

建信理财嘉鑫（法人版）固收类按日开放式产品 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（法人版）固收类按日开放式产品于 2022 年 07 月 05 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 19,333,964,672.48 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 1.041637。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  | 1.041637 | 1.041637 | 19,333,964,672.48 |
| 一个月前 | 1.040105 | 1.040105 | 25,816,219,340.87 |
| 二个月前 | 1.038449 | 1.038449 | 24,375,767,031.32 |
| 三个月前 | 1.036705 | 1.036705 | 20,938,684,048.11 |
| 六个月前 | 1.031337 | 1.031337 | 31,134,420,728.54 |
| 一年前  | 1.020697 | 1.020697 | 16,338,940,404.55 |

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（法人版）固收类按日<br>开放式产品 | 2022-06-23 | 2022-07-04 | 2022-07-05 | -     |

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<br>(万元) | 占全部产品总资产的比例 (%) | 穿透后金额<br>(万元) | 占全部产品总资产的比例 (%) |
|---------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|
| 现金及银行存款       | 248,533.40    | 12.85%          | 928,209.76    | 47.99%          |
| 同业存单          | 0.00          | 0.00%           | 119,436.67    | 6.18%           |
| 拆放同业及买入返售     | 108,031.11    | 5.59%           | 611,715.87    | 31.63%          |
| 债券            | 0.00          | 0.00%           | 263,126.00    | 13.61%          |
| 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%           | 11,499.97     | 0.59%           |
| 私募基金          | 0.00          | 0.00%           | 0.00          | 0.00%           |
| 资产管理产品        | 1,577,514.25  | 81.56%          | 0.00          | 0.00%           |
| 委外投资——协议方式    | 0.00          | 0.00%           | 0.00          | 0.00%           |
| 合计            | 1,934,078.75  | 100.00%         | 1,933,988.27  | 100.00%         |

期末穿透前杠杆比例为：100.04%

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  | 6,202,346,088.03 | 32.09%   |
| 2  | GC014 | 2,350,103,542.20 | 12.16%   |
| 3  | GC007 | 1,523,005,080.43 | 7.88%    |
| 4  | GC028 | 1,249,644,977.14 | 6.47%    |

|    |             |                |       |
|----|-------------|----------------|-------|
| 5  | R007        | 695,478,387.21 | 3.60% |
| 6  | 24 证金 D96   | 477,235,562.97 | 2.47% |
| 7  | 24 证金 D94   | 477,221,751.46 | 2.47% |
| 8  | 光大 20240929 | 318,281,449.16 | 1.65% |
| 9  | GC091       | 281,947,123.96 | 1.46% |
| 10 | 24 证金 D92   | 238,603,969.97 | 1.23% |

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、高流动性信用债、政策性金融债及银行存单等高流动性资产，故产品流动性较好、风险较低。

（二）产品的投资风险情况

截至本报告期末，产品固定收益部分投资严格遵守合同规定的投资范围和比例限制，债券整体风险可控、价格波动可控。总体来看，债券组合整体票息较高，估值较为稳定，持仓债券风险可控，组合债券仓位总体净值平稳。

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  | 4425010000020004533 | 建信理财有限责任公司<br>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  | 24 浙交投 SCP003 | 企业债务融资工具 | 012480377. IB | 584  | 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）理财产品投资关联方发行的资产管理产品

| 日期        | 资产管理产品名称                    | 投资类型 | 金额               | 份额               | 证券代码          | 关联方名称        |
|-----------|-----------------------------|------|------------------|------------------|---------------|--------------|
| 2024/4/2  | 建信资本管理有限责任公司稳盈 38 号单一资产管理计划 | 申购   | 1,500,000,000.00 | 1,500,000,000.00 | JXZBWY38H     | 建信资本管理有限责任公司 |
| 2024/4/8  | 建信信托凤鸣尊享日日盈 6 号集合信托计划       | 赎回   | 296,875,433.94   | 296,875,433.94   | JXXTFMZRRY6H  | 建信信托有限责任公司   |
| 2024/4/8  | 建信资本管理有限责任公司稳盈 38 号单一资产管理计划 | 申购   | 1,000,000,000.00 | 1,000,000,000.00 | JXZBWY38H     | 建信资本管理有限责任公司 |
| 2024/4/10 | 建信资本管理有限责任公司稳盈 38 号单一资产管理计划 | 赎回   | 1,000,000,000.00 | 1,000,000,000.00 | JXZBWY38H     | 建信资本管理有限责任公司 |
| 2024/4/10 | 建信信托凤鸣尊享日日盈 6 号集合信托计划       | 申购   | 2,000,000,000.00 | 2,000,000,000.00 | JXXTFMZRRY6H  | 建信信托有限责任公司   |
| 2024/4/11 | 建信信托凤鸣尊享日日盈 6 号集合信托计划       | 赎回   | 1,915,037,448.56 | 1,915,037,448.56 | JXXTFMZRRY6H  | 建信信托有限责任公司   |
| 2024/4/11 | 建信资本惠众配置 2 号集合资产管理计划        | 赎回   | 720,144,792.89   | 720,144,792.89   | JXZBHZPZ2H    | 建信资本管理有限责任公司 |
| 2024/4/16 | 建信保险资管安鑫 17 号资产管理产品         | 赎回   | 464,412,532.08   | 464,412,532.08   | JXBXZGAX17H   | 建信保险资产管理有限公司 |
| 2024/4/17 | 建信资本管理有限责任公司稳盈 38 号单一资产管理计划 | 申购   | 1,000,000,000.00 | 1,000,000,000.00 | JXZBWY38H     | 建信资本管理有限责任公司 |
| 2024/4/19 | 建信信托凤鸣尊享日日盈 13 号集合信托计划      | 申购   | 800,000,000.00   | 800,000,000.00   | JXXTFMZRRY13H | 建信信托有限责任公司   |

|                   |                             |    |                          |                          |                        |              |
|-------------------|-----------------------------|----|--------------------------|--------------------------|------------------------|--------------|
| 2024<br>/4/2<br>4 | 建信资本惠众配置 2 号集合资产管理计划        | 赎回 | 325,787<br>,975.23       | 325,787<br>,975.23       | JXZBHZ<br>PZ2H         | 建信资本管理有限责任公司 |
| 2024<br>/4/2<br>6 | 建信资本管理有限责任公司稳盈 38 号单一资产管理计划 | 申购 | 300,000<br>,000.00       | 300,000<br>,000.00       | JXZBWY<br>38H          | 建信资本管理有限责任公司 |
| 2024<br>/4/2<br>9 | 建信资本管理有限责任公司稳盈 38 号单一资产管理计划 | 申购 | 2,000,0<br>00,000.<br>00 | 2,000,0<br>00,000.<br>00 | JXZBWY<br>38H          | 建信资本管理有限责任公司 |
| 2024<br>/5/7      | 建信资管浦江安盈添利 24 号资产管理产品       | 赎回 | 198,523<br>,383.08       | 198,523<br>,383.08       | JXZGAY<br>TL24H        | 建信保险资产管理有限公司 |
| 2024<br>/5/7      | 建信信托凤鸣尊享日日盈 13 号集合信托计划      | 赎回 | 766,741<br>,072.50       | 766,741<br>,072.50       | JXXTFM<br>ZXRRY1<br>3H | 建信信托有限责任公司   |
| 2024<br>/5/7      | 建信资本管理有限责任公司稳盈 38 号单一资产管理计划 | 申购 | 1,000,0<br>00,000.<br>00 | 1,000,0<br>00,000.<br>00 | JXZBWY<br>38H          | 建信资本管理有限责任公司 |
| 2024<br>/5/9      | 建信保险资管安鑫 17 号资产管理产品         | 赎回 | 278,155<br>,090.01       | 278,155<br>,090.01       | JXBXZG<br>AX17H        | 建信保险资产管理有限公司 |
| 2024<br>/5/1<br>4 | 建信保险资管安鑫 17 号资产管理产品         | 赎回 | 463,371<br>,845.71       | 463,371<br>,845.71       | JXBXZG<br>AX17H        | 建信保险资产管理有限公司 |
| 2024<br>/5/1<br>7 | 建信资本管理有限责任公司稳盈 38 号单一资产管理计划 | 赎回 | 2,000,0<br>00,000.<br>00 | 2,000,0<br>00,000.<br>00 | JXZBWY<br>38H          | 建信资本管理有限责任公司 |
| 2024<br>/5/2<br>3 | 建信资本惠众配置 2 号集合资产管理计划        | 赎回 | 250,954<br>,122.00       | 250,954<br>,122.00       | JXZBHZ<br>PZ2H         | 建信资本管理有限责任公司 |
| 2024<br>/5/2<br>3 | 建信信托凤鸣尊享日日盈 13 号集合信托计划      | 申购 | 1,000,0<br>00,000.<br>00 | 1,000,0<br>00,000.<br>00 | JXXTFM<br>ZXRRY1<br>3H | 建信信托有限责任公司   |
| 2024<br>/5/2<br>4 | 建信信托凤鸣尊享日日盈 13 号集合信托计划      | 申购 | 2,000,0<br>00,000.<br>00 | 2,000,0<br>00,000.<br>00 | JXXTFM<br>ZXRRY1<br>3H | 建信信托有限责任公司   |
| 2024<br>/6/6      | 建信资本惠众配置 2 号集合资产管理计划        | 赎回 | 218,123<br>,806.87       | 218,123<br>,806.87       | JXZBHZ<br>PZ2H         | 建信资本管理有限责任公司 |
| 2024<br>/6/1<br>1 | 建信信托凤鸣尊享日日盈 15 号集合信托计划      | 申购 | 500,000<br>,000.00       | 500,000<br>,000.00       | JXXTFM<br>ZXRRY1<br>5H | 建信信托有限责任公司   |
| 2024<br>/6/1<br>9 | 建信保险资管安盈添利 1 号              | 赎回 | 333,317<br>,792.00       | 333,317<br>,792.00       | JXBXZG<br>AYTL1H       | 建信保险资产管理有限公司 |
| 2024<br>/6/2<br>0 | 建信基金安心宝 2 号集合资产管理计划         | 申购 | 500,000<br>,000.00       | 500,000<br>,000.00       | JXJJAX<br>B2H          | 建信基金管理有限责任公司 |
| 2024<br>/6/2      | 建信信托凤鸣尊享日日盈 6 号集合信托计划       | 申购 | 1,000,0<br>00,000.       | 1,000,0<br>00,000.       | JXXTFM<br>ZXRRY6       | 建信信托有限责任公司   |

|           |                             |    |                  |                  |                |              |
|-----------|-----------------------------|----|------------------|------------------|----------------|--------------|
| 6         |                             |    | 00               | 00               | H              |              |
| 2024/6/26 | 建信基金安心宝 2 号集合资产管理计划         | 赎回 | 481,889,805.28   | 481,889,805.28   | JXJJAXB2H      | 建信基金管理有限责任公司 |
| 2024/6/26 | 建信信托凤鸣尊享日日盈 13 号集合信托计划      | 赎回 | 1,911,815,593.92 | 1,911,815,593.92 | JXXTFMZXRRY13H | 建信信托有限责任公司   |
| 2024/6/27 | 建信信托凤鸣尊享日日盈 15 号集合信托计划      | 赎回 | 480,583,466.78   | 480,583,466.78   | JXXTFMZXRRY15H | 建信信托有限责任公司   |
| 2024/6/27 | 建信信托凤鸣尊享日日盈 6 号集合信托计划       | 申购 | 1,500,000,000.00 | 1,500,000,000.00 | JXXTFMZXRRY6H  | 建信信托有限责任公司   |
| 2024/6/27 | 建信资本管理有限责任公司稳盈 38 号单一资产管理计划 | 赎回 | 1,500,000,000.00 | 1,500,000,000.00 | JXZBWY38H      | 建信资本管理有限责任公司 |
| 2024/6/27 | 建信信托凤鸣尊享日日盈 13 号集合信托计划      | 赎回 | 955,859,370.15   | 955,859,370.15   | JXXTFMZXRRY13H | 建信信托有限责任公司   |
| 2024/6/28 | 建信资本管理有限责任公司稳盈 38 号单一资产管理计划 | 赎回 | 370,000,000.00   | 370,000,000.00   | JXZBWY38H      | 建信资本管理有限责任公司 |
| 2024/6/28 | 建信信托凤鸣尊享日日盈 6 号集合信托计划       | 申购 | 900,000,000.00   | 900,000,000.00   | JXXTFMZXRRY6H  | 建信信托有限责任公司   |
| 2024/6/28 | 建信信托凤鸣尊享日日盈 8 号集合信托计划       | 赎回 | 71,720,645.22    | 71,720,645.22    | JXXTFMZXRRY8H  | 建信信托有限责任公司   |

### （三）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（法人版）固收类按日开放式产品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（法人版）固收类按日开放式产品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<br>(天) | 产品投资项目收益率 | 风险状况 | 本金余额<br>(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。