

建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2022 年第 273 期（深圳专享）2024 年三季度投资管理报告

报告日：2024 年 09 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 703,888,435.93 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 1.013891。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	1.013891	1.055891	703,888,435.93
一个月前	1.013884	1.054884	703,883,320.48
二个月前	1.016482	1.056482	705,686,765.87
三个月前	1.014316	1.052816	704,183,089.04
六个月前	1.007070	1.041070	700,260,746.76
一年前	1.011000	1.032500	702,993,382.59

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	532.18	0.76%	893.32	1.07%
同业存单	0.00	0.00%	7,393.53	8.82%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	4.10	0.00%
债券	0.00	0.00%	73,809.51	88.00%
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%	1,188.46	1.42%
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%	584.97	0.70%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	69,875.20	99.24%	0.00	0.00%
委托投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	70,407.38	100.00%	83,873.90	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	21 工商银行永续债 01	20,987,010.90	2.50%
2	24 农行永续债 02	19,735,689.72	2.35%
3	21 交通银行永续债	19,551,435.64	2.33%
4	20 农业银行永续债 01	18,458,745.27	2.20%

5	20 光大银行永续债	17,629,772.75	2.10%
6	20 邮储银行永续债	15,372,536.44	1.83%
7	24 工行永续债 01	14,407,385.37	1.72%
8	22 农业银行永续债 01	14,246,389.26	1.70%
9	21 农业银行永续债 01	12,684,679.32	1.51%
10	23 邮储永续债 01	12,039,471.52	1.44%

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。股市主要指数均实现上涨，其中沪深 300 涨幅 16.07%，中证 1000 涨幅 16.6%，万得全 A 指数上涨 17.68%，市场或已走出底部。展望后市，货币政策需持续保持支持性，预计广谱利率将继续下行。

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 渤海银行永续债 01	商业性金融债券	242400026. IB	22,518	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 02	商业性金融债券	242400009. IB	195,908	100.6133	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 农行永续债 01	商业性金融债券	242400005. IB	105,835	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
4	23 招行永续债 01	商业性金融债券	242380033. IB	27,021	103.8138	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 邮储永续债 01	商业性金融债券	242380019. IB	112,591	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 农行永续债 01	商业性金融债券	242380017. IB	76,562	100.8273	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 交行二级资本债 01A	商业性金融债券	232480014. IB	38,281	101.3613	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 平安银行绿色金融债	商业性金融债券	2228056. IB	36,676	100.5168	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 中国银行永续债 01	商业性金融债券	2228023. IB	63,051	100.8366	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 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2228011. IB	136,010	101.9206	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 中行永续债 01	商业性金融债券	242480008. IB	83,317	99.9974	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	24 交行永续债 01BC	商业性金融债券	242400020. IB	72,058	100.2624	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	22 工商银行二级 01	商业性金融债券	2228004. IB	52,100	101.2917	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 兴业银行二级 01	商业性金融债券	2228003. IB	21,101	103.1936	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 工商银行二级 02	商业性金融债券	2128051. IB	22,518	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
16	21 兴业银行二级 02	商业性金融债券	2128042. IB	43,684	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
17	21 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2128038. IB	119,419	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
18	21 工商银行永续债 01	商业性金融债券	2128021. IB	201,581	102.9488	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	
19	21 国开绿 债 04 清发	政策性金 融债券	2102004QF. IB	2, 251	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
20	23 工行二 级资本债 02A	商业性金 融债券	232380036. IB	11, 259	103. 4743	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	20 中国银 行永续债 03	商业性金 融债券	2028053. IB	13, 510	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
22	23 赣投 MTN001	企业债务 融资工具	102381502. IB	11, 259	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	20 农业银 行永续债 02	商业性金 融债券	2028032. IB	116, 520	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
24	23 中行永 续债 01	商业性金 融债券	242380008. IB	51, 792	100. 6605	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 中国银 行永续债 02	商业性金 融债券	2228029. IB	72, 058	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
26	20 农业银 行永续债 01	商业性金 融债券	2028017. IB	180, 793	100. 9212	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	21 临沂投 资 MTN003	企业债务 融资工具	102102176. IB	2, 251	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	22 工商银 行二级 03	商业性金 融债券	2228024. IB	4, 503	103. 7130	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
29	24 贵州高 速 MTN005	企业债务 融资工具	102482920. IB	7, 013	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 厦国贸 控 MTN004	企业债务 融资工具	102481133. IB	22, 518	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	23 太平人 寿永续债 01	商业性金 融债券	282380005. IB	22, 518	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	24 云能投 MTN002	企业债务 融资工具	102480131. IB	15, 056	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	23 云能投 MTN005	企业债务 融资工具	102383266. IB	13, 510	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 苏州农 业 MTN001	企业债务 融资工具	102480287. IB	7, 881	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 交行二 级资本债 01A	商业性金 融债券	232380078. IB	22, 518	104. 3844	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	20 中国银 行永续债 02	商业性金 融债券	2028048. IB	47, 288	103. 2466	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 华电江 苏 MTN003	企业债务 融资工具	102482891. IB	9, 007	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 长安汇通 PPN001	企业债务融资工具	032191358. IB	6,755	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 交行绿债 01	商业性金融债券	222480001. IB	11,259	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 皖投集 MTN004	企业债务融资工具	102482871. IB	11,259	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 邮储永续债 01	商业性金融债券	242400004. IB	65,302	100.1610	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	21 工商银行永续债 02	商业性金融债券	2128044. IB	27,345	102.7870	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 湖南能源 MTN004	企业债务融资工具	102482248. IB	7,528	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 昆山国创 MTN007	企业债务融资工具	102282049. IB	22,518	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 南昌轨交 MTN001 (绿色)	企业债务融资工具	102480235. IB	4,503	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 兴业银行二级 01	商业性金融债券	2128032. IB	60,279	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
47	22 新庐陵 MTN001	企业债务融资工具	102281265. IB	31,525	100.0000	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	
48	22 中建设 资 MTN001 (绿色)	企业债务 融资工具	102280709. IB	1, 801	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
49	24 首钢 MTN003A	企业债务 融资工具	102483096. IB	11, 259	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
50	22 广东环 保 MTN001 (绿色)	企业债务 融资工具	102281080. IB	6, 755	100. 5768	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	21 淄博城 资 MTN002	企业债务 融资工具	102103081. IB	24, 770	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
52	24 大唐发 电 GN001 (碳 中和债)	企业债务 融资工具	132480080. IB	13, 510	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	22 北部湾 MTN001	企业债务 融资工具	102280032. IB	15, 762	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	21 晋能电 力 MTN015	企业债务 融资工具	102103210. IB	31, 525	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	21 渝高建 投 MTN001	企业债务 融资工具	102102220. IB	13, 510	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
56	21 淮安国 投 MTN003	企业债务 融资工具	102103248. IB	6, 755	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 南京旅 游	企业债务 融资工具	102481250. IB	15, 762	100. 0000	中国建设银行 股份有限	主承销商或 联席承销

	MTN001(资产担保)					公司, 中国建设银行股份有限公司	商, 承销团成员
58	21 淄博城运 MTN003	企业债务融资工具	102103220. IB	15, 762	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
59	24 工行永续债 01	商业性金融债券	242480007. IB	144, 116	100. 3966	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	24 天津轨交 SCP003	企业债务融资工具	012480458. IB	4, 503	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
61	24 三一 MTN001(科创票据)	企业债务融资工具	102480799. IB	38, 281	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 五凌 1 号 ABN001 优先 A	资产支持证券	082280989. IB	6, 755	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
63	22 合肥产投 MTN001(科创票据)	企业债务融资工具	102281241. IB	38, 281	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
64	22 工行二级资本债 04A	商业性金融债券	092280134. IB	6, 755	103. 0048	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	11, 259	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
66	24 西安高新 MTN002	企业债务融资工具	102480325. IB	11, 259	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
67	21 江门高新 MTN001	企业债务融资工具	102103204. IB	6, 755	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

						建设银行股份有限公司	成员
68	22 云天化 MTN001	企业债务融资工具	102281519. IB	22, 518	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	24 天津港 MTN001 (科创票据)	企业债务融资工具	102480047. IB	11, 259	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
70	21 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2128045. IB	3, 090	103. 3126	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	24 崇川国资 SCP001	企业债务融资工具	012482445. IB	515	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
72	24 湖南能源 MTN005A	企业债务融资工具	102483034. IB	515	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
73	21 兴业银行二级 03	商业性金融债券	2128043. IB	17, 364	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
74	21 工商银行二级 01	商业性金融债券	2128002. IB	11, 576	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
75	23 华能水电 GN017 (科创票据)	企业债务融资工具	132380072. IB	8, 682	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
76	23 菲达环保 GN001 (科创票据)	企业债务融资工具	132380523. IB	8, 682	101. 5612	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	23 华侨城 MTN005	企业债务融资工具	102382594. IB	26, 046	99. 9225	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

						建设银行股份有限公司	成员
78	23 锡公用 MTN001	企业债务融资工具	102383015. IB	5,788	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
79	23 中建海峡 MTN001 (科创票据)	企业债务融资工具	102382971. IB	2,894	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
80	20 工商银行二级 01	商业性金融债券	2028041. IB	8,682	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
81	23 新疆发电 MTN001 (绿色)	企业债务融资工具	102382488. IB	7,235	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
82	24 诚通控股 MTN013A	企业债务融资工具	102482011. IB	8,682	104.1090	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
83	21 光明房产 MTN003	企业债务融资工具	102103020. IB	4,919	101.1723	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
84	22 华侨城 MTN004	企业债务融资工具	102281525. IB	14,470	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 09 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 09 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)
------	--------	------	-------------------	-------------------	----------	--------------

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。