.098851	1.098851	12,491,621,207.04
一个月前	1.099762	1.099762	14,165,635,730.35
二个月前	1.106370	1.106370	13,883,641,037.79
三个月前	1.104811	1.104811	17,295,513,319.94
六个月前	1.098740	1.098740	23,853,272,981.12
一年前	1.089429	1.089429	27,794,618,449.28

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“睿鑫”最低持有 270 天开放理财产品第 1 期	2020-05-26	2020-06-02	2020-06-03	-

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上海市分行

### 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	172,316.37	13.78%	228,478.52	17.06%
同业存单	0.00	0.00%	487.88	0.04%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	121,212.95	9.05%
债券	0.00	0.00%	923,846.05	68.97%
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%	3,933.82	0.29%
金融衍生品	0.00	0.00%	-29.80	0.00%
代客境外理财投资 QDII	0.00	0.00%	713.05	0.05%
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	1,760.64	0.14%	60,845.21	4.54%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	1,076,167.77	86.08%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	1,250,244.77	100.00%	1,339,487.68	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.10%

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 国开 20	1,274,772,426.12	9.43%
2	R007	1,112,441,424.77	8.23%
3	嘉实超短债债券 A	291,635,002.55	2.16%
4	22 国开 10	228,495,007.40	1.69%

5	20 金泰精诚 ABN001 优先	151,836,452.05	1.12%
6	铁托 2 优	132,467,531.80	0.98%
7	22 津投 17	128,237,197.86	0.95%
8	22 广电山东 MTN001	115,301,170.35	0.85%
9	22 常德经建 MTN002	113,052,611.81	0.84%
10	铁建 Y08	100,516,645.21	0.74%

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

本产品主要投资于标准化资产，资产流动性较好。

### （二）市场情况

固收方面，2022 年主要债券品种全年均为上行，其中 10 年期国债上行 5bp、5 年期国有大行永续债上行 61bp、3 年期 AAA 信用债上行 25bp、3 年期 AA+信用债上行 47bp，全年资本利得均为负。此外，2022 年 11 月份以来，债市受防疫政策放开及房地产政策不断加码影响，市场普遍预期宏观经济回升，债市随之大幅调整。同时，受“债市调整-资管产品赎回-债市继续调整”这一负向反馈影响，本轮债市调整幅度深、时间短，为 16 年以来最大的一次。展望 2023 年，债市回归基本面逻辑。在疫后消费复苏、基建托底经济等政策支持下，经济复苏概率较大，市场分歧在于经济复苏的程度，在一定程度上会压制债市表现。随着年初两会经济增长目标的制定，强刺激政策出台概率降低，偏向于经济内生增长。货币政策依然维持宽松态势，资金利率将围绕政策利率波动。全年债市大概率根据经济复苏程度处于震荡态势。

权益方面主要受到俄乌战争、美联储加息以及国内疫情等多重冲击，进而对市场风险偏好、整体市场估值以及企业盈利均产生负

面影响。回顾全年主要股指如沪深 300、创业板指、万得全 A 指数回报分别为-21.33%、-29.37%、-18.17%，是近 10 年中仅次于 2018 年的熊市。展望 2023 年，权益市场经历了 2022 年大幅回调，主流指数估值均处于历史低位，具有一定吸引力。今年以来的市场风险偏好已出现明显提升，经济基本上消费和地产复苏预期中性偏乐观，政策上对经济增长诉求下政策预期也是偏乐观，在中美关系上存在一定不确定性，可能导致市场波动。整体今年权益市场机会明显增加。

本产品持仓少量国债期货，主要是套保仓位，以对冲组合久期带来的利率波动风险。

## 六、托管人报告

托管人在执行本理财产品的托管过程中，根据银监会的要求，严格遵守有关法律和保管合同的约定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何违背保管合同的行为。托管人未发现管理人有违背理财产品说明书约定的行为。

## 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	31050136360000004190-0028	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上海市分行

## 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	持仓数量	交易净价	关联方名称	关联方角色
1	18 西永 MTN001	企业债务融资工具	101801097.IB	29,222	101.0409	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
2	19 华润 MTN001	企业债务融资工具	101900051.IB	11,689	102.3087	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

3	21 苏新国资 MTN002	企业债务融资工具	102100114. IB	11,689	102.1751	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
4	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	40,911	100.2919	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
5	21 莆田国资 PPN003	企业债务融资工具	032100763. IB	29,222	101.8298	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
6	21 六安建投 PPN001	企业债务融资工具	032100046. IB	11,689	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 相城高新 PPN001	企业债务融资工具	032100354. IB	17,533	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 苏国信 MTN001	企业债务融资工具	102100362. IB	5,844	102.1530	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
9	21 粤交投 MTN001	企业债务融资工具	102100001. IB	29,222	102.4419	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
10	20 中电投 MTN003	企业债务融资工具	102000498. IB	29,222	100.7380	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
11	20 晋煤 MTN003	企业债务融资工具	102000995. IB	11,689	98.3027	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
12	20 中国银行永续债 03	商业性金融债券	2028053. IB	17,533	104.4695	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
13	21 工商银行永续债 01	商业性金融债券	2128021. IB	35,067	101.3478	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
14	21 江西交投 MTN001	企业债务融资工具	102100176. IB	11,689	102.2880	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
15	21 汾湖投资 MTN001	企业债务融资工具	102101484. IB	52,480	99.9706	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
16	18 鲁钢铁 MTN008	企业债务融资工具	101801567. IB	288,642	104.2041	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
17	18 龙岩汇金 MTN001	企业债务融资工具	101801417. IB	78,720	100.8748	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
18	20 山东航空 MTN001	企业债务融资工具	102000814. IB	184,348	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	21 金港 MTN002	企业债务 融资工具	102101410. IB	184,348	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	19 建元 8A3_bc	资产支持 证券	1989325. IB	141,618	70.6638	建信信托有 限责任公司	计划管理人
21	20 飞驰建 瓴 ABN001 优先	资产支持 证券	082000628. IB	103,261	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
22	20 上润金 泰 ABN001 优先	资产支持 证券	082000845. IB	206,522	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	20 声赫鞍 钢 ABN001 优先	资产支持 证券	082000940. IB	206,522	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
24	20 中电西 藏 ABN002 优先	资产支持 证券	082001038. IB	340,761	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	20 中交投 资 ABN001 优先	资产支持 证券	082001046. IB	216,848	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 飞驰建 瓴 ABN001 优先	资产支持 证券	082100312. IB	516,305	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
27	21 成都交 子 ABN001 优先	资产支持 证券	082180076. IB	185,869	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	22 鲁黄金 ABN001 优 先	资产支持 证券	082280280. IB	278,804	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 飞驰财 信 ABN001 优先	资产支持 证券	082280456. IB	309,783	100.0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
30	22 飞驰财 信 ABN002 优先	资产支持 证券	082280586. IB	95,000	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	22 四川能 投 ABN001 优先	资产支持 证券	082280643. IB	20,652	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	20 飞驰建 普 2B	资产支持 证券	2089420. IB	134,239	21.3700	建信信托有 限责任公司	计划管理人
33	19 建元 1A3_bc	资产支持 证券	1989045. IB	194,265	50.1187	建信信托有 限责任公司	计划管理人

34	步步高1	资产支持 证券	121539.SZ	89,362	99.5208	建信资本管 理有限责任 公司,建信 资本管理有 限责任公司	计划管理 人,主承销 商或联席承 销商
35	22 粤澳 ABN001 优 先	资产支持 证券	082280418.IB	172,896	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 云南资 产 PPN001	企业债务 融资工具	032000644.IB	291,398	102.1182	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
37	20 建发集 MTN003	企业债务 融资工具	102001509.IB	97,132	100.9385	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
38	21 中联重 科 ABN001 优先 A2	资产支持 证券	082100800.IB	369,104	62.9900	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
39	20 金风科 技 MTN001	企业债务 融资工具	102001672.IB	582,796	101.8657	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
40	20 辽交投 MTN001	企业债务 融资工具	102000898.IB	835,342	99.8104	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
41	21 中电元 恒 ABN005 优先 A	资产支持 证券	082101373.IB	112,674	42.0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
42	21 粤澳 ABN001 优 先	资产支持 证券	082180078.IB	58,279	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 广东电 力 ABN001 优先	资产支持 证券	082101077.IB	570,222	99.1600	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
44	21 飞驰潍 信 ABN001 优先	资产支持 证券	082100917.IB	156,782	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 飞驰星 火 ABN001 优先	资产支持 证券	082101095.IB	156,782	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
46	21 光穗铜 冠 ABN001 优先	资产支持 证券	082101007.IB	196,268	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 中电元 恒 ABN001 优先 A	资产支持 证券	082101010.IB	452,926	25.8100	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
48	21 江西铁 航 ABN001	资产支持 证券	082100975.IB	116,134	100.0000	中国建设银 行股份有限	主承销商或 联席承销商

	优先					公司	
49	22 中国银行永续债01	商业性金融债券	2228023. IB	612,750	100.4858	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
50	22 农业银行永续债01	商业性金融债券	2228011. IB	710,204	99.9615	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
51	22 浙银租赁货运物流主题债	商业性金融债券	2222004. IB	4,919	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 中国银行永续债02	商业性金融债券	2128045. IB	491,575	100.0365	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
53	22 昆山国创 MTN007	企业债务融资工具	102282049. IB	49,192	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 工商银行永续债02	商业性金融债券	2128044. IB	185,493	100.0824	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
55	22 云天化 MTN001	企业债务融资工具	102281519. IB	49,192	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 晋能煤业 MTN013 (科创票据)	企业债务融资工具	102281337. IB	54,112	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 长沙轨道交通 MTN001	企业债务融资工具	102281302. IB	4,919	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 新庐陵 MTN001	企业债务融资工具	102281265. IB	68,869	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	22 合肥产投 MTN001 (科创票据)	企业债务融资工具	102281241. IB	83,627	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 苏海投资 MTN001	企业债务融资工具	102103327. IB	39,179	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 五凌1号 ABN001 优先 A	资产支持证券	082280989. IB	14,757	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 中建投资 MTN001 (绿色)	企业债务融资工具	102280709. IB	3,935	100.4816	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
63	22 渝兴永	企业债务	102280163. IB	7,378	100.0000	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
64	22 扬州经 开 MTN002	企业债务 融资工具	102282013. IB	34,434	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 曲文投 MTN001	企业债务 融资工具	102281604. IB	63,950	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 淮北建 投 MTN003	企业债务 融资工具	102281419. IB	189,692	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 贵州交 通 MTN002	企业债务 融资工具	102200161. IB	49,192	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	21 渝高建 投 MTN001	企业债务 融资工具	102102220. IB	29,515	100.1898	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
69	22 北部湾 MTN001	企业债务 融资工具	102280032. IB	51,448	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	22 宿迁水 务 MTN002	企业债务 融资工具	102281374. IB	4,919	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	21 淮安国 投 MTN003	企业债务 融资工具	102103248. IB	24,479	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	21 淄博城 运 MTN003	企业债务 融资工具	102103220. IB	54,112	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	21 靖江港 口 PPN001	企业债务 融资工具	032191490. IB	29,515	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	21 江门高 新 MTN001	企业债务 融资工具	102103204. IB	31,829	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	21 晋能电 力 MTN015	企业债务 融资工具	102103210. IB	105,326	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 珠海华 发 ABN001 优先	资产支持 证券	082282014. IB	14,265	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 昆钢 MTN001	企业债务 融资工具	102280779. IB	118,062	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	21 临沂投 资 MTN003	企业债务 融资工具	102102176. IB	24,596	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	18 威经开 MTN001	企业债务融资工具	101800643. IB	14,757	102.8289	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
80	22 象屿 MTN001 (科创票据)	企业债务融资工具	102281255. IB	98,385	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 渝医药 MTN001	企业债务融资工具	102280164. IB	22,049	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	20 重庆发展 MTN001	企业债务融资工具	102002033. IB	44,273	100.4810	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
83	21 益阳城投 MTN001	企业债务融资工具	102102158. IB	24,596	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 昆交产 SCP002	企业债务融资工具	012283632. IB	24,596	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	21 高淳经开 PPN002	企业债务融资工具	032191360. IB	58,622	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	22 农行永续债 02	商业性金融债券	092280086. IB	98,385	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 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2228029. IB	819,359	100.5922	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
88	21 长安汇通 PPN001	企业债务融资工具	032191358. IB	39,062	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	21 淄博城资 MTN002	企业债务融资工具	102103081. IB	115,398	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 杭州日报 MTN001	企业债务融资工具	102280897. IB	2,430	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	21 厦国贸控 MTN006	企业债务融资工具	102101666. IB	24,304	100.4576	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
92	21 苏豪 MTN001	企业债务融资工具	102100394. IB	24,304	102.1295	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
93	22 云南交投 MTN001	企业债务融资工具	102280415. IB	65,622	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
94	22 华阳新材 MTN002	企业债务融资工具	102280404. IB	60,761	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

95	22 鲁能源 MTN001	企业债务 融资工具	102280239. IB	2, 430	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
96	22 河南农 开 MTN001	企业债务 融资工具	102280223. IB	7, 291	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
97	21 赣投 MTN001	企业债务 融资工具	102101632. IB	36, 456	100. 5436	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
98	21 皖农垦 MTN001	企业债务 融资工具	102101976. IB	24, 304	100. 9302	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
99	22 华润资 产 MTN001	企业债务 融资工具	102280868. IB	2, 430	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
100	21 中建投 资 MTN002	企业债务 融资工具	102103346. IB	12, 152	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
101	21 湖北文 旅 MTN003	企业债务 融资工具	102102330. IB	12, 152	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
102	21 长沙经 开 MTN002	企业债务 融资工具	102103192. IB	9, 721	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
103	21 闽国资 MTN001	企业债务 融资工具	102102247. IB	12, 152	99. 4239	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
104	21 渝医药 MTN001	企业债务 融资工具	102103043. IB	12, 152	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	21 长发集 团 MTN002	企业债务 融资工具	102101977. IB	48, 609	100. 9574	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
106	21 昆明轨 道 MTN001	企业债务 融资工具	102101052. IB	24, 304	102. 1700	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
107	21 海沧投 资 MTN003	企业债务 融资工具	102102299. IB	2, 430	99. 5884	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
108	21 中国银 行永续债 01	商业性金 融债券	2128019. IB	63, 191	102. 5102	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
109	21 云能投 MTN002	企业债务 融资工具	102101660. IB	72, 913	100. 5653	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
110	21 华发集 团 MTN009	企业债务 融资工具	102101775. IB	36, 456	100. 7593	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商

111	21 益阳交 投 MTN002	企业债务 融资工具	102101823. IB	26,734	100.1841	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
112	21 中国信 达债 01	商业性金 融债券	092100008. IB	128,813	99.9144	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
113	21 建发 MTN001	企业债务 融资工具	102101832. IB	72,913	101.3505	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
114	22 滨江城 建 MTN001	企业债务 融资工具	102200091. IB	2,430	100.0000	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
115	21 鄂联投 MTN001	企业债务 融资工具	102102242. IB	12,152	101.4651	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
116	21 陕投集 团 MTN005	企业债务 融资工具	102101525. IB	7,291	101.0980	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
117	21 川能投 MTN002B	企业债务 融资工具	102101521. IB	36,456	101.2730	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
118	21 长城资 本债 01BC	商业性金 融债券	092100012. IB	97,218	100.8533	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
119	21 临沂投 资 MTN002(革 命老区)	企业债务 融资工具	102102008. IB	64,261	100.8405	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
120	21 苏豪 MTN002	企业债务 融资工具	102100747. IB	14,582	102.2872	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
121	21 津城建 MTN001	企业债务 融资工具	102101907. IB	29,165	98.0409	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
122	21 华电山 能 ABN001 优先	资产支持 证券	082180086. IB	5,711	100.0000	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
123	22 飞驰林 语 ABN001 优先	资产支持 证券	082280315. IB	36,213	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
124	22 中国信 达债 01	商业性金 融债券	092280003. IB	267,349	100.0000	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
125	21 山西建 投 ABN002 优先	资产支持 证券	082101489. IB	84,336	100.0000	中国建设银行 股份有限 公司	主承销商或 联席承销商

126	21 工商银行二级 01	商业性金融债券	2128002. IB	583, 115	102. 1718	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
127	20 工商银行二级 02	商业性金融债券	2028049. IB	116, 623	101. 5545	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
128	21 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2128038. IB	58, 311	101. 4091	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
129	22 云能投 MTN005	企业债务融资工具	102281652. IB	466, 492	100. 0026	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
130	22 苏豪 MTN001	企业债务融资工具	102282108. IB	408, 181	97. 0403	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
131	20 工商银行二级 01	商业性金融债券	2028041. IB	116, 623	101. 7819	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
132	22 常德经建 MTN002	企业债务融资工具	102282130. IB	1, 166, 231	96. 2286	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
133	建信中关村 REIT	REITS 基金	508099. SH	8, 889, 983	3. 2000	建信基金管理有限责任公司	基金管理人
134	建信潜力新蓝筹 C	股票基金	014967. OF	467, 260	3. 6800	建信基金管理有限责任公司	基金管理人
135	建信智远先锋 A	混合基金	016064. OF	5, 158, 214	1. 0000	建信基金管理有限责任公司	基金管理人

## （二）其他关联交易

无

## 九、投资非标准化债权及股权类资产清单

无

## 十、产品整体运作情况

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。

## 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