

建信理财“安鑫”（最低持有 180 天）按日开放固定收益类净值型人民币理财产品 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“安鑫”（最低持有 180 天）按日开放固定收益类净值型人民币理财产品于 2018 年 11 月 08 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 20,000,116,605.54 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 1.154976。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)	1.154976	1.154976	20,000,116,605.54
一个月前	1.152870	1.152870	21,484,246,708.33
二个月前	1.148998	1.148998	22,559,684,349.80
三个月前	1.144593	1.144593	23,452,038,500.76
六个月前	1.132382	1.132382	29,424,879,317.12
一年前	1.136603	1.136603	28,851,319,643.97

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”（最低持有 180 天）按日开放固定收益类净值型人民币理财产品	2018-11-02	2018-11-07	2018-11-08	-

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

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	248,060.30	12.39%	465,142.02	23.18%
同业存单	0.00	0.00%	24.64	0.00%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	267.75	0.01%
债券	0.00	0.00%	1,480,228.01	73.79%
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%	60,608.21	3.02%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	1,753,271.07	87.61%	0.00	0.00%
委托投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	2,001,331.37	100.00%	2,006,270.63	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.07%

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 农行二级资本债 02A	672,425,720.55	3.30%
2	21 农发 02	610,475,409.84	3.00%
3	22 中行二级资本债 02A	355,361,808.22	1.74%
4	23 中行永续债 01	349,683,023.97	1.72%
5	18 宜昌绿色债 NPB	314,397,945.21	1.54%
6	21 中国信达债 01	313,816,438.36	1.54%
7	21 甘公投 MTN003	311,472,246.58	1.53%
8	19 中国银行永续债 01	308,898,904.11	1.52%
9	21 威海城投 MTN002	300,030,663.01	1.47%
10	定期存款	274,056,496.91	1.34%

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、国债、政策性金融债、银行存单及信用债等资产，产品的流动性相对较好，流动性风险可控。

（二）产品的投资风险情况

本产品募集资金主要投资于银行存款、国债、政策性金融债、银行存单及信用债等资产，风险可控。

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	4405018632010002329-0003	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 淮安国投 MTN002	企业债务融资工具	102101239. IB	600, 324	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	23 中行永续债 01	商业性金融债券	242380008. IB	3, 500, 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
3	21 闽建工 MTN002	企业债务融资工具	102100930. IB	36	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
4	20 声赫鞍钢 ABN001 优先	资产支持证券	082000940. IB	360	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
5	21 威经开 MTN001	企业债务融资工具	102100556. IB	180	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	20 新都香城 MTN001	企业债务融资工具	102001424. IB	72	101. 0907	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
7	21 莆田国资 PPN001	企业债务融资工具	032100070. IB	400, 072	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 泉州台商 MTN001	企业债务融资工具	102100690. IB	108	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	19 平安银行永续债 01	商业性金融债券	1928038. IB	360	101.6823	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	3	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	21 甘国投 MTN002	企业债务融资工具	102101785. IB	1,239,804	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
12	22 淮北建投 MTN003	企业债务融资工具	102281419. IB	37,756	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
13	20 新海连 PPN003	企业债务融资工具	032000898. IB	94,390	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	21 飞驰惟安 ABN001 优先 A1	资产支持证券	082100172. IB	188,780	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
15	21 光穗华能 ABN001 优先	资产支持证券	082100470. IB	302,048	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	21 太仓科教 PPN001	企业债务融资工具	032100370. IB	237,756	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	21 南京新港 PPN002	企业债务融资工具	032100481. IB	188,780	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	22 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2228011. IB	2,500,000	99.9946	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
19	23 苏州文旅 MTN002	企业债务融资工具	102380282. IB	100,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
20	21 甬工投 MTN002	企业债务融资工具	102101779. IB	300,000	98.6992	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
21	21 湘投 MTN001	企业债务融资工具	102101348. IB	900,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
22	21 成都产投 MTN001	企业债务融资工具	102100745. IB	800,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

23	21 株洲高科 MTN002	企业债务融资工具	102101233. IB	1,400,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
24	21 莆田国资 PPN002	企业债务融资工具	032100441. IB	600,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
25	21 昆承湖 PPN001	企业债务融资工具	032100281. IB	200,000	99.4632	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
26	21 株洲高科 MTN001	企业债务融资工具	102100282. IB	700,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
27	22 中行二级资本债 02A	商业性金融债券	092280108. IB	3,500,000	100.0792	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
28	20 青岛海科 MTN001	企业债务融资工具	102002211. IB	750,000	102.5319	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
29	21 厦国贸控 MTN001	企业债务融资工具	102100313. 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
30	21 常熟交通 PPN003	企业债务融资工具	032100420. IB	280,000	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 工商银行二级 03	商业性金融债券	2228024. IB	900,000	100.5815	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
32	20 华融租赁债 01	商业性金融债券	2022026. IB	600,000	94.5332	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
33	22 滨江城建 MTN002	企业债务融资工具	102200258. IB	600,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
34	21 新都香城 MTN001	企业债务融资工具	102101718. IB	400,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
35	21 中国信达债 01	商业性金融债券	092100008. IB	3,000,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
36	21 威海城投 MTN002	企业债务融资工具	102101545. IB	2,900,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
37	21 运和城投 MTN001	企业债务融资工具	102101446. IB	300,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
38	18 海尔金控 MTN001	企业债务融资工具	101801448. IB	1,800,000	102.8370	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

39	21 成都交子 ABN001 优先	资产支持证券	082180076. IB	360,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
40	21 粤澳 ABN001 优先	资产支持证券	082180078. IB	60,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
41	22 乌高新 MTN002	企业债务融资工具	102281994. IB	50,992	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 苏新国资 MTN001	企业债务融资工具	102380238. IB	203,971	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 达州投资 PPN001 (革命老区)	企业债务融资工具	032191462. IB	254,963	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 渝医药 MTN001	企业债务融资工具	102280164. IB	152,978	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	22 泉州台商 MTN002	企业债务融资工具	102280528. IB	203,971	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
46	23 连云城建 PPN001	企业债务融资工具	032380031. IB	152,978	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	22 苏州文旅 MTN002	企业债务融资工具	102280518. IB	101,985	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	22 威宁投资 MTN001	企业债务融资工具	102280258. IB	101,985	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
49	22 洛阳城乡 MTN001	企业债务融资工具	102282164. IB	50,992	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
50	22 晋能煤业 PPN006	企业债务融资工具	032280247. IB	305,956	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
51	22 渝兴永 MTN001	企业债务融资工具	102280163. IB	20,397	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	22 金合盛 MTN003 (科创票据)	企业债务融资工具	102281243. IB	152,978	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
53	22 淮北建投 MTN004	企业债务融资工具	102281832. IB	50,992	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	22 新都香城 MTN001	企业债务融资工具	102280341. IB	101, 985	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
55	21 建发 MTN002	企业债务融资工具	102103276. IB	866, 877	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	23 苏城投 SCP001	企业债务融资工具	012380116. IB	50, 992	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	18 谷财 MTN002	企业债务融资工具	101800993. IB	75, 139	100. 5999	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
58	22 宁波经开 CP002	企业债务融资工具	042280471. IB	37, 569	99. 2403	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
59	20 瘦西湖 MTN001	企业债务融资工具	102001399. IB	125, 232	100. 5140	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
60	20 常德城投 MTN003	企业债务融资工具	102002333. IB	25, 046	101. 3928	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
61	20 汾湖投资 MTN001	企业债务融资工具	102002118. IB	25, 046	100. 7172	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
62	22 吴江交投 PPN001	企业债务融资工具	032281094. IB	25, 046	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
63	19 娄城高新 MTN002	企业债务融资工具	101900108. IB	12, 523	102. 8424	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
64	18 宿迁城投 MTN002	企业债务融资工具	101801311. IB	25, 046	101. 7263	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
65	19 工商银行永续债	商业性金融债券	1928018. IB	588, 594	101. 8607	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
66	19 娄城高新 MTN001	企业债务融资工具	101900041. IB	37, 569	102. 5639	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
67	22 成都高新 MTN002	企业债务融资工具	102282555. IB	1, 503	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	22 建发地产 MTN003B	企业债务融资工具	102280667. IB	751	102. 6078	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

无，本产品未投资非标准化债权及股权类资产。

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