

建信理财嘉鑫（法人版）固收类按日开放式产品 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（法人版）固收类按日开放式产品于 2022 年 07 月 05 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 12,265,411,915.69 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 1.009587。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)	1.009587	1.009587	12,265,411,915.69
一个月前	1.007712	1.007712	8,442,926,441.45
两个月前	1.006623	1.006623	11,677,130,274.26
三个月前	1.004797	1.004797	8,003,018,276.03
六个月前	-	-	-
一年前	-	-	-

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（法人版）固收类按日 开放式产品	2022-06-23	2022-07-04	2022-07-05	-

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	490,515.37	39.98%	1,130,502.16	92.93%
同业存单	0.00	0.00%	11,331.21	0.93%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	6,819.36	0.56%
债券	0.00	0.00%	25,603.65	2.10%
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%	42,240.00	3.47%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	736,259.33	60.02%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	1,226,774.70	100.00%	1,216,496.38	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.03%

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	建信荣瑞一年定期开放债券	360,247,379.16	2.96%
2	R004	67,954,489.11	0.56%
3	广发理财年年红债券	61,799,897.36	0.51%

4	20 华宇 G2	42,336,297.35	0.35%
5	信托保障基金成本	40,251,686.67	0.33%
6	20 柳发 01	39,955,533.91	0.33%
7	19 沪城控 MTN001	38,958,111.28	0.32%
8	22 嘉兴滨海 SCP003	31,219,184.10	0.26%
9	22 浦发银行 CD167	22,962,677.54	0.19%
10	22 乐山国资 SCP002	16,334,070.56	0.13%

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，故产品流动性较好、风险较低。

（二）产品的投资风险情况

截至本报告期末，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	44250100000200 004533	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	22 海峡环保 GN003	企业债务融资工具	132280084. IB	95	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	22 北部湾投 MTN003	企业债务融资工具	102282098. IB	95	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	21 闽建工 MTN002	企业债务融资工具	102100930. IB	47	102.6468	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
4	22 现代牧业 SCP001(乡村振兴)	企业债务融资工具	012283916. IB	119	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 上海能科 ABN001 优先 A	资产支持证券	082280795. IB	95	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	22 泰达投资 SCP008	企业债务融资工具	012283101. IB	861	97.8287	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
7	22 盛世融迪 5 优先 _bc	资产支持证券	2289352. IB	478	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	22 广西旅发 MTN002(绿色乡村振兴)	企业债务融资工具	102282467. IB	239	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	22 津城建 CP025	企业债务融资工具	042280423. IB	478	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 山西清能 ABN001 优先	资产支持证券	082280800. IB	239	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 泰达投资 SCP009	企业债务融资工具	012283224. IB	717	97.3403	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
12	22 上海能	资产支持	082280796. IB	119	100.0000	中国建设银	主承销商或

	科 ABN001 优先 B	证券				行股份有限 公司	联席承销商
13	22 江铜 MTN005	企业债务 融资工具	102282504. IB	717	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	22 江苏水 源 SCP001	企业债务 融资工具	012283652. IB	102,835	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	建信荣瑞 一年定开	债券基金	007830. OF	359,923,448	1.0000	建信基金管 理有限责任 公司	基金管理人
16	19 沪城控 MTN001	企业债务 融资工具	101900542. IB	370,978	103.1771	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）

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。

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（法人版）固收类按日开放式产品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（法人版）固收类按日开放式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。