

# 建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 273 期（深圳专享）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 273 期（深圳专享）于 2022 年 05 月 06 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 702,993,382.59 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 1.011000。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	1.011000	1.032500	702,993,382.59
一个月前	1.016252	1.035252	706,645,225.50
二个月前	1.021688	1.038188	715,533,832.44
三个月前	1.020393	1.034393	714,613,959.36
六个月前	1.020076	1.026576	714,354,533.92
一年前	1.012025	1.012025	708,817,251.91

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 273 期（深圳专享）	2022-04-25	2022-05-05	2022-05-06	2025-05-06

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	134.55	0.19%	2,410.06	3.29%
同业存单	0.00	0.00%	8,621.79	11.78%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	672.72	0.92%
债券	0.00	0.00%	43,712.76	59.75%
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	10,959.75	15.72%	10,959.75	14.98%
权益类投资	0.00	0.00%	6,367.89	8.70%
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%	417.46	0.57%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	58,635.22	84.09%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	69,729.53	100.00%	73,162.43	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 前海华宝 AB017	109,597,537.22	14.79%
2	22 中国银行永续债 02	11,302,755.02	1.52%
3	23 农业银行 CD087	10,470,489.45	1.41%

4	23 广发银行 CD075	10,454,818.93	1.41%
5	20 农业银行永续债 01	10,372,024.08	1.40%
6	21 工商银行永续债 01	10,078,630.26	1.36%
7	21 农业银行永续债 01	7,765,792.06	1.05%
8	22 工商银行二级 01	7,645,255.15	1.03%
9	R014	6,339,053.25	0.86%
10	23 中信银行 CD186	6,238,294.73	0.84%

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。

### （三）产品非标准化资产持仓风险

产品投资的非标准化资产未发生不良。

## 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	4425010000040003919	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	数量	净价	关联方名称	关联方角色
1	23 农行永续债 01	商业性金融债券	242380017. IB	61, 277	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 中国银行永续债 01	商业性金融债券	2228023. IB	52, 825	100. 4858	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 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2228011. IB	38, 879	99. 9615	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 中国银行二级 01	商业性金融债券	2228006. IB	52, 825	100. 6981	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	22 工商银行二级 01	商业性金融债券	2228004. IB	74, 309	100. 8247	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 工商银行永续债 02	商业性金融债券	2128044. IB	6, 339	100. 7452	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	
7	21 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2128038. IB	73, 955	100. 8878	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	20 中国银行永续债 03	商业性金融债券	2028053. IB	12, 678	103. 9549	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	20 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2028048. IB	25, 356	103. 5268	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 赣投 MTN001	企业债务融资工具	102381502. IB	10, 565	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
11	20 农业银行永续债 02	商业性金融债券	2028032. IB	35, 921	103. 3436	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	23 中行永续债 01	商业性金融债券	242380008. IB	40, 147	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	22 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2228029. IB	109, 876	100. 5922	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	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	101, 424	100. 9648	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	8, 452	101. 7969	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	22 农行永续债 02	商业性金融债券	092280086. IB	6, 339	100. 1476	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
17	21 工商银行永续债01	商业性金融债券	2128021. IB	97, 198	102. 4309	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	21 临沂投资 MTN003	企业债务融资工具	102102176. IB	2, 113	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	22 晋能煤业 MTN013 (科创票据)	企业债务融资工具	102281337. IB	23, 243	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	22 昆山国创 MTN007	企业债务融资工具	102282049. IB	21, 130	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
21	22 渝医药 MTN001	企业债务融资工具	102280164. IB	6, 339	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
22	22 象屿 MTN001 (科创票据)	企业债务融资工具	102281255. IB	42, 260	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 淄博城运 MTN003	企业债务融资工具	102103220. IB	23, 243	96. 3159	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 渝高建投 MTN001	企业债务融资工具	102102220. IB	12, 678	100. 1898	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	22 新庐陵 MTN001	企业债务融资工具	102281265. IB	29, 582	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 昆钢 MTN001	企业债务融资工具	102280779. IB	42,260	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
27	22 中建投资 MTN001 (绿色)	企业债务融资工具	102280709. IB	1,690	100.4816	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 淄博城资 MTN002	企业债务融资工具	102103081. IB	38,034	95.8070	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 中国银行永续债 01	商业性金融债券	2128019. IB	14,791	102.8035	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	22 北部湾 MTN001	企业债务融资工具	102280032. IB	14,791	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
31	21 晋能电力 MTN015	企业债务融资工具	102103210. IB	29,582	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
32	21 江门高新 MTN001	企业债务融资工具	102103204. IB	6,339	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
33	22 云天化 MTN001	企业债务融资工具	102281519. IB	21,130	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
34	22 合肥产投 MTN001 (科创票据)	企业债务融资工具	102281241. IB	35,921	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
35	22 河钢集 MTN001	企业债务融资工具	102280101. IB	4,226	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员

36	21 淮安国投 MTN003	企业债务融资工具	102103248. IB	6, 339	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	22 五凌 1 号 ABN001 优先 A	资产支持证券	082280989. IB	6, 339	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
38	21 长安汇通 PPN001	企业债务融资工具	032191358. IB	6, 339	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
39	23 交通银行小微债 01	商业性金融债券	2328006. IB	18, 599	100. 1882	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	22 兴业银行二级 01	商业性金融债券	2228003. IB	18, 599	99. 8249	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 兴业银行二级 03	商业性金融债券	2128043. IB	22, 319	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
42	21 工商银行二级 01	商业性金融债券	2128002. IB	44, 639	102. 1997	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	23 新疆发电 MTN001 (绿色)	企业债务融资工具	102382488. IB	9, 299	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	23 华侨城 MTN005A	企业债务融资工具	102381926. IB	7, 439	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
45	20 核风电 GN001	企业债务融资工具	132000034. IB	7, 439	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
46	21 川能投 MTN002B	企业债务融资工具	102101521. IB	22, 319	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
47	21 江西交投 MTN004	企业债务融资工具	102101129. IB	48,359	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
48	20 中建四局 MTN001	企业债务融资工具	102001942. IB	3,719	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 兴业银行二级 01	商业性金融债券	2128032. IB	22,319	101.4388	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	21 兴业银行二级 02	商业性金融债券	2128042. IB	18,599	100.7699	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	20 中建四局 MTN002	企业债务融资工具	102002093. IB	7,439	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	20 中粮置业 MTN001	企业债务融资工具	102002105. IB	22,319	100.0000	中国建设银行股份有限公司	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 273 期（深圳专享）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 273 期（深圳专享）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
收/受益权	深圳前海华宝供应链有限公司	22 前海华宝 AB017	366	详见风险分析

到期收益分配详见产品说明书。