

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 2024 年一季度投资管理报告

报告日：2024 年 03 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 9,192,614,971.05 元。

一、报告期投资者实际收益率

截至 2024 年 03 月 31 日，产品单位净值为 1.185494。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	1.185494	1.185494	9,192,614,971.05
一个月前	1.183301	1.183301	7,998,065,454.11
二个月前	1.176196	1.176196	6,848,763,108.62
三个月前	1.170266	1.170266	5,800,530,867.29
六个月前	1.158635	1.158635	4,532,779,286.47
一年前	1.141972	1.141972	3,260,350,064.41

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

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	116,872.01	12.71%	131,374.06	12.67%
同业存单	0.00	0.00%	80,578.56	7.77%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	40,000.04	3.86%
债券	0.00	0.00%	701,309.88	67.66%
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%	83,280.81	8.03%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	802,629.16	87.29%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	919,501.17	100.00%	1,036,543.35	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.03%

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	R001	400,000,400.00	3.81%
2	21 工商银行永续债 01	338,020,444.91	3.22%
3	21 农业银行永续债 01	235,798,718.20	2.24%
4	24 农行永续债 01	179,913,363.56	1.71%

5	24 邮储永续债 01	179,855,146.51	1.71%
6	23 农行永续债 01	175,606,903.51	1.67%
7	20 农业银行永续债 01	171,913,015.14	1.64%
8	22 农业银行永续债 01	171,617,893.71	1.63%
9	21 交通银行永续债	158,393,993.26	1.51%
10	23 邮储永续债 01	150,281,540.11	1.43%

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	4405018632010002329-0098	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 建发地产 MTN005	企业债务融资工具	102103045. IB	20,000	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
2	23 交通银行小微债 01	商业性金融债券	2328006. IB	400,000	100.4732	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	21 保利久联 MTN002	企业债务融资工具	102102180. IB	323,525	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
4	19 工商银行永续债	商业性金融债券	1928018. IB	1,260,858	101.7518	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
5	23 太平人 寿永续债 01	商业性金 融债券	282380005. IB	1, 076, 818	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 太保寿 险永续债 01	商业性金 融债券	282380002. IB	466, 621	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	23 邮储永 续债 01	商业性金 融债券	242380019. IB	1, 435, 758	100. 2554	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 招行永 续债 01	商业性金 融债券	242380033. IB	933, 242	100. 3485	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 农行永 续债 01	商业性金 融债券	242400005. IB	1, 794, 698	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 粤澳 ABN001 优 先	资产支持 证券	082280418. IB	71, 787	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	21 长城资 本债 01BC	商业性金 融债券	092100012. IB	717, 879	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	21 成都益 民 MTN002	企业债务 融资工具	102101924. IB	107, 681	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	22 岳阳城 投 MTN001	企业债务 融资工具	102281970. IB	502, 515	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
14	23 农行永 续债 01	商业性金 融债券	242380017. IB	1, 687, 016	100. 3934	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	
15	22 联发集 MTN002	企业债务 融资工具	102281663. IB	71,787	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 桂交投 MTN007	企业债务 融资工具	102481146. IB	71,787	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	23 平度城 投 MTN001	企业债务 融资工具	102380355. IB	71,787	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 天津港 MTN001 (科 创票据)	企业债务 融资工具	102480047. IB	179,469	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
19	22 建发地 产 MTN001B (并 购)	企业债务 融资工具	102280206. IB	358,939	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 邮储永 续债 01	商业性金 融债券	242400004. IB	1,794,698	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	22 华发集 团 MTN010 (科 创票据)	企业债务 融资工具	102281535. IB	717,879	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
22	22 飞驰强 链 ABN001 优先	资产支持 证券	082280559. IB	211,774	99.6700	建信信托有 限责任公 司, 中国建 设银行股份 有限公司, 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, 承销 团成员
23	22 飞驰财 信 ABN002 优先	资产支持 证券	082280586. IB	538,409	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	
24	23 华电四川 ABN001 优先	资产支持证券	082380845. IB	71,787	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
25	23 工行二级资本债 02A	商业性金融债券	232380036. IB	35,893	101.7989	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 威宁投资 MTN001	企业债务融资工具	102280258. IB	107,681	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
27	22 广投金控 MTN002	企业债务融资工具	102281483. IB	179,469	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 云南交投 MTN001	企业债务融资工具	102280415. IB	71,787	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
29	22 库尔勒 PPN001	企业债务融资工具	032280235. IB	11,762	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
30	21 山河智能 ABN002 优先 A2	资产支持证券	082101458. IB	47,051	7.9600	建信信托有限责任公司, 中国建设银行股份有限公司, 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, 承销团成员
31	20 中原金控 MTN001	企业债务融资工具	102000182. IB	64,695	96.4716	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	22 渝兴永 MTN002	企业债务融资工具	102200124. IB	5,881	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

						份有限公司	
33	22 广投金控 MTN001	企业债务融资工具	102280777. IB	58,814	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	22 津城建 MTN004	企业债务融资工具	102281111. IB	5,881	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	22 云能投 MTN001	企业债务融资工具	102281178. IB	41,170	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	22 津城建 MTN007	企业债务融资工具	102281362. IB	35,288	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	22 云投 MTN001	企业债务融资工具	102281793. IB	11,762	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
38	22 广投金控 MTN001 (绿色)	企业债务融资工具	102282002. IB	58,814	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	22 楚天智能 MTN001	企业债务融资工具	102281666. IB	50,914	99.9958	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
40	20 湘投 MTN001B	企业债务融资工具	102000609. IB	25,457	101.4511	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	23 光大银行债 02	商业性金融债券	212380020. IB	101,829	100.1611	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	22 皖投集 MTN001	企业债务融资工具	102281386. IB	50,914	100.1625	中国建设银行股份有限公司	承销团成员

43	22 中节能 MTN001	企业债务融资工具	102280252. IB	50,914	100.1276	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 工商银行二级 01	商业性金融债券	2228004. IB	956,482	101.9466	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	21 工商银行永续债 02	商业性金融债券	2128044. IB	1,366,305	102.4925	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 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2128038. IB	2,257,552	102.9480	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	21 兴业银行二级 01	商业性金融债券	2128032. IB	480,985	103.1091	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
48	21 工商银行二级 02	商业性金融债券	2128051. IB	472,273	102.3597	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	21 工商银行永续债 01	商业性金融债券	2128021. IB	3,173,301	102.9978	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	20 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2028048. IB	43,476	103.7328	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	24 华侨城 MTN001	企业债务融资工具	102480183. IB	304,335	99.3865	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	20 工商银行二级 02	商业性金融债券	2028049. IB	120,113	102.8882	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	
53	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	1, 648, 881	101. 2060	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	建信中短债纯债 A	债券基金	006989. OF	41, 532, 313	1. 0468	建信基金管理有限责任公司	基金管理人
55	23 华侨城 MTN005	企业债务融资工具	102382594. IB	565, 193	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
56	22 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2228011. IB	1, 667, 937	102. 6915	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	23 津城建 MTN005	企业债务融资工具	102382514. IB	130, 429	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
58	21 华侨城 MTN004	企业债务融资工具	102102038. IB	304, 335	100. 7755	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	21 兴业银行二级 02	商业性金融债券	2128042. IB	167, 937	102. 5974	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	20 工商银行二级 01	商业性金融债券	2028041. IB	361, 970	102. 9992	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
61	22 工行二级资本债 03A	商业性金融债券	092280065. IB	434, 764	101. 5099	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	20 农业银行永续债 02	商业性金融债券	2028032. IB	512, 525	102. 8015	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	
63	21 工商银 行二级 01	商业性金 融债券	2128002. IB	700, 000	103. 1356	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	19 进出 11	政策性金 融债券	190311. IB	37, 508	101. 1686	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

（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 03 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：2024 年 03 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。