

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2024年二季度暨半年投资管理报告

报告日：2024年06月30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8,445,088,904.16元。

一、报告期投资者实际收益率

截至2024年06月30日，产品单位净值为1.132624。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	1.132624	1.132624	8,445,088,904.16
一个月前	1.130866	1.130866	8,564,958,848.90
二个月前	1.128173	1.128173	8,236,248,110.50
三个月前	1.126079	1.126079	7,954,296,849.51
六个月前	1.118664	1.118664	10,280,466,353.55
一年前	1.105842	1.105842	9,309,423,254.36

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	80,079.80	9.48%	258,848.47	27.40%
同业存单	0.00	0.00%	108,976.00	11.53%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	36,476.54	3.86%
债券	39,100.64	4.63%	528,612.20	55.95%
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%	11,938.84	1.26%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	725,527.92	85.89%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	844,708.37	100.00%	944,852.05	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.02%

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	银行存款	1,873,249,661.75	19.83%
2	19 工商银行永续债	375,506,655.74	3.97%
3	R007	358,388,107.95	3.79%
4	20 农业银行永续债 01	269,602,287.67	2.85%

5	22 中国银行小微债 01	231, 875, 287. 67	2. 45%
6	24 证金 D106	205, 350, 424. 54	2. 17%
7	24 证金 D105	205, 349, 076. 30	2. 17%
8	23 浦发银行 CD128	199, 842, 284. 70	2. 12%
9	22 中国银行绿色金融债 01	182, 513, 508. 20	1. 93%
10	24 证金 D104	179, 690, 272. 70	1. 90%

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	23 兴业银行绿色金融债 02	商业性金融债券	2328018. IB	75,851	101.3603	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 兴业银行绿债 01	商业性金融债券	222380003. IB	5,660	101.4763	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 盛世融迪 2 优先_bc	资产支持证券	2489120. IB	3,398	100.0000	建信信托有限责任公司	计划管理人
4	23 南昌轨交 MTN001 (绿色)	企业债务融资工具	102380053. IB	453	102.1436	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	24 中四保供 ABN001 优先 (科创票据)	资产支持证券	082480608. IB	226	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 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
7	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
8	19 兴业银行二级 01	商业性金融债券	1928022. IB	400,000	100.8887	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 盛世融迪 5 优先_bc	资产支持证券	2289352. IB	1,000,000	3.0716	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	19 工商银行永续债	商业性金融债券	1928018. IB	3,600,000	101.0548	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	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	2,650,000	101.1621	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	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
13	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
14	22 中国银行小微债 01	商业性金融债券	2228043. IB	2,300,000	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
15	21 工商银行永续债 01	商业性金融债券	2128021. IB	500,000	103.4139	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	建信短债 A	债券基金	531028. OF	45,060,382	1.1096	建信基金管理有限公司	基金管理人
17	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
18	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

19	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
20	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
21	22 华电山能 ABN001 优先	资产支持证券	082280296. IB	5, 432	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	22 飞驰财信 ABN001 优先	资产支持证券	082280456. IB	5, 432	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	23 光大银行绿债 01	商业性金融债券	222380004. IB	12, 815	101. 3338	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	20 飞驰建瓴 ABN001 优先	资产支持证券	082000628. IB	13, 540	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
25	21 成都交子 ABN001 优先	资产支持证券	082180076. IB	93, 739	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	22 珠海华发 ABN001 优先	资产支持证券	082282014. IB	49, 507	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	17 淄博资运 MTN002	企业债务融资工具	101754118. IB	62, 493	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
28	21 江门高新 MTN001	企业债务融资工具	102103204. IB	26, 038	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
29	22 苏州文旅 MTN002	企业债务融资工具	102280518. IB	5,207	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	23 汇金 MTN006A	企业债务融资工具	102382914. IB	5,207	100.0530	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
31	21 天成租赁 GN002 (碳中和债)	企业债务融资工具	132100102. IB	5,207	100.3820	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
32	24 浙交投 SCP003	企业债务融资工具	012480377. IB	23,056	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 溧水经开 MTN001	企业债务融资工具	102280167. IB	229,989	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
34	24 首都机场 MTN001 (绿色)	企业债务融资工具	102481032. IB	5,780	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 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
36	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
37	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
38	20 农业银行永续债 02	商业性金融债券	2028032. IB	100,000	102.6881	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	21 淮安国投 MTN003	企业债务融资工具	102103248. IB	106,521	98.6976	中国建设银行股份有限公司	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
40	22 中铁四 局 ABN001 优先(科创 票据)	资产支持 证券	082280776. IB	30, 434	97. 8627	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

（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 06 月 30 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：2024 年 06 月 30 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)	产品投资 项目收益 率	风险状 况	本金余额 (万元)
------	--------	------	-------------------	-------------------	----------	--------------

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。