

# 建信理财建信宝按日开放式净值型理财产品第 11 期 2024 年一季度投资管理报告

报告日：2024 年 03 月 31 日

建信理财建信宝按日开放式净值型理财产品第 11 期于 2023 年 11 月 15 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 6,702,113,892.14 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	6,702,113,892.14
一个月前	1.000000	1.000000	10,219,613,523.33
两个月前	1.000000	1.000000	12,683,872,256.86
三个月前	1.000000	1.000000	18,826,301,113.60
六个月前	-	-	-
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
建信理财建信宝按日开放式净值型理财产品第 11 期	2023-11-14	2023-11-14	2023-11-15	-

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上海市分行

### 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	165,294.21	24.66%	171,259.38	25.66%
同业存单	0.00	0.00%	327,040.85	49.00%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	49,947.71	7.48%
债券	0.00	0.00%	119,132.21	17.85%
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	505,099.70	75.34%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	670,393.91	100.00%	667,380.16	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	254,733,219.50	3.81%
2	活期稳存	233,818,502.82	3.49%
3	24 上海银行 CD042	199,869,015.87	2.99%
4	24 广发银行 CD013	198,611,436.21	2.97%

5	24 北京银行 CD017	197,272,592.03	2.95%
6	24 北京银行 CD020	197,218,362.15	2.95%
7	24 北京银行 CD021	197,205,333.32	2.95%
8	活期稳存	179,860,386.78	2.69%
9	23 津城建 MTN003	177,692,484.86	2.66%
10	GC014	169,822,146.34	2.54%

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存款、高流动性信用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。本产品在本季度期间流动性指标符合监管相关规定，未出现流动性问题。

### （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，债券组合整体票息尚可，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。本产品所投资资产于本季度未发生违约等重大风险事件。

## 六、托管人报告

托管人在执行本理财产品的托管过程中，根据银监会的要求，严格遵守有关法律和保管合同的约定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何违背保管合同的行为。托管人未发现管理人有违背理财产品说明书约定的行为。

## 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	31050136360000 009646	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上海市分行

## 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	24 川水电 SCP001	企业债务 融资工具	012480873. IB	500,000	100.0133	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	20 麓山投 资 MTN001B	企业债务 融资工具	102000725. IB	200,000	101.9228	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	21 巨化 MTN002	企业债务 融资工具	102101263. IB	100,000	100.3297	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 津城建 MTN007	企业债务 融资工具	102281362. IB	800,000	100.6537	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)	关联方名称
2024-03-29	建信资本稳盈 56 号单一 资产管理计划	赎回	350000000	建信资本管理有限责任公司
2024-03-26	建信资本稳盈 56 号单一 资产管理计划	赎回	360000000	建信资本管理有限责任公司
2024-03-26	建信基金安心宝 2 号集 合资产管理计划	赎回	984065986.7	建信基金管理有限责任公司
2024-03-20	建信资本稳盈 56 号单一 资产管理计划	赎回	100000000	建信资本管理有限责任公司
2024-03-18	建信基金安心宝 2 号集 合资产管理计划	赎回	300019296.61	建信基金管理有限责任公司

2024-03-13	建信资本稳盈 56 号单一资产管理计划	申购	300000000	建信资本管理有限责任公司
2024-03-12	建信资本稳盈 56 号单一资产管理计划	赎回	200000000	建信资本管理有限责任公司
2024-03-08	建信资本稳盈 56 号单一资产管理计划	申购	1000000000	建信资本管理有限责任公司
2024-03-06	建信资本稳盈 56 号单一资产管理计划	赎回	100000000	建信资本管理有限责任公司
2024-03-05	建信资本稳盈 56 号单一资产管理计划	赎回	100000000	建信资本管理有限责任公司
2024-03-01	建信资本稳盈 56 号单一资产管理计划	申购	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-02-29	建信资本稳盈 56 号单一资产管理计划	赎回	6000000	建信资本管理有限责任公司
2024-02-28	建信资本稳盈 56 号单一资产管理计划	赎回	980000000	建信资本管理有限责任公司
2024-02-26	建信资本稳盈 56 号单一资产管理计划	申购	1800000000	建信资本管理有限责任公司
2024-02-07	建信资本稳盈 56 号单一资产管理计划	申购	20000000	建信资本管理有限责任公司
2024-01-26	建信资本稳盈 56 号单一资产管理计划	赎回	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-01-16	建信资本稳盈 56 号单一资产管理计划	申购	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-01-11	建信基金安心宝 2 号集合资产管理计划	申购	1800000000	建信基金管理有限责任公司

### （三）其他关联交易

无

### 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	普通个人	4,029.24	0.60%
2	普通个人	2,915.46	0.44%
3	普通个人	2,295.33	0.34%
4	普通个人	1,912.77	0.29%
5	普通个人	1,710.80	0.26%
6	普通个人	1,369.17	0.20%

7	普通个人	1,206.27	0.18%
8	普通个人	1,114.97	0.17%
9	普通个人	1,106.92	0.17%
10	普通个人	1,106.92	0.17%

## 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

#### 建信理财建信宝按日开放式净值型理财产品第11期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，现对建信理财建信宝按日开放式净值型理财产品第11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。