

# 建信理财“嘉鑫”（最低持有 180 天）开放式理财产品第 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”（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 5,336,369,461.75 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 1.135083。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	1.135083	1.135083	5,336,369,461.75
一个月前	1.132599	1.132599	4,983,859,937.33
两个月前	1.129841	1.129841	4,531,543,973.54
三个月前	1.126925	1.126925	4,234,978,570.51
六个月前	1.117480	1.117480	4,621,815,268.07
一年前	1.104105	1.104105	3,590,553,405.11

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	68,350.50	12.81%	170,827.04	30.48%
同业存单	0.00	0.00%	23,096.01	4.12%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	44,136.40	7.87%
债券	4,196.94	0.79%	292,424.72	52.17%
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%	30,027.21	5.36%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	461,227.53	86.41%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	533,774.98	100.00%	560,511.39	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	银行存款	848,625,513.99	15.14%
2	R007	400,074,498.33	7.14%
3	20 邮储银行永续债	152,890,370.05	2.73%
4	19 交通银行永续债	126,198,340.07	2.25%

5	杭州分行	117,663,675.78	2.10%
6	闽侯分行	115,032,984.99	2.05%
7	22 华夏银行二级资本债 01	105,484,153.01	1.88%
8	19 浦发银行永续债	104,687,841.53	1.87%
9	24 华夏银行 CD149	98,721,255.47	1.76%
10	21 工商银行二级 01	94,560,196.72	1.69%

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	4425010000020003361-0008	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	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
2	21 三明交建 MTN001(革命老区)	企业债务融资工具	102101807. IB	516,098	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
3	21 甘国投 MTN002	企业债务融资工具	102101785. IB	144,886	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 海尔金控 MTN002	企业债务融资工具	102101780. IB	289,773	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
5	22 淮北建投 MTN003	企业债务融资工具	102281419. IB	16,098	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 工商银行永续债 01	商业性金融债券	2128021. IB	522,745	103.1913	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	20 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2028048. IB	6,498	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
8	20 农业银行永续债 02	商业性金融债券	2028032. IB	25,994	102.8214	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	21 工商银行永续债 02	商业性金融债券	2128044. IB	412,997	102.6572	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	20 青岛国信 MTN003	企业债务融资工具	102000425. IB	6,498	101.1097	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
11	22 天成租赁 GN001 (碳中和债)	企业债务融资工具	132280054. IB	6,498	100.6490	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	24 厦国贸控 SCP003	企业债务融资工具	012480075. IB	12,997	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
13	20 建发地产 MTN001	企业债务融资工具	102001046. IB	9,747	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
14	20 青岛国信 MTN001	企业债务融资工具	102000056. IB	12,997	101.1349	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
15	23 娄城高新 MTN001	企业债务融资工具	102381640. IB	3,249	100.6546	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 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	124,485	101.1743	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	22 粤珠江 MTN001	企业债务融资工具	102280694. IB	6,498	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
18	24 常熟城投 CP001	企业债务融资工具	042480103. IB	12,997	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	24 光大银行债 01	商业性金融债券	212480005. IB	6,498	100.8928	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	23 苏新国资 MTN001	企业债务融资工具	102380238. IB	13,009	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

21	22 洛阳城乡 MTN001	企业债务融资工具	102282164. IB	3,252	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
22	21 达州投资 PPN001(革命老区)	企业债务融资工具	032191462. IB	16,262	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	22 乌高新 MTN002	企业债务融资工具	102281994. IB	3,252	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
24	22 淮北建投 MTN004	企业债务融资工具	102281832. IB	3,252	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
25	23 连云城建 PPN001	企业债务融资工具	032380031. IB	9,757	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 浙江旅投 MTN002	企业债务融资工具	102281640. IB	9,757	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
27	21 建发 MTN002	企业债务融资工具	102103276. IB	105,008	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	22 新都香城 MTN001	企业债务融资工具	102280341. IB	6,504	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	22 泉州台商 MTN002	企业债务融资工具	102280528. IB	13,009	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 苏州文旅 MTN002	企业债务融资工具	102280518. IB	6,504	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	22 金合盛 MTN003(科创票据)	企业债务融资工具	102281243. IB	9,757	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 威宁投资 MTN001	企业债务融资工具	102280258. IB	6,504	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 工商银行二级 01	商业性金融债券	2228004. IB	500,000	101.1662	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	19 工商银行永续债	商业性金融债券	1928018. IB	300,000	101.1649	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 工商银行二级 02	商业性金融债券	2028049. IB	400,000	102.5373	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 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
37	21 工商银行二级 02	商业性金融债券	2128051. IB	500,000	101.7307	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	21 工商银行二级 01	商业性金融债券	2128002. IB	900,000	102.8221	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	19 进出 11	政策性金融债券	190311. IB	500,000	101.0625	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 农行永续债 02	商业性金融债券	092280086. IB	400,000	102.7862	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	
41	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
42	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
43	23 光大银行债 01	商业性金融债券	212380005. IB	33,861	100.1996	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 京汽股 GNO02 (科创票据)	企业债务融资工具	132280096. IB	16,930	99.0350	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
45	21 武汉城建 MTN002	企业债务融资工具	102101258. IB	33,861	100.3837	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
46	21 株洲城建 MTN002	企业债务融资工具	102101746. IB	50,791	100.6002	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
47	22 泉州水务 MTN002	企业债务融资工具	102280794. IB	63,185	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
48	24 常熟交通 PPN004	企业债务融资工具	032480493. IB	157,964	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	24 优生活三 ABN001 优先	资产支持证券	082480071. IB	129,531	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	22 苏沙钢 MTN001	企业债务融资工具	102280043. IB	94,778	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
51	20 湘投 MTN001B	企业债务融资工具	102000609. IB	94,778	101.4113	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
52	22 南通产业 MTN002	企业债务融资工具	102281931. IB	94, 778	100. 2318	建信信托有限责任公司	承销团成员
53	22 交子金融 GN001	企业债务融资工具	132280043. IB	31, 592	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
54	23 广州高新 MTN001	企业债务融资工具	102380028. IB	157, 964	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
55	22 苏州农业 MTN001	企业债务融资工具	102280821. IB	94, 778	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
56	22 恒泰 MTN001	企业债务融资工具	102280001. IB	63, 185	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
57	22 华为 MTN003	企业债务融资工具	102280392. IB	31, 592	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
58	21 华电云南 MTN001	企业债务融资工具	102101941. IB	63, 185	101. 4837	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

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

2024年06月30日