

建信理财“嘉鑫”（最低持有 180 天）开放式理财产品第 1 期 2024 年三季度投资管理报告

报告日：2024 年 09 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 6,437,290,809.73 元。

一、报告期投资者实际收益率

截至 2024 年 09 月 30 日，产品单位净值为 1.138933。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	1.138933	1.138933	6,437,290,809.73
一个月前	1.138284	1.138284	6,259,526,227.09
二个月前	1.137752	1.137752	6,011,099,422.01
三个月前	1.135083	1.135083	5,336,369,461.75
六个月前	1.126925	1.126925	4,234,978,570.51
一年前	1.109803	1.109803	4,689,902,156.17

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	88,136.28	13.69%	236,512.57	36.06%
同业存单	0.00	0.00%	55,311.78	8.43%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	56,912.77	8.68%
债券	4,138.61	0.64%	267,924.23	40.85%
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%	39,252.37	5.98%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	551,622.03	85.67%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	643,896.92	100.00%	655,913.72	100.00%

本产品截至报告期末的穿透后杠杆率为：100.03%

注：穿透后杠杆率=期末穿透后总资产/期末穿透后净资产*100%

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	1,319,300,081.15	20.11%
2	R014	552,689,619.13	8.43%
3	20 邮储银行永续债	153,353,939.04	2.34%

4	定期存款	120,990,286.90	1.84%
5	定期存款	118,266,580.83	1.80%
6	21 邮储银行永续债 01	117,890,645.78	1.80%
7	24 兴业银行 CD196	106,875,221.61	1.63%
8	22 华夏银行二级资本债 01	102,274,246.58	1.56%
9	24 中信银行 CD247	99,373,603.33	1.51%
10	24 光大银行 CD145	98,464,550.14	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

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	44250100000200003361-0008	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 天成租赁 GN001 (碳中和债)	企业债务融资工具	132280054. IB	5,333	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
2	20 青岛国信 MTN003	企业债务融资工具	102000425. IB	5,333	101.1097	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
3	24 光大银行小微债	商业性金融债券	212400004. IB	31,998	100.4518	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	20 建发地产 MTN001	企业债务融资工具	102001046. IB	7,999	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
5	20 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2028048. IB	5,333	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
6	23 娄城高新 MTN001	企业债务融资工具	102381640. IB	2,666	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
7	21 工商银行永续债 02	商业性金融债券	2128044. IB	910,666	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
8	21 工商银行永续债 01	商业性金融债券	2128021. IB	718,665	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
9	24 交行债 01	商业性金融债券	212480013. IB	23,998	100.6270	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 粤珠江 MTN001	企业债务融资工具	102280694. IB	5,333	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
11	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	317,492	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
12	20 农业银行永续债 02	商业性金融债券	2028032. IB	21,332	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
13	24 光大银行债 01	商业性金融债券	212480005. IB	31,998	101.0650	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	10,666	101.1349	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
15	23 苏新国资 MTN001	企业债务融资工具	102380238. IB	14,929	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	22 洛阳城乡 MTN001	企业债务融资工具	102282164. IB	3,732	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
17	22 乌高新 MTN002	企业债务融资工具	102281994. IB	3,732	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 淮北建投 MTN004	企业债务融资工具	102281832. IB	3,732	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	23 连云城建 PPN001	企业债务融资工具	032380031. IB	11,196	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

20	22 浙江旅投 MTN002	企业债务融资工具	102281640. IB	11,196	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
21	21 建发 MTN002	企业债务融资工具	102103276. IB	107,887	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 新都香城 MTN001	企业债务融资工具	102280341. IB	7,464	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 泉州台商 MTN002	企业债务融资工具	102280528. IB	14,929	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	7,464	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	22 金合盛 MTN003 (科创票据)	企业债务融资工具	102281243. IB	11,196	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
26	22 威宁投资 MTN001	企业债务融资工具	102280258. IB	7,464	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	137,261	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 中行永续债 01	商业性金融债券	242480008. IB	137,261	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 工行永续债 01	商业性金融债券	242480007. IB	13,726	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	24 邮储永续债 01	商业性金融债券	242400004. IB	32, 027	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 昆仑金租债 01	商业性金融债券	2422012. IB	45, 753	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	23 招行永续债 01	商业性金融债券	242380033. IB	13, 726	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	24 徐工集团 MTN001 (科创票据)	企业债务融资工具	102482991. IB	73, 205	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	24 交行绿债 01	商业性金融债券	222480001. IB	36, 602	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	23 中广核 MTN002 (科创票据)	企业债务融资工具	102382834. IB	13, 726	100. 5637	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	24 农行永续债 01	商业性金融债券	242400005. IB	27, 452	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
37	24 华能水电 GN003B (科创票据)	企业债务融资工具	132480068. IB	45, 753	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	24 交行永续债 01BC	商业性金融债券	242400020. IB	137, 261	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	24 江西交投 MTN009	企业债务融资工具	102482908. IB	45, 753	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商, 承销团成员

						建设银行股份有限公司	
40	24 厦门火炬 MTN002	企业债务融资工具	102482765. IB	22, 876	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	24 深业 MTN003	企业债务融资工具	102483174. IB	45, 753	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	24 首都机场 MTN002B	企业债务融资工具	102483358. IB	22, 876	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
43	24 光大环境 MTN002B	企业债务融资工具	102481953. IB	91, 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
44	22 成都高新 MTN002	企业债务融资工具	102282555. IB	18, 301	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
45	24 南京港 MTN001	企业债务融资工具	102483159. IB	32, 027	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	24 皖能源 MTN001 (碳中和债)	企业债务融资工具	102481054. IB	27, 452	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	24 首都机场 MTN001 (绿色)	企业债务融资工具	102481032. IB	18, 301	100. 1328	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	23 无锡产业 ABN001 优先	资产支持证券	082300386. IB	13, 726	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	23 锡公用 MTN001	企业债务融资工具	102383015. IB	13, 726	100. 0000	中国建设银行股份有限	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
50	23 广核国际 MTN001	企业债务融资工具	102383120. IB	32, 027	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 巨化 MTN001 (可持续挂钩)	企业债务融资工具	102480599. IB	9, 150	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	24 南京旅游 MTN001	企业债务融资工具	102480035. IB	45, 753	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
53	24 克拉玛依 MTN001	企业债务融资工具	102482218. IB	9, 150	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
54	23 冀交投 MTN006	企业债务融资工具	102382917. IB	9, 150	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	23 昆山国创 MTN001	企业债务融资工具	102383289. IB	45, 753	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 南通经开 MTN004	企业债务融资工具	102382922. IB	4, 575	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	24 常熟发投 PPN003	企业债务融资工具	032480417. IB	45, 753	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
58	23 太保寿险永续债 01	商业性金融债券	282380002. IB	64, 055	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

59	24 恒泰 MTN001 (绿色)	企业债务融资工具	102481888. IB	13,726	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	22 建发地产 MTN003B	企业债务融资工具	102280667. IB	9,150	102.6078	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	24 上海银行二级资本债 01	商业性金融债券	232480050. IB	68,630	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
62	22 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2228011. IB	100,000	102.9319	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	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
64	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
65	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
66	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
67	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
68	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	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	
69	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
70	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
71	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
72	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
73	22 京汽股 GN002(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
74	23 广州高新 MTN001	企业债务融资工具	102380028. IB	127,324	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
75	22 泉州水务 MTN002	企业债务融资工具	102280794. IB	50,929	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
76	24 常熟交通 PPN004	企业债务融资工具	032480493. IB	127,324	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
77	24 优生活三 ABN001 优先	资产支持证券	082480071. IB	104,406	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
78	22 苏沙钢 MTN001	企业债务融资工具	102280043. IB	76,394	100.6192	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	
79	20 湘投 MTN001B	企业债务融资工具	102000609. IB	76,394	101.4113	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
80	22 苏州农业 MTN001	企业债务融资工具	102280821. IB	76,394	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
81	22 南通产业 MTN002	企业债务融资工具	102281931. IB	76,394	100.2318	建信信托有限责任公司	承销团成员
82	22 交子金融 GN001	企业债务融资工具	132280043. IB	25,464	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
83	22 恒泰 MTN001	企业债务融资工具	102280001. IB	50,929	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
84	22 华为 MTN003	企业债务融资工具	102280392. IB	25,464	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
85	24 光大环境 MTN003	企业债务融资工具	102484287. IB	15,757	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

(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09月30日