

建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 273 期（深圳专享）2024 年二季度暨半年投资管理报告

报告日：2024 年 06 月 30 日

建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 273 期（深圳专享）于 2022 年 05 月 06 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 704,183,089.04 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 1.014316。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	1.014316	1.052816	704,183,089.04
一个月前	1.012906	1.049906	703,204,091.82
两个月前	1.010311	1.045811	701,907,903.18
三个月前	1.007070	1.041070	700,260,746.76
六个月前	1.009887	1.038887	702,219,185.56
一年前	1.020393	1.034393	714,613,959.36

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
建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 273 期（深圳专享）	2022-04-25	2022-05-05	2022-05-06	2025-05-06

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	255.29	0.36%	364.46	0.47%
同业存单	0.00	0.00%	7,603.10	9.85%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	499.18	0.65%
债券	0.00	0.00%	54,853.16	71.07%
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	12,015.14	17.06%	12,015.14	15.57%
权益类投资	0.00	0.00%	1,306.90	1.69%
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%	535.99	0.69%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	58,166.40	82.58%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	70,436.82	100.00%	77,177.93	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	22 前海华宝 AB017	120,151,390.25	15.57%
2	21 交通银行永续债	15,176,305.00	1.97%
3	22 国开 05	13,930,005.49	1.80%
4	21 工商银行永续债 01	13,584,660.40	1.76%

5	20 光大银行永续债	12,310,789.86	1.60%
6	20 农业银行永续债 01	11,744,401.86	1.52%
7	23 付息国债 19	11,584,829.54	1.50%
8	20 邮储银行永续债	11,282,741.76	1.46%
9	24 光大银行 CD063	11,239,497.07	1.46%
10	21 农业银行永续债 01	9,366,460.14	1.21%

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

本产品主要投资于标准化资产，资产流动性风险可控。

（二）市场情况

2024 年 2 季度，债券市场方面，债券市场资产荒的主线逻辑未变，各品种、期限的收益率曲线整体继续下行，30 年国债收益率下行至低于 2.5%。股票市场方面，A 股市场震荡下跌，沪深 300 指数下跌 2.14%，上证指数下跌 2.43%，创业板指数下跌 7.41%，类似债券的红利资产为主的行业如公用事业、银行、煤炭等表现较好，而传媒、商贸零售、社会服务等行业表现相对落后。

（三）产品非标准化资产持仓风险

受行业周期变化影响，产品投资的非标准化资产融资人及担保人所属集团出现流动性困难。管理人持续关注，积极采取应对措施，并将继续勤勉尽职，切实保障理财资金投资权益。

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	4425010000040003919	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	数量	净价	关联方名称	关联方角色
1	24 农行永续债 02	商业性金融债券	242400009. IB	67,906	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	24 农行永续债 01	商业性金融债券	242400005. IB	84,882	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
3	23 招行永续债 01	商业性金融债券	242380033. IB	25,464	102.9566	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	23 邮储永续债 01	商业性金融债券	242380019. IB	84,882	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	23 农行永续债 01	商业性金融债券	242380017. IB	49,231	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 平安银行绿色金	商业性金融债券	2228056. IB	23,767	100.5168	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销

	融债					公司, 中国建设银行股份有限公司	商, 承销团成员
7	22 中国银行永续债 01	商业性金融债券	2228023. IB	42, 441	100. 4858	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 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2228011. IB	87, 259	101. 6531	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 中国银行二级 01	商业性金融债券	2228006. IB	1, 697	100. 6981	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 工商银行二级 01	商业性金融债券	2228004. IB	42, 044	100. 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
11	24 交行绿债 01	商业性金融债券	222480001. IB	8, 488	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
12	21 工商银行二级 02	商业性金融债券	2128051. IB	16, 976	102. 7886	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 兴业银行二级 02	商业性金融债券	2128042. IB	30, 686	102. 5266	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	21 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2128038. IB	88, 278	101. 2537	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 国开绿债 04 清发	政策性金融债券	2102004QF. IB	1, 697	100. 3077	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 中国银行永续债 03	商业性金融债券	2028053. IB	10,185	103.9549	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 工商银行二级 02	商业性金融债券	2028049. IB	8,488	102.7749	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	23 赣投 MTN001	企业债务融资工具	102381502. IB	8,488	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	20 农业银行永续债 02	商业性金融债券	2028032. IB	83,185	103.0126	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 中行永续债 01	商业性金融债券	242380008. IB	32,255	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 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2228029. IB	54,324	100.5922	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	115,440	100.8866	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 工商银行永续债 01	商业性金融债券	2128021. IB	130,719	102.7521	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	21 临沂投资 MTN003	企业债务融资工具	102102176. IB	1,697	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	20 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2028048. IB	20,371	103.5268	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股	主承销商或联席承销商, 承销团成员

						份有限公司	
26	24 厦国贸 控 MTN004	企业债务 融资工具	102481133. IB	16,976	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	23 太平人 寿永续债 01	商业性金 融债券	282380005. IB	16,976	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	24 云能投 MTN002	企业债务 融资工具	102480131. IB	10,185	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	24 苏州农 业 MTN001	企业债务 融资工具	102480287. IB	5,941	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	21 长安汇 通 PPN001	企业债务 融资工具	032191358. IB	5,092	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
31	24 邮储永 续债 01	商业性金 融债券	242400004. IB	84,882	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	21 工商银 行永续债 02	商业性金 融债券	2128044. IB	5,092	100.7452	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	24 湖南能 源 MTN004	企业债务 融资工具	102482248. IB	5,092	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
34	22 昆山国 创 MTN007	企业债务 融资工具	102282049. IB	16,976	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	24 南昌轨 交	企业债务 融资工具	102480235. IB	3,395	100.0000	中国建设银行 股份有限	主承销商或 联席承销

	MTN001 (绿色)					公司, 中国建设银行股份有限公司	商, 承销团成员
36	21 兴业银行二级 01	商业性金融债券	2128032. IB	50, 404	103. 0139	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	23 淮南矿 SCP004	企业债务融资工具	012384488. IB	3, 395	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	21 江门高新 MTN001	企业债务融资工具	102103204. IB	5, 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
39	22 云天化 MTN001	企业债务融资工具	102281519. IB	16, 976	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
40	24 西安高新 MTN002	企业债务融资工具	102480325. IB	8, 488	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
41	21 渝高建投 MTN001	企业债务融资工具	102102220. IB	10, 185	100. 1898	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	22 中建投资 MTN001 (绿色)	企业债务融资工具	102280709. IB	1, 358	100. 4816	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	22 新庐陵 MTN001	企业债务融资工具	102281265. IB	23, 767	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
44	21 淄博城资 MTN002	企业债务融资工具	102103081. IB	18, 674	95. 8070	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 北部湾 MTN001	企业债务融资工具	102280032. IB	11,883	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
46	21 晋能电力 MTN015	企业债务融资工具	102103210. IB	23,767	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
47	21 淮安国投 MTN003	企业债务融资工具	102103248. IB	5,092	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
48	24 天津轨交 SCP003	企业债务融资工具	012480458. IB	3,395	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
49	22 进出绿色债 02	政策性金融债券	2203002. IB	20,371	99.9823	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	24 三一 MTN001 (科创票据)	企业债务融资工具	102480799. IB	28,860	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
51	24 南京旅游 MTN001 (资产担保)	企业债务融资工具	102481250. IB	11,883	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	21 淄博城运 MTN003	企业债务融资工具	102103220. IB	11,883	96.3159	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
53	22 五凌 1 号 ABN001 优先 A	资产支持证券	082280989. IB	5,092	95.4545	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	22 合肥产投 MTN001 (科创票据)	企业债务融资工具	102281241. IB	28,860	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

55	24 天津港 MTN001 (科 创票据)	企业债务 融资工具	102480047. IB	8,488	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
56	23 云能投 MTN005	企业债务 融资工具	102383266. IB	10,185	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
57	19 工商银 行永续债	商业性金 融债券	1928018. IB	74,696	100.9083	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	22 兴业银 行二级 01	商业性金 融债券	2228003. IB	5,483	99.8249	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	21 兴业银 行二级 03	商业性金 融债券	2128043. IB	16,451	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
60	21 工商银 行二级 01	商业性金 融债券	2128002. IB	10,967	102.2333	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
61	20 工商银 行二级 01	商业性金 融债券	2028041. IB	8,225	102.6855	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 新疆发 电 MTN001 (绿 色)	企业债务 融资工具	102382488. IB	6,854	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
63	23 华能水 电 GN017 (科 创票据)	企业债务 融资工具	132380072. IB	8,225	100.0000	中国建设银 行股份有限 公司	承销团成员
64	23 华侨城 MTN005	企业债务 融资工具	102382594. IB	24,677	99.9225	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

65	23 锡公用 MTN001	企业债务 融资工具	102383015. IB	5, 483	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
66	23 中建海 峡 MTN001 (科 创票据)	企业债务 融资工具	102382971. IB	2, 741	102. 3835	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	23 菲达环 保 GN001 (科 创票据)	企业债务 融资工具	132380523. IB	5, 483	101. 2008	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	21 川能投 MTN002B	企业债务 融资工具	102101521. IB	16, 451	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
69	21 光明房 产 MTN003	企业债务 融资工具	102103020. IB	4, 661	101. 1723	中国建设银行 股份有限公司	承销团成员
70	22 华侨城 MTN004	企业债务 融资工具	102281525. IB	13, 709	99. 2410	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

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。

特此公告

建信理财有限责任公司

2024 年 06 月 30 日

附录一

建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 273 期（深圳专享）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，现对建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 273 期（深圳专享）
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)
收/受益 权	深圳前海华宝供应链有 限公司	22 前海华宝 A B017	92	5.30%	详见风 险分析	11,000.00

到期收益分配详见产品说明书。