

建信理财“安鑫”（最低持有 360 天）按日开放固定收益类净值型人民币理财产品 2022 年四季度暨年度投资管理报告

报告日：2022 年 12 月 31 日

建信理财“安鑫”（最低持有 360 天）按日开放固定收益类净值型人民币理财产品于 2019 年 01 月 09 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 3,644,305,433.37 元。

一、报告期投资者实际收益率

截至 2022 年 12 月 31 日，产品单位净值为 1.129275。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 (报告期末最后一个市场交易日)	1.129275	1.129275	3,644,305,433.37
一个月前	1.136114	1.136114	4,345,581,644.49
二个月前	1.146787	1.146787	4,952,856,851.65
三个月前	1.144282	1.144282	5,172,322,492.60
六个月前	1.135019	1.135019	5,876,050,916.37
一年前	1.118855	1.118855	6,689,337,170.96

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“安鑫”（最低持有 360 天）按日开放固定收益类净值型人民币理财产品	2018-12-29	2019-01-08	2019-01-09	-

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、期末资产持仓穿透后穿透前

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	52,420.95	14.36%	62,481.87	14.86%
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%	357,481.19	85.04%
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%	387.30	0.09%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	312,624.84	85.64%	0.00	0.00%
委托投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	365,045.80	100.00%	420,350.36	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.18%

注：杠杆比例=期末穿透前资产合计/期末资产净值。

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	18 闽电 01	132,732,136.99	3.11%

2	21 狮产 01	124,385,589.04	2.91%
3	21 象金 02	91,301,547.94	2.14%
4	21 甘公投 MTN002(乡村振兴)	91,210,410.30	2.14%
5	21 滨建投 MTN001	89,202,328.77	2.09%
6	20 农垦 MTN001	73,561,945.21	1.72%
7	21 宁经开 MTN001	61,783,244.65	1.45%
8	21 益阳城投 MTN001	60,807,698.63	1.42%
9	21 江西铁航 ABN001 优先	57,679,699.12	1.35%
10	21 建发地产 MTN005	54,806,546.40	1.28%

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，故产品的流动性较好、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）

截至本报告日，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。

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	44050186320100002329-0098	中国建设银行股份有限公司广东省分行投资银行理财产品托管专户	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	21 托克集团 PPN001	企业债务融资工具	032191420. IB	4, 050	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
2	22 津城建 CP004	企业债务融资工具	042280222. IB	2, 025	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

3	22 三峡 GN010(碳中和债)	企业债务 融资工具	132280114. IB	1, 012	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
4	20 声赫鞍 钢 ABN001 优先	资产支持 证券	082000940. IB	10, 125	100. 0000	建信信托有 限责任公 司, 中国建 设银行股份 有限公司	计划管理 人, 主承销 商或联席承 销商
5	21 前海北 投 ABN001 优先	资产支持 证券	082100552. IB	12, 150	102. 0964	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
6	22 洛阳城 乡 MTN001	企业债务 融资工具	102282164. IB	6, 075	100. 0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
7	22 北部湾 投 MTN003	企业债务 融资工具	102282098. IB	4, 050	100. 0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
8	22 桂铁投 MTN004	企业债务 融资工具	102281751. IB	230, 200	100. 0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
9	22 中航租 赁 MTN006	企业债务 融资工具	102281646. IB	22, 276	100. 0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
10	22 云能投 CP001	企业债务 融资工具	042280304. IB	14, 175	100. 0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
11	21 淮安国 投 MTN003	企业债务 融资工具	102103248. IB	4, 050	100. 0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
12	21 云能投 MTN001	企业债务 融资工具	102101487. IB	10, 125	100. 9019	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
13	21 河钢集 MTN008	企业债务 融资工具	102103281. IB	6, 075	100. 0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
14	21 昆明轨 道 MTN001	企业债务 融资工具	102101052. IB	6, 075	102. 5156	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
15	21 临沂投 资 MTN002(革 命老区)	企业债务 融资工具	102102008. IB	4, 050	102. 3179	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
16	18 津城建 MTN009	企业债务 融资工具	101800378. IB	38, 476	100. 2507	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
17	20 建发地 产 MTN002	企业债务 融资工具	102001194. IB	8, 100	102. 0059	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商

18	19 济宁城投 MTN001	企业债务融资工具	101900122. IB	8,100	100.9908	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
19	20 云南交投 MTN001	企业债务融资工具	102000962. IB	14,175	98.8937	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
20	22 华发 MTN003	企业债务融资工具	102280400. IB	142,441	101.3575	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
21	22 匈牙利债 01BC	外国债券	092280143. IB	2,025	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
22	21 北部湾 MTN004	企业债务融资工具	102101469. IB	32,401	102.4198	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
23	20 淄博城运 MTN001	企业债务融资工具	102000175. IB	18,225	102.3433	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
24	20 闽建工 MTN002	企业债务融资工具	102001190. IB	10,125	101.7599	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
25	22 乌高新 MTN002	企业债务融资工具	102281994. IB	4,050	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
26	21 云能投 MTN002	企业债务融资工具	102101660. IB	400,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
27	21 益阳城投 MTN001	企业债务融资工具	102102158. IB	600,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
28	21 建发地产 MTN005	企业债务融资工具	102103045. IB	537,804	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
29	21 津城建 MTN002	企业债务融资工具	102102298. IB	500,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
30	21 宁经开 MTN001	企业债务融资工具	102102237. IB	613,413	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
31	21 保利久联 MTN002	企业债务融资工具	102102180. IB	300,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
32	21 飞驰星火 ABN001 优先	资产支持证券	082101095. IB	190,000	100.0000	建信信托有限责任公司, 中国建设银行股份有限公司	计划管理人, 主承销商或联席承销商

33	22 国贸房产 MTN001	企业债务融资工具	102281839. IB	56,706	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
34	22 淮北建投 MTN004	企业债务融资工具	102281832. IB	18,902	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
35	22 联发集团 MTN002	企业债务融资工具	102281663. IB	37,804	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
36	22 华发集团 MTN010(科创票据)	企业债务融资工具	102281535. IB	378,044	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
37	22 广投金控 MTN002	企业债务融资工具	102281483. IB	94,511	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
38	22 淮北建投 MTN003	企业债务融资工具	102281419. IB	37,804	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
39	22 云南交投 MTN001	企业债务融资工具	102280415. IB	75,608	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
40	21 丰城发投 PPN002	企业债务融资工具	032191345. IB	37,804	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
41	22 威宁投资 MTN001	企业债务融资工具	102280258. IB	56,706	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
42	22 建发地产 MTN005	企业债务融资工具	102200182. IB	226,826	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
43	21 金阳投资 MTN002	企业债务融资工具	102180035. IB	132,315	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
44	22 北部湾 MTN001	企业债务融资工具	102280032. IB	75,608	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
45	21 天津港 MTN002	企业债务融资工具	102102204. IB	18,902	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
46	21 金阳投资 MTN001	企业债务融资工具	102101991. IB	132,315	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
47	21 建发 MTN002	企业债务融资工具	102103276. IB	189,022	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

48	21 冀旅投 MTN001	企业债务融资工具	102102289. IB	37,804	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
49	21 平度国资 MTN001	企业债务融资工具	102103182. IB	170,120	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
50	21 淮矿上信 ABN001 优先	资产支持证券	082101481. IB	378,044	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
51	21 成都益民 MTN002	企业债务融资工具	102101924. IB	94,511	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
52	21 光穗铜冠 ABN001 优先	资产支持证券	082101007. IB	113,413	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
53	21 渝兴永 MTN001	企业债务融资工具	102101916. IB	94,511	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
54	22 渝医药 MTN001	企业债务融资工具	102280164. IB	56,706	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
55	22 建发地产 MTN001B(并购)	企业债务融资工具	102280206. IB	189,022	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
56	21 长城资本债 01BC	商业性金融债券	092100012. IB	378,044	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
57	21 益阳交投 MTN002	企业债务融资工具	102101823. IB	30,243	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
58	20 建发地产 MTN003	企业债务融资工具	102001450. IB	94,511	102.1694	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
59	21 建发 MTN001	企业债务融资工具	102101832. IB	132,315	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
60	22 飞驰强链 ABN001 优先	资产支持证券	082280559. IB	111,523	99.9000	建信信托有限责任公司, 中国建设银行股份有限公司	计划管理人, 主承销商或联席承销商
61	22 渝兴永 MTN001	企业债务融资工具	102280163. IB	7,560	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
62	20 建发地产 MTN005	企业债务融资工具	102001941. IB	37,804	102.5172	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

63	21 飞驰淮信 ABN001 优先	资产支持证券	082100917. IB	132, 315	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
64	21 青岛黄岛 PPN002	企业债务融资工具	032101095. IB	94, 511	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
65	22 平度城投 MTN001	企业债务融资工具	102281550. IB	113, 413	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
66	22 飞驰财信 ABN002 优先	资产支持证券	082280586. IB	283, 533	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
67	21 江西铁航 ABN001 优先	资产支持证券	082100975. IB	567, 066	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
68	22 粤澳 ABN001 优先	资产支持证券	082280418. IB	37, 804	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
69	22 前海河钢 ABN001 优先	资产支持证券	082280208. IB	189, 022	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
70	22 象屿 MTN001 (科创票据)	企业债务融资工具	102281255. IB	37, 804	100. 0703	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

（二）其他重大关联交易

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。

十一、其他

本报告披露的产品净值及份额净值经过安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计确认。

特此公告

建信理财有限责任公司

2022 年 12 月 31 日

附录一

建信理财“安鑫”（最低持有 360 天）按日开放固定收益类净值型人民币理财产品投资非标准化债权及股权类资产清单

报告日：2022 年 12 月 31 日

我司依照监管要求，现对建信理财“安鑫”（最低持有 360 天）按日开放固定收益类净值型人民币理财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）	风险状况
------	--------	------	-----------	------

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。