

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 年三季度投资管理报告

报告日：2023 年 09 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 20,638,903,516.61 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 1.162260。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	1.162260	1.162260	20,638,903,516.61
一个月前	1.161759	1.161759	21,633,088,179.08
两个月前	1.157912	1.157912	20,434,540,707.46
三个月前	1.154976	1.154976	20,000,116,605.54
六个月前	1.144593	1.144593	23,452,038,500.76
一年前	1.144550	1.144550	33,829,498,359.79

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	272,925.25	13.22%	464,168.75	22.69%
同业存单	0.00	0.00%	19,524.00	0.95%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	107,495.05	5.26%
债券	0.00	0.00%	1,382,191.94	67.58%
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%	71,899.43	3.52%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	1,791,551.66	86.78%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	2,064,476.91	100.00%	2,045,279.17	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.04%

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	1,073,688,238.72	5.19%
2	22 农行二级资本债 02A	656,411,114.75	3.17%
3	21 农发 02	613,486,557.38	2.97%
4	22 中行二级资本债 02A	357,396,027.40	1.73%

5	18 宜昌绿色债 NPB	316,746,164.38	1.53%
6	19 中国银行永续债 01	310,981,643.84	1.50%
7	21 中国信达债 01	303,759,016.39	1.47%
8	21 甘公投 MTN003	303,384,344.26	1.47%
9	21 威海城投 MTN002	292,311,997.27	1.41%
10	23 中行永续债 01	261,497,557.38	1.26%

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	44050186320100002329-0003	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 三明交建 MTN001 (革命老区)	企业债务融资工具	102101807. IB	26,474	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
2	21 海尔金控 MTN002	企业债务融资工具	102101780. IB	1,376,541	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
3	20 新海连 PPN003	企业债务融资工具	032000898. IB	66,186	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
4	22 淮北建投 MTN003	企业债务融资工具	102281419. IB	26,474	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
5	21 光穗华能 ABN001 优先	资产支持证券	082100470. IB	211,796	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
6	21 飞驰惟安 ABN001 优先 A1	资产支持证券	082100172. IB	132,372	100.0000	建信信托有限责任公司, 中国建设银行股份有限公司, 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, 承销团成员
7	21 甘国投 MTN002	企业债务融资工具	102101785. IB	1,138,270	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员

8	21 南京新港 PPN002	企业债务融资工具	032100481. IB	132,372	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
9	21 太仓科教 PPN001	企业债务融资工具	032100370. IB	226,474	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
10	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
11	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
12	21 莆田国资 PPN001	企业债务融资工具	032100070. IB	400,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
13	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
14	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
15	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
16	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
17	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, 中国建设银行股	主承销商或联席承销商, 承销团成员

						份有限公司	
18	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
19	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
20	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
21	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
22	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
23	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
24	21 淮安国投 MTN002	企业债务融资工具	102101239. IB	600,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
25	23 中行永续债 01	商业性金融债券	242380008. IB	2,600,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
26	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
27	20 中国银行永续债	商业性金融债券	2028048. IB	16,182	103.0761	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销

	02					公司, 中国建设银行股份有限公司	商, 承销团成员
28	20 农业银行永续债 02	商业性金融债券	2028032. IB	16, 182	102. 7408	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
29	21 福瑞能源 GN004 (碳中和债)	企业债务融资工具	132100133. IB	6, 472	100. 7189	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
30	21 重庆轨交 GN002	企业债务融资工具	132100017. IB	16, 182	102. 0202	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
31	23 华电股 MTN005	企业债务融资工具	102381170. IB	16, 182	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
32	22 河钢集 MTN007	企业债务融资工具	102281026. IB	19, 418	99. 6683	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
33	22 华为 MTN003	企业债务融资工具	102280392. IB	39, 775	100. 2910	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
34	22 鞍山钢铁 MTN001 (可持续挂钩)	企业债务融资工具	102280209. IB	12, 945	100. 2440	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
35	19 中煤能源 MTN001	企业债务融资工具	101900980. IB	6, 472	101. 7202	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
36	22 龙岩汇金 MTN002	企业债务融资工具	102281685. IB	6, 472	100. 0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
37	21 烟台港 MTN003	企业债务融资工具	102102214. IB	6, 472	100. 9858	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
38	21 川能投 MTN002B	企业债务融资工具	102101521. IB	3, 236	100. 6213	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销

						公司, 中国建设银行股份有限公司	商, 承销团成员
39	21 蜀道投资 MTN006	企业债务融资工具	102103103. IB	16, 182	100. 4644	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
40	21 江西交投 MTN005	企业债务融资工具	102101337. IB	22, 655	100. 5329	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
41	21 华电云南 MTN001	企业债务融资工具	102101941. IB	73, 078	101. 4458	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
42	19 陕有色 MTN003	企业债务融资工具	101901273. IB	16, 182	101. 9704	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
43	18 鲁钢铁 MTN008	企业债务融资工具	101801567. IB	3, 236	102. 4695	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
44	21 鲁高速 MTN003	企业债务融资工具	102100997. IB	25, 891	100. 5939	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
45	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	58, 256	101. 0698	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
46	21 常熟发投 PPN001	企业债务融资工具	032100115. IB	3, 236	100. 9339	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
47	22 徐工集团 MTN001	企业债务融资工具	102280040. IB	16, 182	100. 7326	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
48	21 常熟交通 PPN005	企业债务融资工具	032100657. IB	9, 709	100. 1004	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
49	22 昆山国创 MTN002	企业债务融资工具	102280447. IB	9, 709	100. 2304	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股	主承销商或联席承销商, 承销团成员

						份有限公司	
50	21 国药现代 MTN001	企业债务融资工具	102103367. IB	32,364	100.7702	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
51	21 渝富 MTN003	企业债务融资工具	102100285. IB	3,236	101.2158	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
52	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
53	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
54	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
55	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
56	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
57	21 麓山投资 MTN001	企业债务融资工具	102100335. IB	400,000	101.7186	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
58	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
59	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员

60	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, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或 联席承销 商, 承销团 成员
61	22 浙江旅 投 MTN002	企业债务 融资工具	102281640. IB	136,048	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
62	22 乌高新 MTN002	企业债务 融资工具	102281994. IB	45,349	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或 联席承销 商, 承销团 成员
63	23 苏新国 资 MTN001	企业债务 融资工具	102380238. IB	181,397	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或 联席承销 商, 承销团 成员
64	21 达州投 资 PPN001 (革 命老区)	企业债务 融资工具	032191462. IB	226,747	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或 联席承销 商, 承销团 成员
65	22 渝医药 MTN001	企业债务 融资工具	102280164. IB	136,048	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或 联席承销 商, 承销团 成员
66	23 连云城 建 PPN001	企业债务 融资工具	032380031. IB	136,048	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或 联席承销 商, 承销团 成员
67	22 苏州文 旅 MTN002	企业债务 融资工具	102280518. IB	90,698	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或 联席承销 商, 承销团 成员
68	22 泉州台 商 MTN002	企业债务 融资工具	102280528. IB	181,397	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或 联席承销 商, 承销团 成员
69	21 建发 MTN002	企业债务 融资工具	102103276. IB	725,590	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或 联席承销 商, 承销团 成员

70	22 新都香城 MTN001	企业债务融资工具	102280341. IB	90,698	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
71	22 金合盛 MTN003 (科创票据)	企业债务融资工具	102281243. IB	136,048	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
72	22 威宁投资 MTN001	企业债务融资工具	102280258. IB	90,698	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
73	22 洛阳城乡 MTN001	企业债务融资工具	102282164. IB	45,349	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
74	22 晋能煤业 PPN006	企业债务融资工具	032280247. IB	272,096	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
75	22 淮北建投 MTN004	企业债务融资工具	102281832. IB	45,349	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
76	19 工商银行永续债	商业性金融债券	1928018. IB	705,615	101.8607	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
77	20 常德城投 MTN003	企业债务融资工具	102002333. IB	30,026	101.3928	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
78	19 娄城高新 MTN002	企业债务融资工具	101900108. IB	15,013	102.8424	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
79	20 汾湖投资 MTN001	企业债务融资工具	102002118. IB	30,026	100.7172	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股	主承销商或联席承销商, 承销团成员

						份有限公司	
80	22 吴江交 投 PPN001	企业债务 融资工具	032281094. IB	30,026	100.0000	中国建设银行 股份有限公司, 中国 建设银行股份 有限公司	主承销商或 联席承销 商, 承销团 成员
81	18 宿迁城 投 MTN002	企业债务 融资工具	101801311. IB	30,026	101.7263	中国建设银行 股份有限公司, 中国 建设银行股份 有限公司	主承销商或 联席承销 商, 承销团 成员
82	19 娄城高 新 MTN001	企业债务 融资工具	101900041. IB	45,039	102.5639	中国建设银行 股份有限公司, 中国 建设银行股份 有限公司	主承销商或 联席承销 商, 承销团 成员
83	22 宁波经 开 CP002	企业债务 融资工具	042280471. IB	45,039	99.2403	中国建设银行 股份有限公司, 中国 建设银行股份 有限公司	主承销商或 联席承销 商, 承销团 成员
84	22 京汽股 GN002(科 创票据)	企业债务 融资工具	132280096. IB	35,483	99.0350	中国建设银 行股份有限 公司	承销团成员
85	23 厦门火 炬 SCP001	企业债务 融资工具	012382737. IB	245,901	99.8061	中国建设银 行股份有限 公司, 中国 建设银行股份 有限公司	主承销商或 联席承销 商, 承销团 成员
86	23 武进经 发 SCP007	企业债务 融资工具	012383216. IB	327,868	99.7751	中国建设银 行股份有限 公司	承销团成员
87	22 交子金 融 GN001	企业债务 融资工具	132280043. IB	33,302	100.7771	中国建设银 行股份有限 公司, 中国 建设银行股份 有限公司	主承销商或 联席承销 商, 承销团 成员
88	22 南通产 业 MTN002	企业债务 融资工具	102281931. IB	99,908	100.2318	建信信托有 限责任公司	承销团成员
89	22 泉州水 务 MTN002	企业债务 融资工具	102280794. IB	66,605	100.3839	中国建设银 行股份有限 公司, 中国 建设银行股份 有限公司	主承销商或 联席承销 商, 承销团 成员
90	22 恒泰 MTN001	企业债务 融资工具	102280001. IB	66,605	101.0099	中国建设银 行股份有限 公司, 中国 建设银行股	主承销商或 联席承销 商, 承销团 成员

						份有限公司	
91	20 湘投 MTN001B	企业债务融资工具	102000609. IB	66,605	101.5312	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
92	22 苏州农业 MTN001	企业债务融资工具	102280821. IB	99,908	100.9024	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员

（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 09 月 30 日