

建信理财嘉鑫固收类按日开放式产品第 14 期 2024 年三季
度投资管理报告

报告日：2024 年 09 月 30 日

建信理财嘉鑫固收类按日开放式产品第 14 期于 2024 年 03 月 21 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 28,950,585,609.27 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 1.011613。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	1.011613	1.011613	28,950,585,609.27
一个月前	1.010226	1.010226	35,035,792,958.08
二个月前	1.008798	1.008798	33,486,977,170.87
三个月前	1.007267	1.007267	26,799,134,983.06
六个月前	1.002073	1.002073	77,423,131.67
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按日开放式产品第 14 期	2024-03-20	2024-03-20	2024-03-21	-

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上海市分行

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	384,777.59	13.29%	2,205,486.61	76.15%
同业存单	0.00	0.00%	296,723.09	10.24%
拆放同业及买入返售	150,636.71	5.20%	227,435.76	7.85%
债券	0.00	0.00%	74,831.19	2.58%
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%	91,834.21	3.17%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	2,360,731.09	81.51%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	2,896,145.39	100.00%	2,896,310.87	100.00%

本产品截至报告期末的穿透后杠杆率为：100.04%

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	10,734,361,887.98	37.06%
2	GC007	1,506,367,134.11	5.20%
3	平安证券星耀烁华 2 号集合资产管理计划 DQ0000002	1,124,359,571.39	3.88%
4	农行蒙阳 20270426	829,242,399.85	2.86%
5	农行 20270430	621,773,243.83	2.15%

6	平安证券星耀烁华 2 号集合资产管理计划 IBD20240905300128	581,547,655.62	2.01%
7	农业 20270521	517,450,688.20	1.79%
8	农行桂洲 20270705	515,964,227.50	1.78%
9	农行容桂 20270705	515,964,227.50	1.78%
10	24 华夏银行 CD270	495,776,204.42	1.71%

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，资产流动性较好、流动性风险可控。

（二）市场情况

2024 年第 3 季度，稳增长政策和资本市场政策力度大超预期。十年期国债震荡下行，从二季度末的 2.20%下行到 2.15%；信用债先下后上，信用利差大幅走扩。展望后市，预计货币政策持续保持支持性，预计广谱利率将继续下行。

六、托管人报告

托管人在执行本理财产品的托管过程中，根据银监会的要求，严格遵守有关法律和保管合同的约定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何违背保管合同的行为。托管人未发现管理人有违背理财产品说明书约定的行为。

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	3105013636000010549	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上海市分行

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 工行永续债 01	商业性金融债券	242480007. IB	147,273	100.9884	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 湖北债 54	地方政府债券	2405686. IB	28,052	99.9200	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	24 重庆债 19	地方政府债券	2405456. IB	147,273	100.0261	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	24 江西债 59	地方政府债券	2405826. IB	28,052	99.9800	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	24 吉林债 17	地方政府债券	2405546. IB	70,130	99.9920	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	24 河北债 37	地方政府债券	2405537. IB	182,338	99.8707	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	24 交行绿债 01	商业性金融债券	222480001. IB	294,547	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
8	23 光大银行绿债 01	商业性金融债券	222380004. IB	42,078	101.5791	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	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	364,677	101.2575	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
10	22 三峡 GN003(碳中和债)	企业债务 融资工具	132280012. IB	7,013	100.3249	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	22 苏国信 GN001(碳中和债)	企业债务 融资工具	132280006. IB	14,026	100.6746	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
12	20 重庆轨 交 GN002	企业债务 融资工具	132000012. IB	7,013	101.2423	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
13	24 交行永 续债 01BC	商业性金 融债券	242400020. IB	49,091	100.6825	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	22 苏高新 GN001	企业债务 融资工具	132280005. IB	7,013	100.7580	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
15	24 天津轨 交 SCP003	企业债务 融资工具	012480458. IB	14,026	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
16	24 农行永 续债 02	商业性金 融债券	242400009. IB	224,417	101.4956	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	24 新疆债 29	地方政府 债券	2405628. IB	315,586	100.4070	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 厦翔业 SCP004	企业债务 融资工具	012483096. IB	42,078	100.0034	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 兴业银 行绿色金 融债 02	商业性金 融债券	2328018. IB	7,013	101.2801	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	24 华为 SCP003	企业债务 融资工具	012481439. IB	140,260	100.0010	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	24 南昌轨交 MTN001(绿色)	企业债务 融资工具	102480235. IB	7,013	101.5647	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	24 五凌电力 SCP001(资产担保科 创)	企业债务 融资工具	012482644. IB	7,013	100.0011	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	24 招商租赁 SCP008(绿色)	企业债务 融资工具	012481754. IB	42,078	100.0011	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	23 云能投 MTN005	企业债务 融资工具	102383266. IB	35,065	100.0020	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	24 湖北债 22	地方政府 债券	2405404. IB	35,065	100.9587	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	24 海运集装 MTN001(科创票据)	企业债务 融资工具	102481100. IB	119,221	100.0046	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 信达乾元 ABN001 优先 A1	资产支持 证券	082380804. IB	210,391	100.0067	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 贵州高速 CP001	企业债务 融资工具	042480259. IB	35,065	100.0012	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	20 重庆轨交 GN001	企业债务 融资工具	132000004. IB	49,091	101.1660	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
30	24 云能投 MTN002	企业债务 融资工具	102480131. IB	70,130	100.0017	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 吉林债 19	地方政府 债券	2405599. IB	140, 260	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

日期	资产管理 产品名称	投资类型	金额	份额	关联方名称
2024/7/2	建信基金 乐赢 2 号 集合资产 管理计划	申购	500, 000, 000. 00		建信基金管 理有限责任 公司
2024/7/4	建信资管 浦江安盈 添利 56 号 资产管理 产品	申购	2, 500, 000, 000. 00		建信保险资 产管理有限 公司
2024/7/11	建信基金 乐赢 2 号 集合资产 管理计划	申购	500, 000, 000. 00		建信基金管 理有限责任 公司
2024/8/5	建信基金 乐赢 2 号 集合资产 管理计划	申购	600, 000, 000. 00		建信基金管 理有限责任 公司
2024/8/28	建信基金 乐赢 6 号 单一资产 管理计划	申购	10, 000, 000. 00		建信基金管 理有限责任 公司
2024/9/12	建信基金 乐赢 6 号 单一资产 管理计划	申购	3, 000, 000, 000. 00		建信基金管 理有限责任 公司
2024/9/18	建信基金 乐赢 6 号 单一资产 管理计划	申购	3, 500, 000, 000. 00		建信基金管 理有限责任 公司
2024/9/20	建信基金 乐赢 6 号 单一资产 管理计划	申购	1, 400, 000, 000. 00		建信基金管 理有限责任 公司
2024/9/27	建信基金 乐赢 6 号 单一资产 管理计划	申购	80, 000, 000. 00		建信基金管 理有限责任 公司

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 09 月 30 日

附录一

建信理财嘉鑫固收类按日开放式产品第 14 期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按日开放式产品第 14 期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。