

建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 125 期 2023 年
三季度投资管理报告

报告日：2023 年 09 月 30 日

建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 125 期于 2022 年 10 月 11 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 140,090,045.69 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 1.015324。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	1.015324	1.015324	140,090,045.69
一个月前	1.016633	1.016633	140,270,655.49
两个月前	1.016603	1.016603	140,266,530.94
三个月前	1.014159	1.014159	139,929,420.75
六个月前	1.005496	1.005496	138,734,095.05
一年前	-	-	-

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 125 期	2022-09-28	2022-10-10	2022-10-11	2024-11-26

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	484.14	3.45%	1,573.49	11.39%
同业存单	0.00	0.00%	2,346.46	16.99%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	738.16	5.35%
债券	0.00	0.00%	8,263.15	59.84%
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%	258.18	1.87%
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%	10.03	0.07%
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%	619.97	4.49%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	13,530.59	96.55%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	14,014.73	100.00%	13,809.46	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	6,100,254.51	4.35%
2	23 工商银行 CD028	2,804,511.95	2.00%
3	19 工商银行永续债	2,446,520.16	1.75%
4	22 中国信达债 01	2,410,188.48	1.72%

5	23 浦发银行 CD017	2,120,327.29	1.51%
6	23 浦发银行 CD028	2,118,946.76	1.51%
7	19 农业银行永续债 01	1,986,046.13	1.42%
8	21 中国银行永续债 01	1,832,752.73	1.31%
9	21 长城资本债 01BC	1,815,602.55	1.30%
10	22 济宁城投 MTN003	1,800,564.97	1.28%

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。回顾三季度，债券市场低位窄幅震荡，其中短期限品种上行幅度大于长端，曲线走平，同期限国债收益率上行多于信用债，信用利差继续压缩；权益方面，政策持续发力，地产和活跃资本市场一揽子政策陆续推出，市场定价从政策预期转向经济修复程度。展望四季度，稳增长政策有望托底经济基本面，权益市场积极因素在逐渐积累；地产周期、地方债务等因素制约利率上行空间。

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和其他资产，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	11050137510000008737	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	数量	净价	关联方名称	关联方角色
1	22 津城建 CP033	企业债务融资工具	042280492. IB	5,667	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
2	22 淮北建投 MTN005	企业债务融资工具	102282251. IB	1,416	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
3	22 贵州高速 MTN003	企业债务融资工具	102282360. IB	8,298	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	23 绍兴滨海 MTN001	企业债务融资工具	102380120. IB	1,416	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	23 兴业银行绿色金融债 02	商业性金融债券	2328018. IB	6,091	100.1427	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 中国银行永续债 01	商业性金融债券	2128019. IB	17,621	102.3022	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
7	23 长沙银行债 01	商业性金融债券	212380009. IB	406	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	22 中国银行二级 01	商业性金融债券	2228006. IB	2,436	100.2388	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	22 工商银行二级 01	商业性金融债券	2228004. IB	4,060	100.3380	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	23 光大银行绿债 01	商业性金融债券	222380004. IB	4,873	100.1922	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	23 光大银行债 01	商业性金融债券	212380005. IB	4,467	100.2061	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	20 中国银行永续债 03	商业性金融债券	2028053. IB	4,060	103.8649	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	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	10,558	100.3770	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	
14	22 农行永续债 02	商业性金融债券	092280086. IB	10,508	99.1300	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	19 工商银行永续债	商业性金融债券	1928018. IB	23,959	101.7374	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	21 鲁黄金 MTN011	企业债务融资工具	102102281. IB	4,060	100.7406	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
17	21 长安汇通 PPN001	企业债务融资工具	032191358. IB	4,060	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
18	23 交通银行小微债 01	商业性金融债券	2328006. IB	4,060	100.5894	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	22 河钢集 MTN001	企业债务融资工具	102280101. IB	2,436	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
20	21 新长宁 MTN003	企业债务融资工具	102103048. IB	4,060	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
21	23 汇金 MTN003	企业债务融资工具	102381224. IB	8,934	99.8297	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
22	22 飞驰林语 ABN001 优先	资产支持证券	082280315. IB	6,050	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
23	22 云南交投 MTN001	企业债务融资工具	102280415. IB	9,340	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	23 江西交投 MTN004	企业债务融资工具	102381806. IB	1,624	100.0000	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
25	23 赣投 MTN001	企业债务融资工具	102381502. IB	2, 030	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	21 昆明轨道 MTN001	企业债务融资工具	102101052. IB	4, 060	102. 1700	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	23 汇金 MTN002	企业债务融资工具	102380981. IB	406	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
28	21 河钢集 MTN007	企业债务融资工具	102103181. IB	1, 624	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
29	21 皖农垦 MTN001	企业债务融资工具	102101976. IB	4, 060	100. 9302	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 苏豪 MTN001	企业债务融资工具	102100394. IB	4, 060	102. 1295	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
31	21 淄博城运 MTN003	企业债务融资工具	102103220. IB	4, 100	95. 9475	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
32	21 川能投 MTN002B	企业债务融资工具	102101521. IB	6, 091	101. 2730	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
33	21 长发集团 MTN002	企业债务融资工具	102101977. IB	2, 030	100. 9574	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	21 中建投资 MTN002	企业债务融资工具	102103346. IB	2, 030	100. 0000	中国建设银行股份有限公司, 中国	主承销商或联席承销商, 承销团

						建设银行股份有限公司	成员
35	21 华电山能 ABN001 优先	资产支持证券	082180086. IB	954	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
36	21 晋能电力 MTN015	企业债务融资工具	102103210. IB	6,091	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 中国信达债 01	商业性金融债券	092100008. IB	6,903	99.9144	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 闽国资 MTN001	企业债务融资工具	102102247. IB	2,030	99.4239	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
39	22 淄博城运 MTN002	企业债务融资工具	102280291. IB	3,654	95.5325	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
40	23 兴业银行绿债 01	商业性金融债券	222380003. IB	6,497	100.4740	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 建发 MTN001	企业债务融资工具	102101832. IB	12,182	101.3505	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
42	21 赣投 MTN001	企业债务融资工具	102101632. IB	6,091	100.5436	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
43	22 中国信达债 01	商业性金融债券	092280003. IB	23,447	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
44	21 厦国贸控 MTN006	企业债务融资工具	102101666. IB	4,060	100.4576	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
45	21 华发集团 MTN005	企业债务融资工具	102100898. IB	812	99.8008	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
46	23 中铁科创 ABN001 优先	资产支持证券	082380081. IB	406	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
47	21 长城资本债 01BC	商业性金融债券	092100012. IB	17,834	100.8533	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
48	21 山西建投 ABN002 优先	资产支持证券	082101489. IB	7,187	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
49	21 华发集团 MTN009	企业债务融资工具	102101775. IB	6,091	100.7593	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
50	22 苏豪 MTN001	企业债务融资工具	102282108. IB	1,455	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
51	22 津城建 MTN011	企业债务融资工具	102281818. IB	1,698	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
52	19 鹰潭投资 MTN001	企业债务融资工具	101900330. IB	1,941	99.5448	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	23 津城建 SCP003	企业债务融资工具	012380348. IB	8,250	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	23 吴中国太 SCP001	企业债务融资工具	012380670. IB	485	100.0000	中国建设银行股份有限公司, 中国	主承销商或联席承销商, 承销团

						建设银行股份有限公司	成员
55	22 五凌 1 号 ABN001 优先 A	资产支持证券	082280989. IB	485	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	20 汾湖投资 MTN001	企业债务融资工具	102002118. IB	970	100.6645	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	23 达州投资 CP001	企业债务融资工具	042380045. IB	2,911	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
58	22 义乌国资 CP001	企业债务融资工具	042280525. IB	485	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
59	23 泉州金控 SCP001	企业债务融资工具	012380158. IB	1,213	100.0889	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
60	22 滁州城投 CP001	企业债务融资工具	042280461. IB	727	99.3703	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
61	22 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2228029. IB	2,108	98.1979	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
62	22 中国银行永续债 01	商业性金融债券	2228023. IB	755	98.1413	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	22 河南农开 MTN002	企业债务融资工具	102280477. IB	198	98.8964	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 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2128038. IB	596	98.9775	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	21 工商银行永续债 02	商业性金融债券	2128044. IB	994	98.5697	中国建设银行股份有限公司, 中国	主承销商或联席承销商, 承销团

						建设银行股份有限公司	成员
66	22 河钢集 MTN005	企业债务 融资工具	102280608. IB	198	97.4311	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 新疆新 能 GN001	企业债务 融资工具	132280026. IB	198	99.1694	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 农业银 行永续债 01	商业性金 融债券	2228011. IB	2,764	97.5692	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	22 威宁投 资 MTN001	企业债务 融资工具	102280258. IB	517	98.2996	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	21 中国银 行永续债 02	商业性金 融债券	2128045. IB	2,227	98.5286	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 北部湾 MTN001	企业债务 融资工具	102280032. IB	278	100.0774	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 产融 2 号 ABN001 优先 B	资产支持 证券	082282031. IB	127	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 珠海华 发 ABN001 优先	资产支持 证券	082282014. IB	238	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	21 江门高 新 MTN001	企业债务 融资工具	102103204. IB	198	98.8997	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	20 甘国投 MTN003	企业债务 融资工具	102000764. IB	397	97.7836	中国建设银行股份有限	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
76	22 工行二级资本债 03A	商业性金融债券	092280065. IB	238	96. 5302	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	21 淄博城资 MTN002	企业债务融资工具	102103081. IB	517	97. 1669	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 09 月 30 日

附录一

建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 125 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，现对建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 125 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。