

建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 273 期（深圳专享）2024 年一季度投资管理报告

报告日：2024 年 03 月 31 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 700,260,746.76 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 1.007070。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	1.007070	1.041070	700,260,746.76
一个月前	1.006667	1.039167	699,980,201.53
二个月前	1.001678	1.033178	696,511,264.35
三个月前	1.009887	1.038887	702,219,185.56
六个月前	1.011000	1.032500	702,993,382.59
一年前	1.020076	1.026576	714,354,533.92

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	168.37	0.24%	277.22	0.37%
同业存单	0.00	0.00%	5,360.23	7.09%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	0.00	0.00%
债券	0.00	0.00%	57,618.03	76.23%
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	10,983.41	15.88%	10,983.41	14.53%
权益类投资	0.00	0.00%	804.99	1.07%
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%	539.76	0.71%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	58,008.32	83.88%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	69,160.10	100.00%	75,583.65	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	109,834,086.39	14.34%
2	23 付息国债 19	20,544,951.97	2.68%
3	22 国开 05	18,072,640.11	2.36%
4	21 工商银行永续债 01	16,309,429.70	2.13%

5	20 农业银行永续债 01	14,283,050.26	1.86%
6	20 邮储银行永续债	13,273,942.28	1.73%
7	21 农业银行永续债 01	10,942,107.87	1.43%
8	22 农业银行永续债 01	10,655,074.24	1.39%
9	23 邮储永续债 01	10,543,656.09	1.38%
10	20 农业银行永续债 02	10,417,809.34	1.36%

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

一季度经济延续复苏，2月CPI为0.7%，出口数据同比超预期，3月制造业PMI重回荣枯线以上，非制造业PMI也继续回升，显示出经济基本面的企稳修复。债市1月和2月利率显著下行，进入3月份后开始震荡。股指市场经历了一场深V型走势，在一系列稳增长政策、资本市场政策的支撑下触底反弹。一季度沪深300指数上涨3.1%，万得全A下跌2.85%，创业板指数下跌3.87%。展望二季度，虽然一季度的出口和PMI数据超预期，但地产投资的持续低迷和房企资金链紧张的局面未得到有效缓解，这可能会对市场情绪产生一定的压制，需要进一步跟踪宏观数据情况进行判断。

（三）产品非标准化资产持仓风险

受行业周期变化影响，产品投资的非标准化资产融资人及担保人所属集团出现流动性困难。管理人持续关注，积极采取应对措施，并将继续勤勉尽职，切实保障理财资金投资权益。

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	24 农行永续债 01	商业性金融债券	242400005. IB	100,730	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	24 邮储永续债 01	商业性金融债券	242400004. IB	100,730	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	23 招行永续债 01	商业性金融债券	242380033. IB	20,146	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 邮储永续债 01	商业性金融债券	242380019. IB	100,730	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 农行永续债 01	商业性金融债券	242380017. IB	58,423	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

6	22 中国银行永续债 01	商业性金融债券	2228023. IB	50,365	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
7	22 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2228011. IB	103,551	101.6531	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	20,146	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
9	22 工商银行二级 01	商业性金融债券	2228004. IB	53,406	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
10	21 工商银行永续债 02	商业性金融债券	2128044. IB	6,043	100.7452	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	21 兴业银行二级 02	商业性金融债券	2128042. IB	34,438	102.5266	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	21 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2128038. IB	104,760	101.2537	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 中国银行永续债 03	商业性金融债券	2028053. IB	12,087	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
14	23 中行永续债 01	商业性金融债券	242380008. IB	38,277	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
15	22 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2228029. IB	64,467	100.5922	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	
16	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	136, 993	100. 8866	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	21 工商银行永续债 01	商业性金融债券	2128021. IB	153, 110	102. 7042	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, 014	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	22, 160	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	20 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2028048. IB	24, 175	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
21	24 南昌建投 MTN001	企业债务融资工具	102480813. IB	20, 146	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	23 赣投 MTN001	企业债务融资工具	102381502. IB	10, 073	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	20 农业银行永续债 02	商业性金融债券	2028032. IB	98, 716	103. 0126	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	24 厦国贸控 MTN004	企业债务融资工具	102481133. IB	20, 146	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

25	24 三一 MTN001(科 创票据)	企业债务 融资工具	102480799. IB	34, 248	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	23 太平人 寿永续债 01	商业性金 融债券	282380005. IB	20, 146	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	24 云能投 MTN002	企业债务 融资工具	102480131. IB	12, 087	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	24 苏州农 业 MTN001	企业债务 融资工具	102480287. IB	7, 051	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
29	21 长安汇 通 PPN001	企业债务 融资工具	032191358. IB	6, 043	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
30	22 昆山国 创 MTN007	企业债务 融资工具	102282049. IB	20, 146	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	24 南昌轨 交 MTN001(绿 色)	企业债务 融资工具	102480235. IB	4, 029	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 兴业银 行二级 01	商业性金 融债券	2128032. IB	61, 730	103. 0139	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	23 淮南矿 SCP004	企业债务 融资工具	012384488. IB	4, 029	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 象屿 MTN001(科 创票据)	企业债务 融资工具	102281255. IB	40, 292	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 成员

						建设银行股份有限公司	
35	21 渝高建投 MTN001	企业债务融资工具	102102220. IB	12, 087	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
36	24 南京旅游 MTN001 (资产担保)	企业债务融资工具	102481250. IB	14, 102	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 淄博城运 MTN003	企业债务融资工具	102103220. IB	14, 102	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
38	22 新庐陵 MTN001	企业债务融资工具	102281265. IB	28, 204	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	22 昆钢 MTN001	企业债务融资工具	102280779. IB	40, 292	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
40	22 中建投资 MTN001 (绿色)	企业债务融资工具	102280709. IB	1, 611	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
41	22 农行永续债 02	商业性金融债券	092280086. IB	6, 043	100. 1476	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 淄博城资 MTN002	企业债务融资工具	102103081. IB	36, 263	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
43	21 中国银行永续债 01	商业性金融债券	2128019. IB	14, 102	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
44	22 北部湾 MTN001	企业债务融资工具	102280032. IB	14, 102	100. 0000	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
45	21 晋能电力 MTN015	企业债务融资工具	102103210. IB	28, 204	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
46	24 西安高新 MTN002	企业债务融资工具	102480325. IB	10, 073	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 江门高新 MTN001	企业债务融资工具	102103204. IB	6, 043	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
48	22 云天化 MTN001	企业债务融资工具	102281519. IB	20, 146	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	22 合肥产投 MTN001 (科创票据)	企业债务融资工具	102281241. IB	34, 248	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
50	21 淮安国投 MTN003	企业债务融资工具	102103248. IB	6, 043	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	23 南昌建投 MTN008	企业债务融资工具	102383334. IB	8, 058	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	24 天津轨交 SCP003	企业债务融资工具	012480458. IB	4, 029	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
53	22 河钢集 MTN001	企业债务融资工具	102280101. IB	4, 029	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
54	22 五凌 1 号 ABN001 优先 A	资产支持证券	082280989. IB	6, 043	95. 4545	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

55	24 天津港 MTN001(科 创票据)	企业债务 融资工具	102480047. IB	10, 073	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	23 云能投 MTN005	企业债务 融资工具	102383266. IB	12, 087	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
57	19 工商银 行永续债	商业性金 融债券	1928018. IB	88, 643	100. 9083	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	23 交通银 行小微债 01	商业性金 融债券	2328006. IB	17, 865	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
59	22 兴业银 行二级 01	商业性金 融债券	2228003. IB	7, 146	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
60	21 工商银 行二级 01	商业性金 融债券	2128002. IB	14, 292	102. 2333	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
61	23 新疆发 电 MTN001(绿 色)	企业债务 融资工具	102382488. IB	8, 932	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
62	23 华能水 电 GN017(科 创票据)	企业债务 融资工具	132380072. IB	10, 719	100. 0000	中国建设银 行股份有限 公司	承销团成员
63	20 建发地 产 MTN002	企业债务 融资工具	102001194. IB	7, 146	101. 6241	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	23 华侨城 MTN005	企业债务 融资工具	102382594. IB	32, 157	99. 9225	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	23 锡公用 MTN001	企业债务 融资工具	102383015. IB	7,146	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
66	21 兴业银 行二级 03	商业性金 融债券	2128043. IB	21,438	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
67	23 中建海 峡 MTN001 (科 创票据)	企业债务 融资工具	102382971. IB	3,573	102.3835	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	23 菲达环 保 GN001 (科 创票据)	企业债务 融资工具	132380523. IB	7,146	101.2008	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 华侨城 MTN004	企业债务 融资工具	102281525. IB	10,719	99.0584	中国建设银 行股份有限 公司	承销团成员
70	21 江西交 投 MTN004	企业债务 融资工具	102101129. IB	46,450	100.0000	中国建设银 行股份有限 公司	承销团成员
71	21 川能投 MTN002B	企业债务 融资工具	102101521. IB	21,438	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

（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

2024 年 03 月 31 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：2024 年 03 月 31 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	183	详见风险分析

到期收益分配详见产品说明书。