

# 建信理财嘉鑫固收类封闭式产品 2024 年第 93 期（新春专享）2024 年三季度投资管理报告

报告日：2024 年 09 月 30 日

建信理财嘉鑫固收类封闭式产品 2024 年第 93 期（新春专享）于 2024 年 02 月 20 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 65,414,286.76 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 1.021105。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	1.021105	1.021105	65,414,286.76
一个月前	1.022351	1.022351	65,494,092.67
二个月前	1.022251	1.022251	65,487,655.59
三个月前	1.018017	1.018017	65,216,445.35
六个月前	1.004186	1.004186	64,330,391.73
一年前	-	-	-

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
建信理财嘉鑫固收类封闭式产品 2024 年第 93 期（新春专享）	2024-02-07	2024-02-19	2024-02-20	2027-02-16

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广东省分行

### 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	58.83	0.90%	79.72	1.14%
同业存单	0.00	0.00%	0.00	0.00%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	0.00	0.00%
债券	0.00	0.00%	6,912.56	98.86%
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%	0.00	0.00%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	6,485.68	99.10%	0.00	0.00%
委托投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	6,544.51	100.00%	6,992.28	100.00%

本产品截至报告期末的穿透后杠杆率为：100.05%

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	21 工商银行永续债 01	3,664,525.21	5.24%
2	21 工商银行二级 02	3,654,346.51	5.23%
3	21 交通银行永续债	3,613,746.92	5.17%
4	21 邮储银行永续债 01	3,186,865.41	4.56%

5	21 兴业银行二级 02	3,145,061.12	4.50%
6	22 农业银行永续债 01	3,115,640.11	4.46%
7	22 交通银行二级 01	2,855,388.84	4.08%
8	22 兴业银行二级 01	2,599,672.38	3.72%
9	22 农行二级资本债 02A	2,529,677.82	3.62%
10	24 付息国债 04	2,523,725.62	3.61%

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

本产品募集资金投资于现金类资产、货币市场工具、货币市场基金、标准化固定收益类资产和其他符合监管要求的资产，持仓资产流动性较好、风险较低。

### （二）产品的投资风险情况

#### 1. 产品债券持仓风险及价格波动情况（针对固收类及混合类产品）

本产品募集资金主要投向高信用评级的债券，截止报告日产品债券持仓风险可控。

#### 2. 产品股票持仓风险及价格波动情况（针对权益类及混合类产品）

产品无股票持仓。

#### 3. 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况（针对商品及金融衍生品类与混合类产品）

产品无衍生品持仓。

## 六、托管人报告

在报告期内，本托管人严格按照国家法律法规、托管协议和其他有关规定，对产品财产估值的计算等方面进行了认真复核。

本托管人根据理财产品管理机构的委托，复核了投资管理报告中的份额净值、累计净值、资产净值、产品投资组合详细情况等内容。

在报告期内，本托管人及时准确地执行投资清算指令，办理托管资产名下的资金往来。并对照托管协议及理财产品说明书完成了对相应产品的会计核算及投资监督，未发现存在损害委托人利益的行为。

## 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	44050186320109 410483	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广东省分行

## 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 农行永续债 01	商业性金融债券	242380017. IB	4,957	101.0911	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 工商银行二级 02	商业性金融债券	2128051. IB	34,701	101.9980	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 国开 10	政策性金融债券	230210. IB	4,957	103.0117	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	22 国开行 二级资本 债 01A	政策性金 融债券	092202005. IB	2,478	100.3480	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	22 工商银 行二级 03	商业性金 融债券	2228024. IB	14,872	101.6186	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 农业银 行永续债 01	商业性金 融债券	2228011. IB	29,744	101.9203	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 行二级 01	商业性金 融债券	2228003. IB	24,787	101.8441	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 工商银 行二级 01	商业性金 融债券	2228004. IB	4,957	100.4346	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 01	商业性金 融债券	2128021. IB	35,197	103.1027	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	21 兴业银 行二级 02	商业性金 融债券	2128042. IB	29,744	102.1024	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	21 农业银 行永续债 01	商业性金 融债券	2128038. IB	20,821	102.3993	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 邮储永 续债 01	商业性金 融债券	242380019. IB	4,957	101.8545	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	20 工商银 行二级 01	商业性金 融债券	2028041. IB	4,957	102.5530	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	
14	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	11,402	101.2015	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	23 工行二级资本债 01A	商业性金融债券	232380015. IB	2,974	102.9707	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 工行二级资本债 04A	商业性金融债券	092280134. IB	4,957	100.1223	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	21 兴业银行二级 01	商业性金融债券	2128032. IB	20,821	102.4163	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 工行二级资本债 03A	商业性金融债券	092280065. IB	1,982	100.6988	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09月30日

附录一

建信理财嘉鑫固收类封闭式产品 2024 年第 93 期（新春专享）投资非标准化债权及股权类资产清单

报告日：2024 年 09 月 30 日

我司依照监管要求，现对建信理财嘉鑫固收类封闭式产品 2024 年第 93 期（新春专享）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）
------	--------	------	-----------	-----------	------	----------

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。