

建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 273 期（深圳专享）2023 年二季度暨半年投资管理报告

报告日：2023 年 06 月 30 日

建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 273 期（深圳专享）于 2022 年 05 月 06 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 714,613,959.36 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 1.020393。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)	1.020393	1.034393	714,613,959.36
一个月前	1.019599	1.031099	714,045,385.19
两个月前	1.021019	1.030019	715,027,274.32
三个月前	1.020076	1.026576	714,354,533.92
六个月前	1.003940	1.004940	703,154,961.76
一年前	1.003694	1.003694	704,990,045.94

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
建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 273 期（深圳专享）	2022-04-25	2022-05-05	2022-05-06	2025-05-06

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	499.79	0.70%	2,815.74	3.82%
同业存单	0.00	0.00%	5,446.15	7.39%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	3,175.48	4.31%
债券	0.00	0.00%	44,805.30	60.77%
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	10,960.24	15.43%	10,960.24	14.86%
权益类投资	0.00	0.00%	6,323.04	8.58%
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%	208.29	0.28%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	59,572.54	83.87%	0.00	0.00%
委托投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	71,032.58	100.00%	73,734.25	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	22 前海华宝 AB017	109,602,434.34	14.69%
2	R007	22,248,084.08	2.98%

3	22 中国银行永续债 02	17,289,788.41	2.32%
4	21 招商银行永续债	13,834,049.92	1.85%
5	23 中行永续债 01	11,112,396.79	1.49%
6	23 农业银行 CD087	10,966,750.36	1.47%
7	23 中信银行 CD054	10,950,677.01	1.47%
8	23 广发银行 CD075	10,950,677.01	1.47%
9	22 中国银行永续债 01	10,254,130.45	1.37%
10	21 建设银行二级 03	7,056,327.68	0.95%

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

本产品为封闭式产品，主要投资于标准化资产，资产流动性风险可控。

（二）市场情况

本产品采用固收增强投资策略，目标是在获取稳健收益的同时，分散单一资产下跌风险。回顾二季度，固收方面，经济基本面弱复苏，基本面数据转弱、降息等宽货币预期落地，是二季度债券走势偏强的主要原因；权益方面，宏观经济数据走弱，权益市场二季度走势分化，以结构性行情为主。展望下半年，经济稳增长政策预期加强，资金面流动性依然维持宽松基调，预期权益市场机会将增加。

（三）产品非标准化资产持仓风险

产品投资的非标准化资产未发生不良。

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	4425010000040003919	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	数量	净价	关联方名称	关联方角色
1	22 中国银行永续债 01	商业性金融债券	2228023. IB	100, 116	100. 4858	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
2	22 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2228011. IB	52, 060	99. 9615	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
3	22 中国银行二级 01	商业性金融债券	2228006. IB	35, 596	100. 5711	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
4	22 工商银行二级 01	商业性金融债券	2228004. IB	64, 867	100. 8247	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
5	22 浙银租赁货运物流主题债	商业性金融债券	2222004. IB	2, 224	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	21 工商银行二级 02	商业性金融债券	2128051. IB	2, 224	101. 0138	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
7	21 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2128038. IB	60, 069	100. 5399	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
8	20 工商银行二级 02	商业性金融债券	2028049. IB	4, 449	102. 8110	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

9	22 工商银行二级 03	商业性金融债券	2228024. IB	11, 124	101. 0028	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
10	23 中行永续债 01	商业性金融债券	242380008. IB	111, 240	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 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2228029. IB	169, 085	100. 5922	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
12	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	33, 372	100. 3616	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
13	19 工商银行永续债	商业性金融债券	1928018. IB	6, 674	101. 7981	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
14	21 工商银行永续债 01	商业性金融债券	2128021. IB	37, 821	101. 5918	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
15	21 临沂投资 MTN003	企业债务融资工具	102102176. IB	2, 224	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	22 晋能煤业 MTN013(科创票据)	企业债务融资工具	102281337. IB	24, 472	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 淄博城运 MTN003	企业债务融资工具	102103220. IB	24, 472	96. 3159	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
18	22 昆山国创 MTN007	企业债务融资工具	102282049. IB	22, 248	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	22 北部湾 MTN001	企业债务融资工具	102280032. IB	15, 573	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	22 曲文投 MTN001	企业债务融资工具	102281604. IB	28, 922	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
21	22 象屿 MTN001(科创票据)	企业债务融资工具	102281255. IB	44, 496	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 合肥产投 MTN001(科创票据)	企业债务融资工具	102281241. IB	37, 821	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	22 新庐陵 MTN001	企业债务融资工具	102281265. IB	31, 147	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	22 昆钢 MTN001	企业债务融资工具	102280779. IB	44,496	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	22 中建投资 MTN001 (绿色)	企业债务融资工具	102280709. IB	1,779	100.4816	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
26	22 渝兴永 MTN001	企业债务融资工具	102280163. IB	3,337	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	21 晋能电力 MTN015	企业债务融资工具	102103210. IB	31,147	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	21 渝高建投 MTN001	企业债务融资工具	102102220. IB	13,348	100.1898	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
29	21 淮安国投 MTN003	企业债务融资工具	102103248. IB	6,674	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 渝医药 MTN001	企业债务融资工具	102280164. IB	6,674	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 昆交产 SCP002	企业债务融资工具	012283632. IB	11,124	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	22 五菱 1 号 ABN001 优先 A	资产支持证券	082280989. IB	6,674	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
33	23 赣投 MTN001	企业债务融资工具	102381502. IB	11,124	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 长安汇通 PPN001	企业债务融资工具	032191358. IB	6,674	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 工商银行永续债 02	商业性金融债券	2128044. IB	11,124	100.1892	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
36	21 川能投 MTN002A	企业债务融资工具	102101520. IB	22,591	100.2123	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
37	22 云天化 MTN001	企业债务融资工具	102281519. IB	22,248	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	21 江门高新 MTN001	企业债务融资工具	102103204. IB	6,674	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

39	21 淄博城 资 MTN002	企业债务 融资工具	102103081. IB	40,046	95.8070	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
40	23 交通银 行小微债 01	商业性金 融债券	2328006. IB	15,404	100.1882	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
41	22 兴业银 行二级 01	商业性金 融债券	2228003. IB	15,404	99.8249	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
42	21 建设银 行二级 05	商业性金 融债券	2128049. IB	6,161	100.3469	中国建设银行 股份有限公司	债务主体
43	21 建设银 行二级 03	商业性金 融债券	2128033. IB	67,778	100.5610	中国建设银行 股份有限公司	债务主体
44	21 建设银 行二级 01	商业性金 融债券	2128025. IB	9,242	99.7281	中国建设银行 股份有限公司	债务主体
45	21 兴业银 行二级 01	商业性金 融债券	2128032. IB	18,485	101.4388	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
46	21 兴业银 行二级 02	商业性金 融债券	2128042. IB	15,404	100.7699	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
47	22 鲁宏桥 CP002	企业债务 融资工具	042280376. IB	9,242	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	21 兴业银 行二级 03	商业性金 融债券	2128043. IB	18,485	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	20 中建四 局 MTN001	企业债务 融资工具	102001942. IB	3,080	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	21 工商银 行二级 01	商业性金 融债券	2128002. IB	36,970	102.1997	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
51	21 川能投 MTN002B	企业债务 融资工具	102101521. IB	18,485	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	20 中建四 局 MTN002	企业债务 融资工具	102002093. IB	6,161	100.0000	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

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。

特此公告

建信理财有限责任公司

2023 年 06 月 30 日

附录一

建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 273 期（深圳专享）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，现对建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 273 期（深圳专享）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
收/受益权	深圳前海华宝供应链有限公司	22 前海华宝 AB017	458	详见风险分析

到期收益分配详见产品说明书。