

# 建信理财“建信宝1号”按日开放式理财产品 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“建信宝1号”按日开放式理财产品于 2019 年 12 月 17 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 15,986,081,383.15 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 1.000000。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	15,986,081,383.15
一个月前	1.000000	1.000000	18,825,522,134.92
二个月前	1.000000	1.000000	12,837,764,771.88
三个月前	1.000000	1.000000	7,202,610,632.32
六个月前	1.000000	1.000000	6,895,285,942.36
一年前	1.075177	1.075177	4,601,936,136.72

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“建信宝1号”按日开放式理财产品	2019-11-29	2019-12-16	2019-12-17	-

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	占全部产品总资产	穿透后金额	占全部产品总资产
------	-------	----------	-------	----------

	(万元)	产的比例 (%)	(万元)	产的比例 (%)
现金及银行存款	184,889.33	11.56%	833,758.47	45.99%
同业存单	0.00	0.00%	660,726.71	36.44%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	0.00	0.00%
债券	0.00	0.00%	318,505.62	17.57%
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	1,414,386.94	88.44%	0.00	0.00%
委托投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	1,599,276.27	100.00%	1,812,990.80	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	23 平安不动 SCP002	394,219,838.02	2.17%
2	23 浦发银行 CD028	297,324,798.76	1.64%
3	22 交通银行 CD243	297,048,630.44	1.63%
4	23 农业银行 CD056	294,118,239.23	1.62%
5	23 交通银行 CD129	293,696,447.38	1.62%
6	23 新能源 4ABN002 优先(碳中和债)	250,873,417.87	1.38%
7	22 长沙银行 CD258	198,664,076.63	1.09%

8	23 兴业银行 CD097	197,850,579.30	1.09%
9	23 浙商银行 CD093	197,006,844.10	1.08%
10	23 交通银行 CD099	196,545,158.34	1.08%

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

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

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

产品无衍生品持仓。

## 六、托管人报告

## 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	442501000002000 03298-0002	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 南山开发 ABN001 优先	资产支持证券	082280820. IB	350,000	99.7775	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
2	19 首钢 MTN001	企业债务融资工具	101900134. IB	100,000	101.0250	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
3	19 首创集 MTN001	企业债务融资工具	101900292. IB	200,000	101.1210	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
4	22 厦门火炬 SCP002	企业债务融资工具	012283840. IB	100,000	100.0002	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
5	22 泰达投资 SCP011	企业债务融资工具	012284447. IB	500,000	99.2048	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
6	23 鲁钢铁 SCP002	企业债务融资工具	012380377. IB	200,000	100.0300	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
7	23 海曙广聚 SCP002	企业债务融资工具	012380871. IB	100,000	100.0009	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
8	23 徐工集团 SCP009	企业债务融资工具	012381877. IB	400,000	100.0004	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
9	23 京东世贸 PPN001	企业债务融资工具	032380540. IB	500,000	100.0004	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
10	23 青岛华通 CP001	企业债务融资工具	042380308. IB	200,000	100.0007	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
11	23 中建七局 1ABN002 优先	资产支持证券	082380175. IB	262,000	100.0002	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

12	20 厦港务 MTN003	企业债务 融资工具	102001317. IB	400,000	100.0038	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
13	21 文广集 团 MTN001	企业债务 融资工具	102101449. IB	100,000	100.0242	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 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(元)	关联方名称
2023/6/30	建信资本稳盈 26 号单一资产管理计划	赎回	800000000	建信资本管理 有限责任公司
2023/6/30	建信基金惠众添添赢 47 号单一资产管理计划	申购	1000000000	建信基金管 理有限责任 公司
2023/6/29	建信基金安心宝 2 号集 合资产管理计划	申购	200000000	建信基金管 理有限责任 公司
2023/6/29	建信基金惠众添添赢 47 号单一资产管理计划	赎回	1000000000	建信基金管 理有限责任 公司
2023/6/28	建信基金惠众添添赢 47 号单一资产管理计划	赎回	400000000	建信基金管 理有限责任 公司
2023/6/27	建信基金惠众添添赢 47 号单一资产管理计划	赎回	400000000	建信基金管 理有限责任 公司
2023/6/26	建信基金惠众添添赢 47 号单一资产管理计划	赎回	1000000000	建信基金管 理有限责任 公司
2023/6/26	建信基金惠众称心回 报 10 号集合资产管理 计划	赎回	200010809.93	建信基金管 理有限责任 公司
2023/6/20	建信基金惠众添添赢 47 号单一资产管理计划	赎回	500000000	建信基金管 理有限责任 公司
2023/6/19	建信基金惠众称心回 报 10 号集合资产管理 计划	赎回	196982674.55	建信基金管 理有限责任 公司
2023/6/14	建信基金惠众添添赢 47 号单一资产管理计划	赎回	300000000	建信基金管 理有限责任 公司

2023/6/13	建信基金惠众添添赢47号单一资产管理计划	赎回	200000000	建信基金管理有限责任公司
2023/6/2	建信基金惠众添添赢47号单一资产管理计划	申购	700000000	建信基金管理有限责任公司
2023/5/31	建信基金惠众添添赢47号单一资产管理计划	赎回	700000000	建信基金管理有限责任公司
2023/5/30	建信基金惠众添添赢47号单一资产管理计划	赎回	1100000000	建信基金管理有限责任公司
2023/5/29	建信基金惠众添添赢47号单一资产管理计划	申购	1400000000	建信基金管理有限责任公司
2023/5/24	建信基金惠众添添赢47号单一资产管理计划	申购	150000000	建信基金管理有限责任公司
2023/5/23	建信基金惠众添添赢47号单一资产管理计划	申购	300000000	建信基金管理有限责任公司
2023/5/12	建信基金惠众添添赢47号单一资产管理计划	申购	2000000000	建信基金管理有限责任公司
2023/5/11	建信基金惠众添添赢47号单一资产管理计划	赎回	500000000	建信基金管理有限责任公司
2023/5/10	建信基金惠众添添赢47号单一资产管理计划	申购	1700000000	建信基金管理有限责任公司
2023/5/9	建信基金惠众添添赢47号单一资产管理计划	申购	2000000000	建信基金管理有限责任公司
2023/5/4	建信基金惠众称心回报10号集合资产管理计划	申购	700000000	建信基金管理有限责任公司
2023/5/4	建信基金安心宝2号集合资产管理计划	申购	600000000	建信基金管理有限责任公司
2023/4/28	建信资本稳盈26号单一资产管理计划	赎回	600000000	建信资本基金管理有限责任公司
2023/4/26	建信资本稳盈26号单一资产管理计划	申购	600000000	建信资本管理有限责任

				公司
2023/4/25	建信资本稳盈 26 号单一资产管理计划	申购	1000000000	建信资本管理有限责任公司
2023/4/24	建信资本稳盈 26 号单一资产管理计划	申购	3500000000	建信资本管理有限责任公司
2023/4/24	建信基金惠众称心回报 10 号集合资产管理计划	赎回	650044633.59	建信基金管理有限责任公司
2023/4/21	建信资本稳盈 26 号单一资产管理计划	申购	2000000000	建信资本管理有限责任公司
2023/4/20	建信资本稳盈 26 号单一资产管理计划	赎回	4000000000	建信资本管理有限责任公司
2023/4/17	建信资本稳盈 26 号单一资产管理计划	申购	4000000000	建信资本管理有限责任公司
2023/4/13	建信资本稳盈 26 号单一资产管理计划	申购	3000000000	建信资本管理有限责任公司

### (三) 其他重大关联交易

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	5,288.46	0.33%
2	普通个人	4,407.88	0.28%
3	普通个人	4,072.32	0.25%
4	普通个人	3,600.00	0.23%
5	普通个人	3,211.38	0.20%
6	普通个人	2,811.28	0.18%
7	普通个人	2,438.50	0.15%
8	普通个人	2,149.96	0.13%

9	普通个人	2,010.44	0.13%
10	普通个人	1,718.36	0.11%

## 十、投资非标准化债权及股权类资产清单（见附录一）

无

## 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06月30日

## 附录一

### 建信理财“建信宝1号”按日开放式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06月30日

我司依照监管要求，现对建信理财“建信宝1号”按日开放式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。