

建信理财“安鑫”（按日）现金管理类开放式净值型人民币理财产品 2023 年三季度投资管理报告

报告日：2023 年 09 月 30 日

建信理财“安鑫”（按日）现金管理类开放式净值型人民币理财产品于 2018 年 09 月 18 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 49,975,745,184.63 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 1.000000。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	1.000000	1.000000	49,975,745,184.63
一个月前	1.000000	1.000000	54,167,622,069.70
二个月前	1.000000	1.000000	55,152,794,203.47
三个月前	1.000000	1.000000	53,238,066,144.11
六个月前	1.000000	1.000000	61,569,599,782.66
一年前	1.130447	1.130447	125,228,122,019.65

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”（按日）现金管理类开放式净值型人民币理财产品	2018-09-11	2018-09-17	2018-09-18	-

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	568,406.68	11.37%	1,133,143.50	22.73%
同业存单	0.00	0.00%	2,833,762.74	56.84%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	340,818.06	6.84%
债券	0.00	0.00%	677,471.16	13.59%
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	4,431,550.31	88.63%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	4,999,957.00	100.00%	4,985,195.46	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	R014	3,408,180,552.24	6.82%
2	22 光大银行 CD182	849,205,750.96	1.70%
3	22 浦发银行 CD164	649,394,536.39	1.30%
4	23 中信银行 CD153	639,263,621.34	1.28%

5	23 光大银行 CD187	587,856,280.85	1.18%
6	22 中国银行 CD041	549,427,683.63	1.10%
7	23 邮储银行 CD040	499,661,672.63	1.00%
8	22 平安银行 CD125	499,477,713.99	1.00%
9	23 广发银行 CD152	496,722,960.58	0.99%
10	22 光大银行 CD185	399,582,087.24	0.80%

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，故产品流动性较好、风险较低。

（二）产品的投资风险情况

截至本报告期末，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。

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。

在报告期间内，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	4405018632010002329-0002	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	23 光大集团 SCP010	企业债务融资工具	012382854. IB	200,000	100.0005	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
2	22 宁波经开 CP002	企业债务融资工具	042280471. IB	300,000	100.0001	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
3	21 华电江苏 MTN001	企业债务融资工具	102101273. IB	700,000	100.5214	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
4	21 中节能 MTN002	企业债务融资工具	102101526. IB	300,000	100.5184	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
5	23 唐山实业 CP001	企业债务融资工具	042380538. IB	400,000	100.0006	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
6	19 首钢 MTN003	企业债务融资工具	101900488. IB	500,000	101.1377	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
7	23 津城建 SCP016	企业债务融资工具	012381163. 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
8	23 国药控股 SCP003	企业债务融资工具	012382746. IB	500,000	100.0002	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
9	23 华电江苏 SCP018	企业债务融资工具	012382847. IB	300,000	100.0001	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
10	18 闽高速 MTN004	企业债务融资工具	101801356. IB	300,000	100.2700	中国建设银行股份有限	主承销商或联席承销商

						公司	
11	20 陕高速 MTN001	企业债务 融资工具	102001978. IB	100,000	100.1063	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
12	20 冀交投 MTN002	企业债务 融资工具	102002031. IB	300,000	100.1198	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
13	20 赣铁投 MTN002	企业债务 融资工具	102002055. IB	500,000	100.1392	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
14	20 厦港务 MTN006	企业债务 融资工具	102002059. IB	800,000	100.1308	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
15	20 冀交投 MTN003	企业债务 融资工具	102002176. IB	600,000	100.2684	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
16	22 东部机 场 CP001	企业债务 融资工具	042280476. IB	1,900,000	100.0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
17	23 光大集 团 SCP011	企业债务 融资工具	012382867. IB	400,000	100.0003	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
18	23 华能水 电 SCP005	企业债务 融资工具	012382871. IB	300,000	100.0002	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
19	23 沪电力 SCP014	企业债务 融资工具	012382941. IB	500,000	100.0001	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
20	23 宁沪高 SCP020	企业债务 融资工具	012382965. IB	300,000	100.0002	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
21	23 华电江 苏 SCP019	企业债务 融资工具	012382968. IB	300,000	100.0004	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
22	23 徐工集 团 SCP016	企业债务 融资工具	012382982. IB	300,000	100.0002	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
23	23 鼓风机 SCP004	企业债务 融资工具	012383234. IB	500,000	100.0002	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
24	23 中车 SCP005	企业债务 融资工具	012383360. IB	600,000	100.0001	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
25	22 盛世融 迪 5 优先 _bc	资产支持 证券	2289352. IB	700,000	44.5146	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	份额	关联方名称
2023/9/19	建信保险资管安盈添利9号集合资产管理计划	赎回	779,149,705.80	779,149,705.80	建信保险管理有限责任公司
2023/8/16	建信保险资管安盈添利9号集合资产管理计划	申购	850,000,000.00	850,000,000.00	建信保险管理有限责任公司
2023/8/16	建信基金安心宝2号集合资产管理计划	赎回	98,446,442.29	98,446,442.29	建信基金管理有限责任公司
2023/9/27	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	赎回	470,000,000.00	470,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/9/25	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	申购	400,000,000.00	400,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/9/25	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	申购	400,000,000.00	400,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/9/21	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	申购	1,300,000,000.00	1,300,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/9/20	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	申购	1,450,000,000.00	1,450,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/9/19	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	申购	20,000,000.00	20,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/9/19	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	申购	1,200,000,000.00	1,200,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/9/13	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	申购	300,000,000.00	300,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/9/11	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	申购	800,000,000.00	800,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/9/8	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	申购	150,000,000.00	150,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/9/1	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	申购	700,000,000.00	700,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/8/31	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	赎回	550,000,000.00	537,278,539.04	建信基金管理有限责任公司
2023/8/30	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	赎回	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/8/25	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	赎回	500,000,000.00	488,522,372.05	建信基金管理有限责任公司
2023/8/24	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	申购	1,200,000,000.00	1,200,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/8/18	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	赎回	1,300,000,000.00	1,270,603,048.34	建信基金管理有限责任公司
2023/8/18	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	申购	400,000,000.00	400,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/8/17	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	赎回	300,000,000.00	293,231,490.00	建信基金管理有限责任公司
2023/8/17	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	赎回	300,000,000.00	-	建信基金管理有限责任公司
2023/8/15	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	申购	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/8/11	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	申购	1,200,000,000.00	1,200,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/8/8	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	赎回	200,000,000.00	195,603,475.45	建信基金管理有限责任公司
2023/8/4	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	申购	300,000,000.00	300,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/8/3	建信基金惠众添添赢15号单一资产管理计划	申购	1,500,000,000.00	1,500,000,000.00	建信基金管理有限责任公司

2023/8/2	建信基金惠众添添赢 15 号单一资产管理计划	申购	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/8/1	建信基金惠众添添赢 15 号单一资产管理计划	申购	1,700,000,000.00	1,700,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/8/29	建信基金惠众添添赢 46 号单一资产管理计划	赎回	1,656,000,000.00	1,656,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/8/28	建信基金惠众添添赢 46 号单一资产管理计划	赎回	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/8/28	建信基金惠众添添赢 46 号单一资产管理计划	赎回	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/8/16	建信基金惠众添添赢 46 号单一资产管理计划	赎回	1,150,000,000.00	1,149,000,197.48	建信基金管理有限责任公司
2023/8/15	建信基金惠众添添赢 46 号单一资产管理计划	赎回	1,000,000,000.00	993,946,359.76	建信基金管理有限责任公司
2023/8/10	建信基金惠众添添赢 46 号单一资产管理计划	申购	800,000,000.00	800,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/8/2	建信基金惠众添添赢 46 号单一资产管理计划	申购	900,000,000.00	900,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/8/1	建信基金惠众添添赢 46 号单一资产管理计划	申购	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/7/27	建信基金惠众添添赢 46 号单一资产管理计划	赎回	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/7/26	建信基金惠众添添赢 46 号单一资产管理计划	赎回	600,000,000.00	600,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/7/25	建信基金惠众添添赢 46 号单一资产管理计划	赎回	300,000,000.00	300,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/7/24	建信基金惠众添添赢 46 号单一资产管理计划	赎回	800,000,000.00	800,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/7/21	建信基金惠众添添赢 46 号单一资产管理计划	申购	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/7/19	建信基金惠众添添赢 46 号单一资产管理计划	赎回	500,000,000.00	500,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/7/10	建信基金惠众添添赢 46 号单一资产管理计划	申购	800,000,000.00	800,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/7/7	建信基金惠众添添赢 46 号单一资产管理计划	申购	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/9/28	建信基金稳赢宝 1 号单一资产管理计划	赎回	100,000,000.00	100,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/9/21	建信基金稳赢宝 1 号单一资产管理计划	赎回	306,500,000.00	306,500,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/9/20	建信基金稳赢宝 1 号单一资产管理计划	赎回	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/8/31	建信基金稳赢宝 1 号单一资产管理计划	申购	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/8/22	建信基金稳赢宝 1 号单一资产管理计划	赎回	150,000,000.00	144,787,644.79	建信基金管理有限责任公司
2023/8/8	建信基金稳赢宝 1 号单一资产管理计划	赎回	200,000,000.00	193,236,714.98	建信基金管理有限责任公司
2023/9/21	建信基金稳赢宝 6 号单一资产管理计划	赎回	3,000,000.00	3,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/9/20	建信基金稳赢宝 6 号单一资产管理计划	赎回	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/9/19	建信基金稳赢宝 6 号单一资产管理计划	赎回	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/8/30	建信基金稳赢宝 6 号单一资产管理计划	申购	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/8/30	建信基金稳赢宝 6 号单一资产管理计划	申购	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00	建信基金管理有限责任公司

2023/8/29	建信基金稳赢宝6号单一资产管理计划	申购	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00	建信基金管理有限责任公司
2023/9/28	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	申购	350,000,000.00	350,000,000.00	建信资本管理有限责任公司
2023/9/27	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	申购	1,200,000,000.00	1,200,000,000.00	建信资本管理有限责任公司
2023/9/26	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	申购	800,000,000.00	800,000,000.00	建信资本管理有限责任公司
2023/9/25	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	赎回	450,000,000.00	398,708,538.74	建信资本管理有限责任公司
2023/9/25	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	赎回	450,000,000.00	398,708,538.74	建信资本管理有限责任公司
2023/9/21	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	赎回	700,000,000.00	620,354,541.48	建信资本管理有限责任公司
2023/9/20	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	申购	150,000,000.00	150,000,000.00	建信资本管理有限责任公司
2023/9/15	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	赎回	350,000,000.00	310,282,037.51	建信资本管理有限责任公司
2023/9/13	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	赎回	500,000,000.00	443,309,964.99	建信资本管理有限责任公司
2023/9/11	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	赎回	400,000,000.00	354,688,853.64	建信资本管理有限责任公司
2023/9/8	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	赎回	150,000,000.00	133,030,614.78	建信资本管理有限责任公司
2023/9/7	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	申购	300,000,000.00	300,000,000.00	建信资本管理有限责任公司
2023/9/1	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	赎回	900,000,000.00	798,498,113.77	建信资本管理有限责任公司
2023/8/31	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	申购	1,070,000,000.00	1,070,000,000.00	建信资本管理有限责任公司
2023/8/30	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	申购	1,150,000,000.00	1,150,000,000.00	建信资本管理有限责任公司
2023/8/25	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	申购	300,000,000.00	300,000,000.00	建信资本管理有限责任公司
2023/8/24	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	赎回	1,400,000,000.00	1,169,297,586.24	建信资本管理有限责任公司
2023/8/18	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	申购	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00	建信资本管理有限责任公司
2023/8/3	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	赎回	1,300,000,000.00	1,155,309,089.62	建信资本管理有限责任公司
2023/8/2	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	赎回	2,000,000,000.00	1,777,501,277.58	建信资本管理有限责任公司
2023/8/1	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	赎回	2,000,000,000.00	1,777,602,387.68	建信资本管理有限责任公司
2023/7/31	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	申购	550,000,000.00	550,000,000.00	建信资本管理有限责任公司
2023/7/31	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	申购	550,000,000.00	550,000,000.00	建信资本管理有限责任公司
2023/7/27	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	申购	1,600,000,000.00	1,600,000,000.00	建信资本管理有限责任公司
2023/7/24	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	申购	100,000,000.00	100,000,000.00	建信资本管理有限责任公司
2023/7/21	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	赎回	200,000,000.00	200,000,000.00	建信资本管理有限责任公司
2023/7/19	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	申购	200,000,000.00	200,000,000.00	建信资本管理有限责任公司
2023/7/7	建信资本安鑫配置1号-安鑫按日	赎回	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00	建信资本管理有限责任公司

2023/9/27	建信资本稳盈 24 号单一资产管理计划	赎回	1,990,000,000.00	1,951,240,729.76	建信资本管理有限责任公司
2023/9/26	建信资本稳盈 24 号单一资产管理计划	赎回	1,600,000,000.00	1,568,992,210.90	建信资本管理有限责任公司
2023/8/17	建信资本稳盈 24 号单一资产管理计划	申购	500,000,000.00	500,000,000.00	建信资本管理有限责任公司
2023/8/10	建信资本稳盈 24 号单一资产管理计划	赎回	800,000,000.00	788,085,712.32	建信资本管理有限责任公司
2023/8/2	建信资本稳盈 24 号单一资产管理计划	赎回	20,000,000.00	19,717,837.16	建信资本管理有限责任公司
2023/7/11	建信资本稳盈 24 号单一资产管理计划	赎回	500,000,000.00	500,000,000.00	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	其他	15,703.02	0.31%
2	非金融机构企业法人	12,323.00	0.25%
3	普通个人	12,230.40	0.24%
4	其他	10,346.78	0.21%
5	其他	9,870.16	0.20%
6	其他	9,193.47	0.18%
7	普通个人	9,151.04	0.18%
8	其他	9,106.12	0.18%
9	非金融机构企业法人	8,674.73	0.17%
10	其他	8,256.57	0.17%

十、投资非标准化债权及股权类资产清单（见附录一）

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09月30日

附录一

建信理财“安鑫”（按日）现金管理类开放式净值型人民币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09月30日

我司依照监管要求，现对建信理财“安鑫”（按日）现金管理类开放式净值型人民币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。