

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2023年二季度暨半年投资管理报告

报告日：2023年06月30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9,309,423,254.36元。

一、报告期投资者实际收益率

截至2023年06月30日，产品单位净值为1.105842。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)	1.105842	1.105842	9,309,423,254.36
一个月前	1.103674	1.103674	10,162,347,977.04
二个月前	1.100180	1.100180	10,315,774,738.15
三个月前	1.097316	1.097316	7,456,403,873.77
六个月前	1.087554	1.087554	6,694,577,625.61
一年前	1.079732	1.079732	12,319,782,801.35

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

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	55,458.71	5.96%	154,110.87	14.46%
同业存单	0.00	0.00%	206,695.92	19.40%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	1,078.14	0.10%
债券	67,724.25	7.27%	703,415.31	66.00%
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%	408.61	0.04%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	808,017.75	86.77%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	931,200.72	100.00%	1,065,708.86	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	23 华夏银行 CD020	297,732,470.33	2.77%
2	22 国开 02	263,354,284.15	2.45%

3	23 证金 D70	258,969,792.39	2.41%
4	21 国开 18	245,772,558.90	2.28%
5	15 国开 10	208,437,431.69	1.94%
6	23 中信银行 CD123	203,179,242.22	1.89%
7	22 进出 05	202,776,712.33	1.88%
8	23 兴业银行 CD149	196,284,216.39	1.82%
9	23 浦发银行 CD099	195,936,574.86	1.82%
10	21 海通 01	184,005,700.27	1.71%

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

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 2020 年 9 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。

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

衍生品类与混合类产品)

产品无衍生品持仓。

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	22 光大银行	商业性金融债券	2228050. IB	1,000,000	99.5713	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
2	20 工商银行二级 01	商业性金融债券	2028041. IB	900,000	102.9506	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
3	23 光大银行债 01	商业性金融债券	212380005. IB	500,000	99.9417	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
4	21 昆明轨道 MTN004 (绿色)	企业债务融资工具	102103149. IB	102,117	96.6434	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
5	21 光穗铜冠 ABN001 优先	资产支持证券	082101007. IB	162,525	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 飞驰财信 ABN001 优先	资产支持证券	082280456. IB	12,830	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 昆明轨道 MTN001	企业债务融资工具	102101052. IB	8,554	98.7037	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
8	22 华电山能 ABN001 优先	资产支持证券	082280296. IB	12,830	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 粤澳 ABN001 优先	资产支持证券	082180078. IB	94,093	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	20 飞驰光信 ABN001 优先	资产支持证券	082001078. IB	121,018	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	22 融信元泰 ABN001 优先 A	资产支持证券	082280019. IB	141,188	10.2100	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
12	20 飞驰建瓴 ABN001 优先	资产支持证券	082000628. IB	53,126	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
13	21 成都交子 ABN001 优先	资产支持证券	082180076. IB	77,912	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 粤澳 ABN001 优先	资产支持证券	082280418. IB	38,956	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 珠海华发 ABN001 优先	资产支持证券	082282014. IB	15,541	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	17 淄博资运 MTN002	企业债务融资工具	101754118. IB	108,211	105.6634	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
17	20 云能投 MTN004	企业债务融资工具	102001253. IB	43,284	98.1940	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
18	20 新都香城 MTN001	企业债务融资工具	102001424. IB	30,299	103.5179	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
19	20 川交投 MTN001	企业债务融资工具	102002154. IB	108,211	101.8980	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
20	21 佛燃能源 MTN001	企业债务融资工具	102100007. IB	4,328	101.4446	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
21	21 江门高新 MTN001	企业债务融资工具	102103204. IB	21,642	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

22	22 苏州文旅 MTN002	企业债务融资工具	102280518. IB	4,328	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	23 赣投 MTN001	企业债务融资工具	102381502. IB	43,284	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
24	20 秀湖集团 MTN001	企业债务融资工具	102000708. IB	12,814	99.8247	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
25	21 成都益民 MTN001 (乡村振兴)	企业债务融资工具	102100514. IB	3,408	102.1171	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
26	21 飞驰惟安 ABN001 优先 A1	资产支持证券	082100172. IB	3,408	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
27	21 浙资运营 MTN001	企业债务融资工具	102100529. IB	4,260	101.9697	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
28	21 宝龙 MTN001	企业债务融资工具	102101036. IB	5,112	33.7880	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
29	21 陆金开 MTN001	企业债务融资工具	102100303. IB	8,520	100.6675	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
30	建信荣瑞一年定开	债券基金	007830. OF	3,444,650	1.0000	建信基金管理有限责任公司	基金管理人
31	21 淮安国投 MTN003	企业债务融资工具	102103248. IB	11,897	98.6976	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
32	21 越秀小微 ABN003 优先 A2	资产支持证券	082101398. IB	6,118	7.2074	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
33	21 常德城投 MTN001	企业债务融资工具	102100309. IB	13,596	100.3968	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
34	22 中铁四局 ABN001 优先 (科创票据)	资产支持证券	082280776. IB	3,399	97.8627	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
35	19 建元 12A2_bc	资产支持证券	1989574. IB	155,082	28.3026	建信信托有限责任公司	计划管理人

36	19 建元 11A2_bc	资产支持 证券	1989546. IB	155,082	37.5331	建信信托有 限责任公司	计划管理人
37	19 平安银 行永续债 01	商业性金 融债券	1928038. IB	23,262	103.1014	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
38	21 江铜 GN001(碳 中和债)	企业债务 融资工具	132100038. IB	5,427	101.8271	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
39	19 珠海港 MTN002	企业债务 融资工具	101900992. IB	54,278	103.1271	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
40	19 珠海港 MTN003	企业债务 融资工具	101901427. IB	46,524	103.4524	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
41	20 漳州开 发 MTN002	企业债务 融资工具	102001701. IB	116,311	101.5514	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
42	21 中方财 团 MTN001(权 益出资)	企业债务 融资工具	102100797. IB	38,770	101.9175	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
43	21 成都产 投 MTN001	企业债务 融资工具	102100745. IB	23,262	102.0213	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
44	20 苏新国 资 MTN001	企业债务 融资工具	102001499. IB	31,016	100.6152	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
45	19 沪城控 MTN001	企业债务 融资工具	101900542. IB	232,623	103.2737	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
46	18 宿迁城 投 MTN002	企业债务 融资工具	101801311. IB	7,754	101.8739	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
47	22 融信产 融 ABN001 优先 B	资产支持 证券	082280913. IB	85,295	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 建元 1A3_bc	资产支持 证券	2089065. IB	77,541	67.0383	建信信托有 限责任公司	计划管理人
49	22 欣荣 1 优先	资产支持 证券	2289125. IB	405,541	29.8500	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
50	20 河南交 规 MTN001	企业债务 融资工具	102001464. IB	7,754	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）

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06月30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：2023年06月30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。