

建信理财“恒赢”（法人版）按日开放式净值型人民币理财产品 2024 年一季度投资管理报告

报告日：2024 年 03 月 31 日

建信理财“恒赢”（法人版）按日开放式净值型人民币理财产品于 2020 年 06 月 11 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 27,848,412,704.92 元。

一、报告期投资者实际收益率

截至 2024 年 03 月 31 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	27,848,412,704.92
一个月前	1.000000	1.000000	32,061,682,754.91
二个月前	1.000000	1.000000	30,910,217,902.95
三个月前	1.000000	1.000000	32,559,676,401.22
六个月前	1.000000	1.000000	31,680,900,378.99
一年前	1.000000	1.000000	34,594,242,829.42

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“恒赢”（法人版）按日开放式净值型人民币理财产品	2020-05-27	2020-06-10	2020-06-11	-

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	338,090.05	12.14%	580,548.90	20.86%
同业存单	0.00	0.00%	1,884,935.90	67.73%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	121,881.65	4.38%
债券	0.00	0.00%	195,497.50	7.03%
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	2,447,499.63	87.86%	0.00	0.00%
委托投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	2,785,589.69	100.00%	2,782,863.95	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	GC007	611,396,182.19	2.20%
2	23 农业银行 CD179	495,997,747.86	1.78%
3	24 交通银行 CD121	492,095,658.46	1.77%
4	23 华夏银行 CD163	447,451,772.09	1.61%

5	23 中信银行 CD182	446,109,635.68	1.60%
6	GC014	427,597,454.79	1.54%
7	24 交通银行 CD110	398,288,306.64	1.43%
8	24 光大银行 CD047	395,878,740.09	1.42%
9	24 交通银行 CD106	393,948,720.46	1.41%
10	23 中信银行 CD153	348,127,912.30	1.25%

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，故产品的流动性较好、风险较低。

（二）产品的投资风险情况

1. 产品债券持仓风险及价格波动情况

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。

2. 产品股票持仓风险及价格波动情况

产品无股票持仓。

3. 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

产品无衍生品持仓。

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	4405018632010003438-0002	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 淮南矿 SCP004	企业债务融资工具	012384488. IB	1,000,000	100.0001	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	23 苏州高新 SCP049	企业债务融资工具	012384520. IB	400,000	100.0001	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	24 苏城投 SCP002	企业债务融资工具	012480120. IB	300,000	100.0003	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	24 华电江苏 SCP001	企业债务融资工具	012480502. IB	500,000	100.0001	中国建设银行股份有限公司, 中国	主承销商或联席承销商, 承销团成员

						建设银行股份有限公司	成员
5	24 南航集 SCP001	企业债务融资工具	012480637. IB	500,000	100.0002	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	24 苏交通 SCP005	企业债务融资工具	012480677. IB	400,000	100.0001	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	24 浙交投 SCP005	企业债务融资工具	012480739. IB	1,000,000	100.0001	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	24 江苏铁路 SCP001	企业债务融资工具	012480783. IB	500,000	100.0002	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	24 中粮 SCP003	企业债务融资工具	012480803. IB	200,000	100.0007	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	24 江西交投 SCP002	企业债务融资工具	012480810. IB	900,000	100.0001	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	24 国联 SCP002	企业债务融资工具	012480816. IB	400,000	100.0003	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	24 巨石 SCP003	企业债务融资工具	012480915. IB	400,000	100.0003	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	24 苏沙钢 SCP001(科创票据)	企业债务融资工具	012480947. IB	500,000	100.0003	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	24 厦翔业 SCP001	企业债务融资工具	012481129. IB	700,000	100.0002	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
15	24 国联 SCP003	企业债务 融资工具	012481141. IB	400, 000	100. 0004	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	24 南电 CP002	企业债务 融资工具	042480161. 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
17	22 长城金 融债 01BC	商业性金 融债券	092280007. IB	1, 000, 000	100. 7653	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) 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 (元)	份额	关联方名称
2024-03- 29	建信信托凤鸣尊享日 日盈 6 号集合信托计 划	申购	800000000	800000000	建信信托有限责任公 司
2024-03- 29	建信信托凤鸣尊享日 日盈 15 号集合信托 计划	申购	500000000	500000000	建信信托有限责任公 司
2024-03- 29	建信资本安鑫私享 4 号单一资产管理计划	赎回	250000000	250000000	建信资本管理有限责 任公司
2024-03- 28	建信基金惠众添添赢 17 号单一资产管理计 划	赎回	1533000000	1533000000	建信基金管理有限责 任公司
2024-03- 28	建信资本安鑫私享 4 号单一资产管理计划	赎回	1283000000	1283000000	建信资本管理有限责 任公司
2024-03- 27	建信基金惠众添添赢 17 号单一资产管理计 划	赎回	600000000	600000000	建信基金管理有限责 任公司
2024-03- 27	建信资本安鑫私享 4 号单一资产管理计划	赎回	899999999. 99	822718384. 58	建信资本管理有限责 任公司
2024-03- 26	建信基金惠众添添赢 17 号单一资产管理计 划	赎回	850000000	850000000	建信基金管理有限责 任公司
2024-03- 26	建信资本稳盈 11 号 单一资产管理计划	赎回	106000000	106000000	建信资本管理有限责 任公司
2024-03- 25	建信资本安鑫私享 4 号单一资产管理计划	赎回	2000000000	2000000000	建信资本管理有限责 任公司
2024-03-	建信基金惠众添添赢	申购	1000000000	1000000000	建信基金管理有限责

22	17号单一资产管理计划				任公司
2024-03-21	建信基金惠众添添赢17号单一资产管理计划	赎回	350000000	350000000	建信基金管理有限责任公司
2024-03-20	建信资本安鑫私享4号单一资产管理计划	申购	1400000000	1400000000	建信资本管理有限责任公司
2024-03-18	建信基金惠众添添赢17号单一资产管理计划	申购	800000000	800000000	建信基金管理有限责任公司
2024-03-15	建信信托日日通宝4号单一资金信托计划	赎回	57930000	57930000	建信信托有限责任公司
2024-03-14	建信基金安心宝2号集合资产管理计划	赎回	392900000	392900000	建信基金管理有限责任公司
2024-03-12	建信基金惠众添添赢17号单一资产管理计划	申购	1000000000	1000000000	建信基金管理有限责任公司
2024-03-12	建信资本安鑫私享4号单一资产管理计划	赎回	800000000	800000000	建信资本管理有限责任公司
2024-03-12	建信资本稳盈11号单一资产管理计划	赎回	400000000	400000000	建信资本管理有限责任公司
2024-03-08	建信基金惠众添添赢17号单一资产管理计划	申购	300000000	300000000	建信基金管理有限责任公司
2024-03-07	建信基金惠众添添赢17号单一资产管理计划	申购	500000000	500000000	建信基金管理有限责任公司
2024-03-05	建信基金惠众添添赢17号单一资产管理计划	申购	500000000	500000000	建信基金管理有限责任公司
2024-03-05	建信资本安鑫私享4号单一资产管理计划	申购	700000000	700000000	建信资本管理有限责任公司
2024-03-04	建信基金惠众添添赢17号单一资产管理计划	申购	700000000	700000000	建信基金管理有限责任公司
2024-03-01	建信资本安鑫私享4号单一资产管理计划	申购	100000000	100000000	建信资本管理有限责任公司
2024-03-01	建信基金惠众添添赢17号单一资产管理计划	申购	1200000000	1200000000	建信基金管理有限责任公司
2024-02-29	建信资本安鑫私享4号单一资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-02-28	建信信托日日通宝4号单一资金信托计划	赎回	500000000	500000000	建信信托有限责任公司
2024-02-28	建信基金惠众添添赢17号单一资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信基金管理有限责任公司
2024-02-	建信资本稳盈11号	赎回	500000000	500000000	建信资本管理有限责

28	单一资产管理计划				任公司
2024-02-28	建信资本安鑫私享4号单一资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-02-26	建信基金惠众添添赢17号单一资产管理计划	申购	500000000	500000000	建信基金管理有限责任公司
2024-02-26	建信基金安心宝2号集合资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信基金管理有限责任公司
2024-02-23	建信资本稳盈11号单一资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-02-22	建信资本安鑫私享4号单一资产管理计划	申购	500000000	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-02-20	建信基金惠众添添赢17号单一资产管理计划	申购	500000000	500000000	建信基金管理有限责任公司
2024-02-08	建信资本稳盈11号单一资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-02-08	建信基金惠众添添赢17号单一资产管理计划	申购	500000000	500000000	建信基金管理有限责任公司
2024-02-07	建信基金惠众添添赢17号单一资产管理计划	申购	500000000	500000000	建信基金管理有限责任公司
2024-02-07	建信资本安鑫私享4号单一资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-02-05	建信基金惠众添添赢17号单一资产管理计划	申购	500000000	500000000	建信基金管理有限责任公司
2024-02-02	建信信托凤鸣尊享日日盈6号集合信托计划	赎回	500000000	500000000	建信信托有限责任公司
2024-02-01	建信资本稳盈11号单一资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-02-01	建信基金惠众添添赢17号单一资产管理计划	申购	500000000	500000000	建信基金管理有限责任公司
2024-02-01	建信信托凤鸣尊享日日盈6号集合信托计划	赎回	500000000	500000000	建信信托有限责任公司
2024-01-31	建信信托凤鸣尊享日日盈6号集合信托计划	申购	500000000	500000000	建信信托有限责任公司
2024-01-31	建信基金惠众添添赢17号单一资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信基金管理有限责任公司
2024-01-30	建信资本稳盈11号单一资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-01-	建信资本安鑫私享4	赎回	500000000	500000000	建信资本管理有限责

30	号单一资产管理计划				任公司
2024-01-26	建信资本安鑫私享4号单一资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-01-26	建信资本稳盈11号单一资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-01-25	建信资本稳盈11号单一资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-01-24	建信基金安心宝2号集合资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信基金管理有限责任公司
2024-01-24	建信资本稳盈11号单一资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-01-22	建信资本稳盈11号单一资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-01-19	建信基金惠众添添赢17号单一资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信基金管理有限责任公司
2024-01-18	建信基金安心宝2号集合资产管理计划	申购	500000000	500000000	建信基金管理有限责任公司
2024-01-18	建信资本安鑫私享4号单一资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-01-16	建信资本安鑫私享4号单一资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-01-12	建信资本安鑫私享4号单一资产管理计划	赎回	500000000	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-01-08	建信基金安心宝2号集合资产管理计划	申购	500000000	500000000	建信基金管理有限责任公司

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	51,280.59	1.84%
2	其他	36,575.72	1.31%
3	非金融机构企业法人	35,159.40	1.26%
4	其他境内金融机构	30,798.56	1.11%
5	其他	28,797.94	1.03%
6	其他	25,121.35	0.90%
7	其他	24,578.25	0.88%
8	非金融机构企业法人	20,082.11	0.72%
9	非金融机构企业法人	18,134.37	0.65%

10	非金融机构企业法人	17,358.24	0.62%
----	-----------	-----------	-------

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

2024年03月31日

附录一

建信理财“恒赢”（法人版）按日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：2024年03月31日

我司依照监管要求，现对建信理财“恒赢”（法人版）按日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。