

建信理财“嘉鑫”（7天）定期开放固收类净值型人民币理财产品第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”（7天）定期开放固收类净值型人民币理财产品第1期于2020年02月06日正式成立。截至报告日，本产品规模为10,280,466,353.55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1.118664。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	1.118664	1.118664	10,280,466,353.55
一个月前	1.115162	1.115162	10,587,459,657.20
二个月前	1.112827	1.112827	10,219,856,343.49
三个月前	1.111383	1.111383	10,402,482,628.79
六个月前	1.105842	1.105842	9,309,423,254.36
一年前	1.087554	1.087554	6,694,577,625.61

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”（7天）定期开放固收类净值型人民币理财产品第1期	2020-01-16	2020-02-05	2020-02-06	-

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	73,635.45	7.16%	302,220.98	24.67%
同业存单	0.00	0.00%	174,210.22	14.22%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	10,803.33	0.88%
债券	68,001.40	6.61%	725,705.37	59.23%
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%	12,347.60	1.01%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	887,280.95	86.23%	0.00	0.00%
委托投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	1,028,917.81	100.00%	1,225,287.49	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.09%

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 中国银行小微债 01	366,615,540.99	2.96%
2	23 进出 02	253,982,991.80	2.05%
3	21 国开 18	242,064,983.61	1.95%
4	23 证金 D70	222,816,602.72	1.80%

5	15 国开 10	210,950,437.16	1.70%
6	23 中信银行 CD123	199,319,773.09	1.61%
7	23 兴业银行 CD149	198,540,819.67	1.60%
8	23 浦发银行 CD099	198,181,042.62	1.60%
9	23 浦发银行 CD128	197,437,826.78	1.59%
10	21 海通 01	186,285,062.47	1.50%

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

报告期内，产品管理人通过合理安排资产配置结构，预留充足现金头寸，保持一定比例的高流动性资产，控制资产久期，管控产品流动性风险，对于关键时点的规模变动和资金面波动都有充足准备，且融资渠道畅通多元，产品流动性平稳运行。

（二） 产品的投资风险情况

截至本季度末，本理财产品主要投资于固定收益类资产。产品固定收益部分主要投资于银行存款、同业存单、利率债及短久期信用债等，整体风险可控、价格波动可控，组合总体净值平稳。

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 003361-0002	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	22 中国银行小微债 01	商业性金融债券	2228043. IB	3,600,000	100.4704	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 兴业银行 03	商业性金融债券	2228022. IB	700,000	100.7240	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	建信短债 A	债券基金	531028. OF	45,060,382	1.1096	建信基金管理有限责任公司	基金管理人
4	22 兴业银行 02	商业性金融债券	2228020. IB	1,000,000	100.7552	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 兴业银行 01	商业性金融债券	2228019. IB	300,000	100.8072	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 上海能科 ABN001 优先 A	资产支持证券	082280795. IB	200,000	96.3400	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 盛世融迪 5 优先_bc	资产支持证券	2289352. IB	1,000,000	29.6455	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	19 工商银行永续债	商业性金融债券	1928018. IB	1,500,000	101.4539	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	23 中铁科 创 ABN001 优先	资产支持 证券	082380081. IB	100,000	101.0288	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	22 山西清 能 ABN001 优先	资产支持 证券	082280800. IB	500,000	95.9722	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	22 上海能 科 ABN001 优先 B	资产支持 证券	082280796. IB	250,000	99.2617	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	建信中短 债纯债 A	债券基金	006989. OF	47,800,191	1.0460	建信基金管 理有限责任 公司	基金管理人
13	22 飞驰财 信 ABN001 优先	资产支持 证券	082280456. IB	14,158	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
14	23 交银金 租债 01	商业性金 融债券	252380005. IB	47,196	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 华电山 能 ABN001 优先	资产支持 证券	082280296. IB	14,158	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
16	20 飞驰建 瓴 ABN001 优先	资产支持 证券	082000628. IB	21,943	101.9715	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
17	21 成都交 子 ABN001 优先	资产支持 证券	082180076. IB	118,214	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
18	22 粤澳 ABN001 优 先	资产支持 证券	082280418. IB	59,107	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

						建设银行股份有限公司	商,承销团成员
19	22 珠海华发 ABN001 优先	资产支持证券	082282014. IB	46,384	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	17 淄博资运 MTN002	企业债务融资工具	101754118. IB	151,052	105.6634	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	19 广新控股 MTN001	企业债务融资工具	101900102. IB	4,430	102.1929	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
22	21 佛燃能源 MTN001	企业债务融资工具	102100007. IB	6,567	101.4446	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 江门高新 MTN001	企业债务融资工具	102103204. IB	32,837	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
24	22 苏州文旅 MTN002	企业债务融资工具	102280518. IB	6,567	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	23 汇金 MTN006A	企业债务融资工具	102382914. IB	6,567	100.0530	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
26	20 秀湖集团 MTN001	企业债务融资工具	102000708. IB	5,432	99.8247	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
27	22 溧水经开 MTN001	企业债务融资工具	102280167. IB	208,434	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
28	21 宝龙 MTN001	企业债务融资工具	102101036. IB	53,364	32.0096	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 浙资运营 MTN001	企业债务融资工具	102100529. IB	44,470	101.9697	中国建设银行股份有限公司,中国	主承销商或联席承销

						建设银行股份有限公司	商,承销团成员
30	21 成都益民 MTN001(乡村振兴)	企业债务融资工具	102100514. IB	35,576	102.1171	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 陆金开 MTN001	企业债务融资工具	102100303. IB	88,941	100.6675	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 飞驰惟安 ABN001 优先 A1	资产支持证券	082100172. IB	35,576	101.3921	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
33	20 兴业银行小微债 04	商业性金融债券	2028021. IB	200,000	100.7818	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 中国银行小微债 02	商业性金融债券	2228044. IB	200,000	100.4750	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	20 兴业银行小微债 02	商业性金融债券	2028016. IB	200,000	100.2992	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 兴业银行 04	商业性金融债券	2228045. IB	700,000	100.0192	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	19 建元 12A2_bc	资产支持证券	1989574. IB	18,031	12.3319	建信信托有限责任公司	计划管理人
38	19 建元 11A2_bc	资产支持证券	1989546. IB	18,031	19.7810	建信信托有限责任公司	计划管理人
39	21 中方财团 MTN001(权益出资)	企业债务融资工具	102100797. IB	4,507	101.9175	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	21 江铜 GN001(碳 中和债)	企业债务 融资工具	132100038. IB	631	101. 8271	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 融信产 融 ABN001 优先 B	资产支持 证券	082280913. IB	9, 917	94. 8655	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 株洲城 建 MTN001	企业债务 融资工具	102101093. IB	4, 507	101. 4865	中国建设银行 股份有限公司	承销团成员
43	19 珠海港 MTN003	企业债务 融资工具	101901427. IB	5, 409	103. 4524	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	20 建元 1A3_bc	资产支持 证券	2089065. IB	9, 015	13. 2410	建信信托有 限责任公司	计划管理人
45	21 成都产 投 MTN001	企业债务 融资工具	102100745. IB	2, 704	102. 0213	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	19 珠海港 MTN002	企业债务 融资工具	101900992. IB	6, 310	103. 1271	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	19 沪城控 MTN001	企业债务 融资工具	101900542. IB	27, 046	103. 2737	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 速利银 丰 ABN001 优先	资产支持 证券	082280523. IB	33, 808	8. 8300	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

（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

附录一

建信理财“嘉鑫”（7 天）定期开放固收类净值型人民币理财产品第 1 期投资
非标准化债权及股权类资产清单

报告日：2023 年 12 月 31 日

我司依照监管要求，现对建信理财“嘉鑫”（7 天）定期开放固收类净值型人民币理财产品第 1 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。