

建信理财“嘉鑫”（最低持有 180 天）开放式理财产品第 1 期 2023 年四季度暨年度投资管理报告

报告日：2023 年 12 月 31 日

建信理财“嘉鑫”（最低持有 180 天）开放式理财产品第 1 期于 2020 年 04 月 10 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 4,621,815,268.07 元。

一、报告期投资者实际收益率

截至 2023 年 12 月 31 日，产品单位净值为 1.117480。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	1.117480	1.117480	4,621,815,268.07
一个月前	1.113840	1.113840	4,784,150,959.67
二个月前	1.111610	1.111610	4,737,405,891.21
三个月前	1.109803	1.109803	4,689,902,156.17
六个月前	1.104105	1.104105	3,590,553,405.11
一年前	1.083976	1.083976	526,236,166.79

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“嘉鑫”（最低持有 180 天） 开放式理财产品第 1 期	2020-04-03	2020-04-09	2020-04-10	-

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	60,585.40	13.10%	134,369.27	28.90%
同业存单	0.00	0.00%	52,181.25	11.22%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	5,932.26	1.28%
债券	0.00	0.00%	247,450.48	53.23%
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	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%	24,980.69	5.37%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	401,925.50	86.90%	0.00	0.00%
委托投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	462,510.90	100.00%	464,913.95	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.08%

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	20 邮储银行永续债	155,618,685.23	3.31%
2	19 浦发银行永续债	103,245,765.03	2.19%
3	22 华夏银行二级资本债 01	101,562,622.95	2.16%
4	23 农业银行 CD056	99,353,424.59	2.11%

5	23 农业银行 CD060	99,332,762.84	2.11%
6	23 浦发银行 CD082	99,291,414.75	2.11%
7	23 农业银行 CD068	99,276,898.91	2.11%
8	23 光大银行 CD169	98,718,913.39	2.10%
9	19 农业银行二级 02	82,966,295.08	1.76%
10	19 交通银行永续债	72,997,099.86	1.55%

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、国债、政策性金融债、银行存单及信用债等资产，产品的流动性相对较好，流动性风险可控。

（二）产品的投资风险情况

本产品募集资金主要投资于银行存款、国债、政策性金融债、银行存单及信用债等资产，风险可控。

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	44250100000200 003361-0008	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	交易数量	交易净价	关联方名称	关联方角色
1	19 平安银行永续债 01	商业性金融债券	1928038. IB	1, 586	101. 6823	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	19 工商银行永续债	商业性金融债券	1928018. IB	300, 951	101. 3569	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 威经开 MTN001	企业债务融资工具	102100556. IB	793	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	21 闽建工 MTN002	企业债务融资工具	102100930. IB	158	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	21 莆田国资 PPN001	企业债务融资工具	032100070. IB	317	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	21 云能投 GN001 (权益出资)	企业债务融资工具	132100070. IB	317	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
7	21 泉州台商 MTN001	企业债务融资工具	102100690. IB	475	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 云投 MTN001	企业债务融资工具	102281793. IB	100, 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
9	22 淮北建投 MTN003	企业债务融资工具	102281419. IB	34, 092	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

10	21 飞驰惟安 ABN001 优先 A1	资产支持证券	082100172. IB	170,464	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
11	21 三明交建 MTN001(革命老区)	企业债务融资工具	102101807. IB	534,092	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
12	21 光穗华能 ABN001 优先	资产支持证券	082100470. IB	272,743	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	21 海尔金控 MTN002	企业债务融资工具	102101780. IB	613,673	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
14	21 甘国投 MTN002	企业债务融资工具	102101785. IB	306,836	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	21 太仓科教 PPN001	企业债务融资工具	032100370. IB	34,092	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
16	21 南京新港 PPN002	企业债务融资工具	032100481. IB	170,464	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	20 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2028048. IB	7,191	103.6487	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 光明房产 MTN001	企业债务融资工具	102100629. IB	3,595	101.3500	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
19	20 建发地产 MTN001	企业债务融资工具	102001046. IB	10,787	100.9703	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	21 北部湾 MTN002	企业债务融资工具	102100618. IB	14, 383	101. 6123	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	23 桂铁投 SCP002	企业债务融资工具	012383822. IB	14, 383	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	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	96, 281	101. 2135	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	22 粤珠江 MTN001	企业债务融资工具	102280694. IB	7, 191	100. 2332	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 新业国资 SCP001	企业债务融资工具	012381666. IB	3, 595	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	22 浙江旅投 MTN002	企业债务融资工具	102281640. IB	9, 252	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
26	22 乌高新 MTN002	企业债务融资工具	102281994. IB	3, 084	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 威宁投资 MTN001	企业债务融资工具	102280258. IB	6, 168	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	23 苏新国资 MTN001	企业债务融资工具	102380238. IB	12, 336	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 达州投资 PPN001 (革命老区)	企业债务融资工具	032191462. IB	15, 421	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 渝医药 MTN001	企业债务融资工具	102280164. IB	9, 252	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	23 连云城建 PPN001	企业债务融资工具	032380031. IB	9, 252	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	22 苏州文旅 MTN002	企业债务融资工具	102280518. IB	6, 168	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 泉州台商 MTN002	企业债务融资工具	102280528. IB	12, 336	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	21 建发 MTN002	企业债务融资工具	102103276. IB	134, 841	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 新都香城 MTN001	企业债务融资工具	102280341. IB	6, 168	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	22 金合盛 MTN003(科创票据)	企业债务融资工具	102281243. IB	9, 252	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 洛阳城乡 MTN001	企业债务融资工具	102282164. IB	3, 084	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	22 晋能煤业 PPN006	企业债务融资工具	032280247. IB	18, 505	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 淮北建投 MTN004	企业债务融资工具	102281832. IB	3, 084	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	
40	21 工商银行二级 01	商业性金融债券	2128002. IB	300,000	102.4660	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	20 工商银行二级 01	商业性金融债券	2028041. IB	500,000	102.2040	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	23 津城建 MTN005	企业债务融资工具	102382514. IB	85,493	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
43	21 成都交子 ABN001 优先	资产支持证券	082180076. IB	85,493	101.0778	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 山东海洋 MTN001	企业债务融资工具	102100158. IB	85,493	100.1643	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
45	22 京汽股 GN002 (科创票据)	企业债务融资工具	132280096. IB	20,678	99.0350	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
46	21 相城城建 MTN003	企业债务融资工具	102101501. IB	7,527	100.4082	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 珠海港 MTN003	企业债务融资工具	102100609. IB	3,763	100.5819	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 昆山银桥 MTN001	企业债务融资工具	102101038. IB	15,055	100.4495	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 恒运 MTN001	企业债务融资工具	102100606. IB	11,291	100.4709	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	
50	19 江东控股 MTN001	企业债务融资工具	101901224. IB	19,345	101.4906	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
51	23 淮南矿 SCP002	企业债务融资工具	012384098. IB	18,818	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 渝江北嘴 MTN001	企业债务融资工具	101900508. IB	11,291	100.9019	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
53	17 苏州高新 MTN001	企业债务融资工具	101754025. IB	3,763	100.1105	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	21 新建元 MTN001	企业债务融资工具	102101303. IB	11,291	100.6238	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	21 湘投 MTN001	企业债务融资工具	102101348. IB	11,291	100.5360	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	21 常德城投 MTN001	企业债务融资工具	102100309. IB	3,763	100.5994	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 宁波国贸 SCP002	企业债务融资工具	012383773. IB	7,527	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	23 厦门火炬 SCP001	企业债务融资工具	012382737. IB	30,110	99.8234	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	23 武进经发 SCP007	企业债务融资工具	012383216. IB	22,582	99.7928	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
60	建信短债 A	债券基金	531028. OF	6,782,764	1.1098	建信基金管理有限责任公司	基金管理人

61	22 交子金融 GN001	企业债务融资工具	132280043. IB	14, 188	100. 7771	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 广州高新 MTN001	企业债务融资工具	102380028. IB	70, 941	102. 1482	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 南通产业 MTN002	企业债务融资工具	102281931. IB	42, 565	100. 2318	建信信托有限责任公司	承销团成员
64	21 华电云南 MTN001	企业债务融资工具	102101941. IB	28, 376	101. 4837	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
65	22 华为 MTN003	企业债务融资工具	102280392. IB	14, 188	100. 5398	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	22 泉州水务 MTN002	企业债务融资工具	102280794. IB	28, 376	100. 3839	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 苏沙钢 MTN001	企业债务融资工具	102280043. IB	42, 565	100. 6192	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 恒泰 MTN001	企业债务融资工具	102280001. IB	28, 376	101. 0099	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 苏州农业 MTN001	企业债务融资工具	102280821. IB	42, 565	100. 9024	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	20 湘投 MTN001B	企业债务融资工具	102000609. IB	28, 376	101. 5312	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

无，本产品未投资非标准化债权及股权类资产。

十、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

2023 年 12 月 31 日