

建信理财嘉鑫固收类按日（尊享版）开放式产品 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（尊享版）开放式产品于 2023 年 12 月 06 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 35,940,553,083.11 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 1.017671。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	1.017671	1.017671	35,940,553,083.11
一个月前	1.016145	1.016145	42,343,929,913.06
两个月前	1.014687	1.014687	39,846,822,331.34
三个月前	1.012952	1.012952	35,929,096,311.39
六个月前	1.007975	1.007975	18,639,235,045.14
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（尊享版） 开放式产品	2023-11-30	2023-12-05	2023-12-06	-

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北京市分行

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	311,032.92	8.65%	1,308,344.28	36.84%
同业存单	0.00	0.00%	604,884.24	17.03%
拆放同业及买入返售	200,025.15	5.56%	659,553.30	18.57%
债券	3,505.63	0.10%	976,233.60	27.49%
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%	2,341.54	0.07%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	3,080,247.81	85.69%	0.00	0.00%
委托投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	3,594,811.51	100.00%	3,551,356.96	100.00%

本产品截至报告期末的穿透后杠杆率为：100.02%

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	8,880,488,801.79	25.01%
2	GC007	2,500,292,030.26	7.04%
3	GC028	1,163,772,352.84	3.28%

4	R007	1,019,462,610.70	2.87%
5	光大鄞州 20241014	914,789,899.88	2.58%
6	光大东城 20241014	914,789,899.88	2.58%
7	R008	889,843,965.88	2.51%
8	24 证金 D96	812,629,819.60	2.29%
9	24 证金 D94	812,565,861.78	2.29%
10	工行 20241021	730,429,470.85	2.06%

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

1. 托管资产保管

托管资产独立于管理人的自有资产及管理和其他资产，独立于中国建设银行的自有资产及其托管的其他资产，不同投资账户之间的托管资产之间互相独立。

我行按照国家相关规定，完整保存与托管资产有关的会计档案、与托管资产有关的投资记录、指令和所有合同等。

2. 会计核算和估值

我行与资产管理人按照约定的统一记账方法和会计处理原则，

独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值。按各自职责对托管资产会计核算的真实性、准确性、及时性和完整性负责。

3. 定期核对有关数据

我行与资产管理人按照合同约定定期进行账务核对并互相监督。

4. 投资监督

建设银行根据法规、托管协议以及双方制定的《投资监督事项表》，对贵司的资产管理产品的投资行为进行监督。

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	11050137510000009145	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北京市分行

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	23 兴业银行绿色金融债 02	商业性金融债券	2328018. IB	134, 627	101. 3603	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	23 兴业银行绿债 01	商业性金融债券	222380003. IB	44, 875	101. 4763	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 太仓城投 MTN002	企业债务融资工具	102483987. IB	291, 692	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
4	24 盛世融迪 2 优先 _bc	资产支持证券	2489120. IB	1, 086, 568	73. 7800	建信信托有限责任公司	计划管理人

5	24 物产中大 SCP007	企业债务融资工具	012483108. IB	1, 224, 378	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	23 南昌轨道交通 MTN001 (绿色)	企业债务融资工具	102380053. IB	44, 875	102. 1436	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 中四保供 ABN001 优先 (科创票据)	资产支持证券	082480608. IB	122, 437	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	24 苏沙钢 SCP004 (科创票据)	企业债务融资工具	012482390. IB	700, 000	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
9	24 苏豪 SCP001	企业债务融资工具	012483129. IB	800, 000	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
10	22 苏高新 GN001	企业债务融资工具	132280005. IB	500, 000	100. 4424	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
11	24 苏州园 ABN001 优先 C	资产支持证券	082480888. IB	370, 000	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
12	21 穗自来水 MTN004 (绿色)	企业债务融资工具	102103165. IB	100, 000	100. 4582	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
13	24 首钢股份 SCP003	企业债务融资工具	012482524. IB	600, 000	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
14	22 平安银行小微债	商业性金融债券	2228051. IB	2, 000, 000	100. 4551	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	24 徐工集团	企业债务融资工具	012482489. IB	800, 000	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销

	SCP015(科创票据)					公司, 中国建设银行股份有限公司	商, 承销团成员
16	24 江西交投 MTN009	企业债务融资工具	102482908. IB	300, 000	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	24 吴中经发 SCP010	企业债务融资工具	012482108. IB	400, 000	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	24 苏州园 ABN001 优先 D	资产支持证券	082480889. IB	1, 170, 000	100. 0018	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	24 招商租赁 SCP010	企业债务融资工具	012482562. IB	1, 300, 000	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	24 中交三航 SCP015(科创票据)	企业债务融资工具	012483077. IB	1, 300, 000	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	24 苏州高新 SCP045	企业债务融资工具	012482506. IB	800, 000	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
2024/7/1	建信信托凤鸣尊享日日盈 6 号集合信托计划	赎回	1, 908, 591, 812.33	1, 908, 591, 812.33	JXXTFMZ XRRY6H	建信信托有限责任公司
2024/7/2	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	JXXTFMZ XRRY6H	建信信托有限责任公司
2024/7/4	建信信托凤鸣尊享日日盈 13 号集合信托计划	申购	1, 500, 000, 000.00	1, 500, 000, 000.00	JXXTFMZ XRRY13H	建信信托有限责任公司
2024/7/5	建信信托凤鸣尊享日日盈 6 号集合信托计划	赎回	1, 908, 203, 942.20	1, 908, 203, 942.20	JXXTFMZ XRRY6H	建信信托有限责任公司

2024 /7/9	建信信托凤鸣尊享日 日盈 15 号集合信托计 划	申购	2,000,0 00,000. 00	2,000,0 00,000. 00	JXXTFMZ XRRY15H	建信信托有限 责任公司
2024 /7/9	建信信托凤鸣尊享日 日盈 6 号集合信托计 划	赎回	1,860,1 22,596. 39	1,860,1 22,596. 39	JXXTFMZ XRRY6H	建信信托有限 责任公司
2024 /7/1 5	建信信托凤鸣尊享日 日盈 6 号集合信托计 划	赎回	38,145, 081.00	38,145, 081.00	JXXTFMZ XRRY6H	建信信托有限 责任公司
2024 /7/2 3	建信信托凤鸣尊享日 日盈 15 号集合信托计 划	赎回	959,867 ,000.83	959,867 ,000.83	JXXTFMZ XRRY15H	建信信托有限 责任公司
2024 /7/2 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 00,000. 00	1,000,0 00,000. 00	JXXTFMZ XRRY13H	建信信托有限 责任公司
2024 /7/2 9	建信信托凤鸣尊享日 日盈 13 号集合信托计 划	赎回	1,908,5 33,530. 55	1,908,5 33,530. 55	JXXTFMZ XRRY13H	建信信托有限 责任公司
2024 /7/3 0	建信信托凤鸣尊享日 日盈 6 号集合信托计 划	申购	2,000,0 00,000. 00	2,000,0 00,000. 00	JXXTFMZ XRRY6H	建信信托有限 责任公司
2024 /7/3 1	建信期货-期享稳健 3 号单一资产管理计划	申购	1,000,0 00,000. 00	1,000,0 00,000. 00	JXQHGXW J3H	建信期货有限 责任公司
2024 /7/3 1	建信信托凤鸣尊享日 日盈 13 号集合信托计 划	赎回	477,084 ,213.95	477,084 ,213.95	JXXTFMZ XRRY13H	建信信托有限 责任公司
2024 /8/1	建信资本稳利 3 号集 合资产管理计划	申购	200,000 ,000.00	200,000 ,000.00	JXZBWL3 H	建信资本管理 有限责任公司
2024 /8/2	建信信托凤鸣尊享日 日盈 13 号集合信托计 划	申购	500,000 ,000.00	500,000 ,000.00	JXXTFMZ XRRY13H	建信信托有限 责任公司
2024 /8/7	建信信托凤鸣尊享日 日盈 6 号集合信托计 划	赎回	1,905,2 91,757. 33	1,905,2 91,757. 33	JXXTFMZ XRRY6H	建信信托有限 责任公司
2024 /8/7	建信信托凤鸣尊享日 日盈 13 号集合信托计 划	申购	2,000,0 00,000. 00	2,000,0 00,000. 00	JXXTFMZ XRRY13H	建信信托有限 责任公司
2024 /8/9	建信信托凤鸣尊享日 日盈 13 号集合信托计 划	申购	2,000,0 00,000. 00	2,000,0 00,000. 00	JXXTFMZ XRRY13H	建信信托有限 责任公司
2024 /8/1 6	建信信托凤鸣尊享日 日盈 13 号集合信托计 划	赎回	476,689 ,411.11	476,689 ,411.11	JXXTFMZ XRRY13H	建信信托有限 责任公司
2024 /8/1 9	建信基金安心宝 2 号 集合资产管理计划	申购	500,000 ,000.00	500,000 ,000.00	JXJJAXB 2H	建信基金管理 有限责任公司
2024 /8/1 9	建信期货-期享稳健 3 号单一资产管理计划	申购	500,000 ,000.00	500,000 ,000.00	JXQHGXW J3H	建信期货有限 责任公司

2024/8/19	建信信托凤鸣尊享日日盈 13 号集合信托计划	申购	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	JXXTFMZ XRRY13H	建信信托有限责任公司
2024/8/26	建信信托凤鸣尊享日日盈 13 号集合信托计划	赎回	1,905,765,607.98	1,905,765,607.98	JXXTFMZ XRRY13H	建信信托有限责任公司
2024/9/2	建信信托凤鸣尊享日日盈 13 号集合信托计划	申购	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00	JXXTFMZ XRRY13H	建信信托有限责任公司
2024/9/6	建信信托凤鸣尊享日日盈 13 号集合信托计划	申购	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	JXXTFMZ XRRY13H	建信信托有限责任公司
2024/9/9	建信信托凤鸣尊享日日盈 15 号集合信托计划	赎回	957,460,966.71	957,460,966.71	JXXTFMZ XRRY15H	建信信托有限责任公司
2024/9/9	建信期货-期享稳健 3 号单一资产管理计划	申购	500,000,000.00	500,000,000.00	JXQHQXW J3H	建信期货有限责任公司
2024/9/10	建信信托凤鸣尊享日日盈 13 号集合信托计划	赎回	476,069,418.54	476,069,418.54	JXXTFMZ XRRY13H	建信信托有限责任公司
2024/9/19	建信信托凤鸣尊享日日盈 13 号集合信托计划	赎回	1,427,539,521.43	1,427,539,521.43	JXXTFMZ XRRY13H	建信信托有限责任公司
2024/9/26	建信信托凤鸣尊享日日盈 13 号集合信托计划	赎回	1,902,674,399.14	1,902,674,399.14	JXXTFMZ XRRY13H	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 09 月 30 日

附录一

建信理财嘉鑫固收类按日（尊享版）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 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（尊享版）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（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。