

建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2024 年第 134 期 2024 年 三季度投资管理报告

报告日：2024 年 09 月 30 日

建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2024 年第 134 期于 2024 年 05 月 07 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 803,869,773.49 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 1.008240。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	1.008240	1.008240	803,869,773.49
一个月前	1.009238	1.009238	804,665,134.58
二个月前	1.008777	1.008777	804,297,770.59
三个月前	1.005348	1.005348	801,564,054.11
六个月前	-	-	-
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
建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2024 年第 134 期	2024-04-25	2024-05-06	2024-05-07	2025-03-27

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	227.63	0.28%	6,330.31	6.48%
同业存单	0.00	0.00%	9,314.03	9.53%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	0.00	0.00%
债券	0.00	0.00%	81,486.37	83.36%
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%	618.32	0.63%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	80,173.93	99.72%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	80,401.56	100.00%	97,749.03	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	63,303,096.57	6.48%
2	20 光大银行永续债	47,986,311.43	4.91%
3	21 招商银行永续债	46,873,723.96	4.80%
4	21 工商银行永续债 01	45,330,863.81	4.64%
5	20 广发银行二级 01	41,005,428.42	4.19%

6	21 交通银行永续债	39,349,700.06	4.03%
7	20 兴业银行永续债	36,565,207.43	3.74%
8	21 农业银行永续债 01	33,186,928.03	3.40%
9	20 邮储银行永续债	31,265,857.61	3.20%
10	19 陕延油 MTN011	28,923,380.24	2.96%

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，信用利差大幅走阔。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

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	31050136360000 010679	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	23 盐城交通 CP002	企业债务融资工具	042380760. IB	11,114	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
2	19 湘投 MTN001B	企业债务融资工具	101901431. IB	42,604	101.8953	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	19 陕延油 MTN011	企业债务融资工具	101901505. IB	277,857	101.9403	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	21 昆山国创 MTN001	企业债务融资工具	102101868. IB	92,619	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
5	21 晋焦煤 MTN006	企业债务融资工具	102102163. IB	74,095	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	21 凌云工业 MTN001	企业债务融资工具	102102277. IB	14,819	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
7	21 鲁黄金 MTN011	企业债务融资工具	102102281. IB	55,571	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
8	22 陕煤化 MTN004	企业债务融资工具	102280336. IB	18,523	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	22 昆山国创 MTN001	企业债务融资工具	102280389. IB	18,523	100.0000	中国建设银行股份有限公司	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
10	23 云能投 MTN005	企业债务融资工具	102383266. IB	18, 523	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
11	24 云能投 MTN002	企业债务融资工具	102480131. IB	38, 227	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
12	24 皖投集 MTN004	企业债务融资工具	102482871. IB	18, 523	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
13	24 江西交投 MTN009	企业债务融资工具	102482908. IB	3, 704	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	24 贵州高速 MTN005	企业债务融资工具	102482920. IB	20, 572	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
15	24 湖南能源 MTN005A	企业债务融资工具	102483034. IB	11, 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
16	24 首钢 MTN003A	企业债务融资工具	102483096. IB	25, 933	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	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	229, 922	100. 7252	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	20 农业银行永续债 02	商业性金融债券	2028032. IB	52, 880	102. 6711	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	21 工商银行永续债 01	商业性金融债券	2128021. IB	435,402	102.3091	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	21 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2128038. IB	312,441	102.3452	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	21 兴业银行二级 02	商业性金融债券	2128042. IB	56,978	103.2953	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	21 工商银行永续债 02	商业性金融债券	2128044. IB	94,585	103.4403	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	21 工商银行二级 02	商业性金融债券	2128051. IB	100,028	103.2129	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 光大银行绿债 01	商业性金融债券	222380004. IB	11,114	101.0696	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 兴业银行二级 01	商业性金融债券	2228003. IB	29,161	103.0465	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 工商银行二级 01	商业性金融债券	2228004. IB	51,866	102.7799	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	22 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2228011. IB	218,581	103.2923	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	125,962	103.6739	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	
29	23 招行永续债 01	商业性金融债券	242380033. IB	37,047	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	37,047	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 农行永续债 01	商业性金融债券	242400005. IB	37,047	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 农行永续债 02	商业性金融债券	242400009. IB	55,571	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 交行永续债 01BC	商业性金融债券	242400020. IB	37,047	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 工行永续债 01	商业性金融债券	242480007. IB	37,047	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	24 中行永续债 01	商业性金融债券	242480008. IB	37,047	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
36	23 太平人寿永续债 01	商业性金融债券	282380005. IB	18,523	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	21 兴业银行二级 01	商业性金融债券	2128032. IB	6,146	103.8284	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 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2128045. IB	24,587	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
39	24 崇川国资 SCP001	企业债务融资工具	012482445. IB	4,097	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	22 平安银行绿色金融债	商业性金融债券	2228056. IB	40,979	100.4706	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 湖南能源 MTN004	企业债务融资工具	102482248. IB	6,146	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（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 2024 年第 134 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，现对建信理财睿鑫固收类封闭式产品 2024 年第 134 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。