

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年三季度投资管理报告

报告日：2023年09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10,402,482,628.79元。

一、报告期投资者实际收益率

截至2023年09月30日，产品单位净值为1.111383。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	1.111383	1.111383	10,402,482,628.79
一个月前	1.110800	1.110800	12,407,686,507.99
二个月前	1.107976	1.107976	11,640,051,701.42
三个月前	1.105842	1.105842	9,309,423,254.36
六个月前	1.097316	1.097316	7,456,403,873.77
一年前	1.087467	1.087467	11,510,937,555.31

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	64,995.68	6.25%	170,263.39	14.38%
同业存单	0.00	0.00%	126,032.30	10.64%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	0.00	0.00%
债券	68,126.95	6.55%	855,813.69	72.27%
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%	32,135.93	2.71%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	907,350.02	87.21%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	1,040,472.64	100.00%	1,184,245.31	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 中国银行小微债 01	363,407,016.39	3.03%
2	建信荣瑞一年定期开放债券	274,523,979.78	2.29%
3	23 证金 D70	260,875,523.23	2.18%
4	23 进出 02	252,131,215.85	2.10%

5	21 国开 18	246,992,021.92	2.06%
6	15 国开 10	209,373,934.43	1.75%
7	长兴 12A2	202,957,972.60	1.69%
8	23 中信银行 CD123	198,064,314.18	1.65%
9	23 兴业银行 CD149	197,252,518.03	1.65%
10	23 浦发银行 CD099	196,898,808.74	1.64%

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

报告期内，产品管理人通过合理安排资产配置结构，预留充足现金头寸，保持一定比例的高流动性资产，控制资产久期，管控产品流动性风险，对于关键时点的规模变动和资金面波动都有充足准备，且融资渠道畅通多元，产品流动性平稳运行。

（二） 产品的投资风险情况

截至本季度末，本理财产品主要投资于固定收益类资产。产品固定收益部分主要投资于银行存款、同业存单、利率债及短久期信用债等，整体风险可控、价格波动可控，组合总体净值平稳。

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 003361-0002	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 中国银行小微债 01	商业性金融债券	2228043. IB	3,600,000	100.4704	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
2	22 兴业银行 03	商业性金融债券	2228022. IB	700,000	100.7240	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
3	22 兴业银行 02	商业性金融债券	2228020. IB	1,000,000	100.7552	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
4	22 兴业银行 01	商业性金融债券	2228019. IB	300,000	100.8072	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
5	23 兴业银行绿债 01	商业性金融债券	222380003. IB	800,000	100.4165	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
6	22 上海能科 ABN001 优先 A	资产支持证券	082280795. IB	200,000	96.3400	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
7	23 中铁科创 ABN001 优先	资产支持证券	082380081. IB	100,000	101.0288	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
8	22 盛世融迪 5 优先_bc	资产支持证券	2289352. IB	1,000,000	44.5333	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
9	19 工商银行永续债	商业性金融债券	1928018. IB	1,500,000	101.4539	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
10	21 昆明轨道 MTN004 (绿色)	企业债务融资工具	102103149. IB	145,396	95.8808	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
11	22 江铜 MTN005	企业债务融资工具	102282504. IB	1,500,000	100.2875	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
12	22 山西清能 ABN001 优先	资产支持证券	082280800. IB	500,000	95.9722	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

13	22 上海能科 ABN001 优先 B	资产支持证券	082280796. IB	250,000	99.2617	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
14	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
15	21 昆明轨道交通 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
16	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
17	21 粤澳 ABN001 优先	资产支持证券	082180078. IB	133,392	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	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
19	20 飞驰建瓴 ABN001 优先	资产支持证券	082000628. IB	20,714	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
20	21 成都交子 ABN001 优先	资产支持证券	082180076. IB	118,279	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 粤澳 ABN001 优先	资产支持证券	082280418. IB	59,139	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 珠海华发 ABN001 优先	资产支持证券	082282014. IB	46,338	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	17 淄博资运 MTN002	企业债务融资工具	101754118. IB	164,277	105.6634	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
24	20 川交投 MTN001	企业债务融资工具	102002154. IB	164,277	101.8980	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
25	21 佛燃能源 MTN001	企业债务融资工具	102100007. IB	6,571	101.4446	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
26	21 江门高新 MTN001	企业债务融资工具	102103204. IB	32,855	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 苏州文旅 MTN002	企业债务融资工具	102280518. IB	6,571	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	23 招商蛇口 MTN001	企业债务融资工具	102382094. IB	131,421	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
29	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
30	18 泉州台商 MTN003	企业债务融资工具	101801142. IB	26,199	105.7367	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
31	21 淮矿上信 ABN001 优先	资产支持证券	082101481. IB	392,985	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
32	21 浙资运营 MTN001	企业债务融资工具	102100529. IB	44,375	101.9697	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
33	21 宝龙 MTN001	企业债务融资工具	102101036. IB	53,250	32.0096	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
34	21 成都益民 MTN001 (乡村振兴)	企业债务融资工具	102100514. IB	35,500	102.1171	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
35	21 陆金开 MTN001	企业债务融资工具	102100303. IB	88,751	100.6675	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
36	21 飞驰惟安 ABN001 优先 A1	资产支持证券	082100172. IB	35,500	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
37	建信荣瑞一年定开	债券基金	007830. OF	269,114,772	1.0000	建信基金管理有限公司	基金管理人
38	22 中国银行小微债 02	商业性金融债券	2228044. IB	200,000	100.4750	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
39	20 兴业银行小微债 04	商业性金融债券	2028021. IB	200,000	100.7818	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
40	22 兴业银行 04	商业性金融债券	2228045. IB	700,000	100.0192	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
41	20 兴业银行小微债 02	商业性金融债券	2028016. IB	200,000	100.2992	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
42	20 中交投资 ABN001 优先	资产支持证券	082001046. IB	13,996	101.7679	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

43	21 淮安国投 MTN003	企业债务融资工具	102103248. IB	262	98.6976	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
44	21 常德城投 MTN001	企业债务融资工具	102100309. IB	299	100.3968	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
45	22 中铁四局 ABN001 优先 (科创票据)	资产支持证券	082280776. IB	74	97.8627	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
46	19 建元 11A2_bc	资产支持证券	1989546. IB	13,443	28.4035	建信信托有限责任公司	计划管理人
47	19 建元 12A2_bc	资产支持证券	1989574. IB	13,443	19.8118	建信信托有限责任公司	计划管理人
48	21 中方财团 MTN001 (权益出资)	企业债务融资工具	102100797. IB	3,360	101.9175	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
49	21 江铜 GN001 (碳中和债)	企业债务融资工具	132100038. IB	470	101.8271	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
50	22 融信产融 ABN001 优先 B	资产支持证券	082280913. IB	7,394	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	21 成都产投 MTN001	企业债务融资工具	102100745. IB	2,016	102.0213	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
52	19 珠海港 MTN003	企业债务融资工具	101901427. IB	4,033	103.4524	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
53	19 沪城控 MTN001	企业债务融资工具	101900542. IB	20,165	103.2737	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
54	18 宿迁城投 MTN002	企业债务融资工具	101801311. IB	672	101.8739	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
55	20 建元 1A3_bc	资产支持证券	2089065. IB	6,721	66.0445	建信信托有限责任公司	计划管理人
56	22 欣荣 1 优先	资产支持证券	2289125. IB	35,155	13.6200	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
57	19 珠海港 MTN002	企业债务融资工具	101900992. IB	4,705	103.1271	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 09 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 09 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。