

建信理财嘉鑫固收类按日开放式产品 2023 年三季度投资管理报告

报告日：2023 年 09 月 30 日

建信理财嘉鑫固收类按日开放式产品于 2022 年 04 月 07 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 49,958,727,829.85 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 1.033322。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	1.033322	1.033322	49,958,727,829.85
一个月前	1.031561	1.031561	56,031,954,677.63
二个月前	1.029689	1.029689	55,120,256,656.11
三个月前	1.027688	1.027688	48,186,129,561.97
六个月前	1.022053	1.022053	63,332,923,160.99
一年前	1.011668	1.011668	12,919,349,557.89

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
建信理财嘉鑫固收类按日开放式产品	2022-03-30	2022-04-06	2022-04-07	-

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北京市分行

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	550,651.03	11.02%	2,796,445.54	56.91%
同业存单	0.00	0.00%	319,920.12	6.51%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	403,869.53	8.22%
债券	0.00	0.00%	1,300,170.50	26.46%
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%	93,510.44	1.90%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	4,446,183.87	88.98%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	4,996,834.90	100.00%	4,913,916.13	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	23 证金 D150	2,011,367,671.20	4.08%
2	23 证金 D70	1,637,879,135.25	3.32%
3	R011	1,426,345,933.29	2.89%
4	GC007	1,035,377,344.78	2.10%

5	23 证金 D68	1,023,529,802.51	2.07%
6	23 证金 D122	814,752,504.20	1.65%
7	23 证金 D121	814,716,133.35	1.65%
8	23 证金 D120	814,679,762.42	1.65%
9	23 证金 D132	813,174,006.64	1.65%
10	23 证金 D136	811,222,541.96	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

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

1. 托管资产保管

托管资产独立于管理人的自有资产及管理其他资产，独立于中国建设银行的自有资产及其托管的其他资产，不同投资账户之间的托管资产之间互相独立。

我行按照国家相关规定，完整保存与托管资产有关的会计档案、与托管资产有关的投资记录、指令和所有合同等。

2. 会计核算和估值

我行与资产管理人按照约定的统一记账方法和会计处理原则，

独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值。按各自职责对托管资产会计核算的真实性、准确性、及时性和完整性负责。

3. 定期核对有关数据

我行与资产管理人按照合同约定定期进行账务核对并互相监督。

4. 投资监督

建设银行根据法规、托管协议以及双方制定的《投资监督事项表》，对贵司的资产管理产品的投资行为进行监督。

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	11050167500009112233	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北京市分行

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	20 秀湖集团 MTN001	企业债务融资工具	102000708. IB	80,456	99.8247	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
2	建信荣瑞一年定开	债券基金	007830. OF	53,752,246	1.0000	建信基金管理有限责任公司	基金管理人
3	19 沪城控 MTN001	企业债务融资工具	101900542. IB	1,455,566	103.1771	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
4	23 湖南钢铁 SCP004	企业债务融资工具	012382628. IB	1,500,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
5	22 红狮 CP001	企业债务融资工具	042280477. IB	700,000	99.8683	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	是否关联交易	证券代码	关联方名称
2023/7/4	建信资本稳盈 13 号单一资产管理计划	申购	1,000,000.00	1,000,000.00	是	JXZBWY13H	建信资本管理有限责任公司
2023/7/10	建信资本稳盈 44 号单一资产管理计划	赎回	990,000.00	990,000.00	是	JXZBWY44H	建信资本管理有限责任公司
2023/7/10	建信资本稳盈 13 号单一资产管理计划	申购	1,000,000.00	1,000,000.00	是	JXZBWY13H	建信资本管理有限责任公司
2023/7/12	建信保险资管安盈添利 1 号	赎回	449,533,968.14	449,533,968.14	是	JXBXZGAYTL1H	建信保险资产管理有限公司
2023/7/14	建信信托凤鸣尊享日日盈 11 号集合信托计划	赎回	484,887,981.18	484,887,981.18	是	JXXTFMZRRY11H	建信信托有限责任公司
2023/7/17	建信信托凤鸣尊享日日盈 6 号集合信托计划	赎回	1,941,562,841.59	1,941,562,841.59	是	JXXTFMZRRY6H	建信信托有限责任公司
2023/7/17	建信资本惠众配置 5 号集合资产管理计划	申购	500,000.00	500,000.00	是	JXZBHZPZ5H	建信资本管理有限责任公司

202 3/7 /17	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	申购	2,000, 000,00 0.00	2,000, 000,00 0.00	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/7 /18	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	申购	800,00 0,000. 00	800,00 0,000. 00	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/7 /19	建信信托凤鸣尊享 日日盈 6 号集合信 托计划	赎回	1,941, 370,60 7.65	1,941, 370,60 7.65	是	JXXTFM ZXRRY6 H	建信信托有 限责任公司
202 3/7 /19	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	申购	500,00 0,000. 00	500,00 0,000. 00	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/7 /19	建信保险资管安鑫 8 号资产管理产品	申购	1,000, 000,00 0.00	1,000, 000,00 0.00	是	JXBXZG AX8H	建信保险资 产管理有限 公司
202 3/7 /20	建信信托凤鸣尊享 日日盈 11 号集合信 托计划	赎回	67,865 ,165.4 9	67,865 ,165.4 9	是	JXXTFM ZXRRY1 1H	建信信托有 限责任公司
202 3/7 /27	建信信托凤鸣尊享 日日盈 6 号集合信 托计划	申购	2,000, 000,00 0.00	2,000, 000,00 0.00	是	JXXTFM ZXRRY6 H	建信信托有 限责任公司
202 3/7 /27	建信保险资管安鑫 8 号资产管理产品	申购	1,000, 000,00 0.00	1,000, 000,00 0.00	是	JXBXZG AX8H	建信保险资 产管理有限 公司

202 3/7 /28	建信信托凤鸣尊享 日日盈 6 号集合信 托计划	申购	1,500, 000,00 0.00	1,500, 000,00 0.00	是	JXXTFM ZXRRY6 H	建信信托有 限责任公司
202 3/7 /28	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	赎回	1,000, 000,00 0.00	1,000, 000,00 0.00	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/8 /1	建信信托凤鸣尊享 日日盈 6 号集合信 托计划	赎回	1,940, 131,42 4.50	1,940, 131,42 4.50	是	JXXTFM ZXRRY6 H	建信信托有 限责任公司
202 3/8 /1	建信保险资管安盈 添利 9 号集合资产 管理计划	申购	500,00 0,000. 00	500,00 0,000. 00	是	JXBXZG AYTL9H	建信保险资 产管理有限 公司
202 3/8 /1	建信资本惠众配置 5 号集合资产管理 计划	申购	500,00 0,000. 00	500,00 0,000. 00	是	JXZBHZ PZ5H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/8 /1	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	申购	2,000, 000,00 0.00	2,000, 000,00 0.00	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/8 /2	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	申购	600,00 0,000. 00	600,00 0,000. 00	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/8 /2	建信信托凤鸣尊享 日日盈 6 号集合信 托计划	赎回	970,01 7,722. 22	970,01 7,722. 22	是	JXXTFM ZXRRY6 H	建信信托有 限责任公司

202 3/8 /3	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	申购	500,00 0,000. 00	500,00 0,000. 00	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/8 /4	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	申购	300,00 0,000. 00	300,00 0,000. 00	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/8 /10	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	申购	1,000, 000,00 0.00	1,000, 000,00 0.00	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/8 /14	建信资本惠众配置 5 号集合资产管理 计划	申购	300,00 0,000. 00	300,00 0,000. 00	是	JXZBHZ PZ5H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/8 /17	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	申购	500,00 0,000. 00	500,00 0,000. 00	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/8 /23	建信保险资管安盈 添利 9 号集合资产 管理计划	申购	300,00 0,000. 00	300,00 0,000. 00	是	JXBXZG AYTL9H	建信保险资 产管理有限 公司
202 3/8 /28	建信信托凤鸣尊享 日日盈 6 号集合信 托计划	申购	2,000, 000,00 0.00	2,000, 000,00 0.00	是	JXXTFM ZXRRY6 H	建信信托有 限责任公司
202 3/8 /28	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	赎回	2,000, 000,00 0.00	2,000, 000,00 0.00	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司

202 3/8 /29	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	赎回	2,000, 000,00 0.00	2,000, 000,00 0.00	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/8 /29	建信信托凤鸣尊享 日日盈 6 号集合信 托计划	申购	1,800, 000,00 0.00	1,800, 000,00 0.00	是	JXXTFM ZXRRY6 H	建信信托有 限责任公司
202 3/8 /30	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	赎回	2,000, 000,00 0.00	2,000, 000,00 0.00	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/8 /30	建信信托凤鸣尊享 日日盈 6 号集合信 托计划	申购	2,000, 000,00 0.00	2,000, 000,00 0.00	是	JXXTFM ZXRRY6 H	建信信托有 限责任公司
202 3/8 /31	建信信托凤鸣尊享 日日盈 13 号集合信 托计划	赎回	243,44 1,444. 06	243,44 1,444. 06	是	JXXTFM ZXRRY1 3H	建信信托有 限责任公司
202 3/8 /31	建信信托凤鸣尊享 日日盈 6 号集合信 托计划	申购	1,200, 000,00 0.00	1,200, 000,00 0.00	是	JXXTFM ZXRRY6 H	建信信托有 限责任公司
202 3/8 /31	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	赎回	1,820, 000,00 0.00	1,800, 383,84 5.79	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/9 /1	建信信托凤鸣尊享 日日盈 6 号集合信 托计划	赎回	1,937, 102,28 8.69	1,937, 102,28 8.69	是	JXXTFM ZXRRY6 H	建信信托有 限责任公司

202 3/9 /4	建信信托凤鸣尊享 日日盈 6 号集合信 托计划	赎回	1,936, 807,77 2.80	1,936, 807,77 2.80	是	JXXTFM ZXRRY6 H	建信信托有 限责任公司
202 3/9 /4	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	申购	2,000, 000,00 0.00	2,000, 000,00 0.00	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/9 /5	建信信托凤鸣尊享 日日盈 13 号集合信 托计划	申购	2,000, 000,00 0.00	2,000, 000,00 0.00	是	JXXTFM ZXRRY1 3H	建信信托有 限责任公司
202 3/9 /5	建信信托凤鸣尊享 日日盈 6 号集合信 托计划	赎回	1,936, 710,24 5.88	1,936, 710,24 5.88	是	JXXTFM ZXRRY6 H	建信信托有 限责任公司
202 3/9 /6	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	申购	500,00 0,000. 00	500,00 0,000. 00	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/9 /8	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	申购	800,00 0,000. 00	800,00 0,000. 00	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/9 /12	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	赎回	1,500, 000,00 0.00	1,500, 000,00 0.00	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/9 /13	建信信托凤鸣尊享 日日盈 6 号集合信 托计划	赎回	1,597, 141,02 0.78	1,597, 141,02 0.78	是	JXXTFM ZXRRY6 H	建信信托有 限责任公司

202 3/9 /25	建信资本惠众配置 5 号集合资产管理 计划	赎回	1,784, 794, 44 3.74	1,784, 794, 44 3.74	是	JXZBHZ PZ5H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/9 /27	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	赎回	1,000, 000, 00 0.00	1,000, 000, 00 0.00	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司
202 3/9 /27	建信信托凤鸣尊享 日日盈 13 号集合信 托计划	赎回	1,702, 000, 19 0.62	1,702, 000, 19 0.62	是	JXXTFM ZXRRY1 3H	建信信托有 限责任公司
202 3/9 /28	建信资本稳盈 13 号 单一资产管理计划	赎回	1,950, 000, 00 0.00	1,950, 000, 00 0.00	是	JXZBWY 13H	建信资本管 理有限责任 公司

（三）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

建信理财嘉鑫固收类按日开放式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，现对建信理财嘉鑫固收类按日开放式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。