

# 建信理财“嘉鑫”（最低持有 100 天）按日开放固收类净值型理财产品第 1 期 2022 年三季度投资管理报告

报告日：2022 年 09 月 30 日

建信理财“嘉鑫”（最低持有 100 天）按日开放固收类净值型理财产品第 1 期于 2021 年 07 月 29 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 46,375,948,186.32 元。

## 一、报告期投资者实际收益率

截至 2022 年 09 月 30 日，产品单位净值为 1.040488。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)	1.040488	1.040488	46,375,948,186.32
一个月前	1.039229	1.039229	44,957,547,312.59
两个月前	1.037314	1.037314	43,120,235,206.91
三个月前	1.033638	1.033638	40,700,091,076.20
六个月前	1.023085	1.023085	35,714,912,585.58
一年前	1.006150	1.006150	4,734,719,343.80

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”（最低持有 100 天）按日开放固收类净值型理财产品第 1 期	2021-07-26	2021-07-28	2021-07-29	-

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、期末资产持仓穿透后穿透前

资产类别	穿透前金额	占全部产品总资产	穿透后金额	占全部产品总资产
------	-------	----------	-------	----------

	(万元)	产的比例 (%)	(万元)	产的比例 (%)
现金及银行存款	542,126.98	11.68%	1,217,146.30	24.36%
同业存单	0.00	0.00%	71,057.57	1.42%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	0.00	0.00%
债券	0.00	0.00%	2,904,361.63	58.12%
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%	1,213.93	0.02%
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%	803,036.71	16.08%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	4,097,802.57	88.32%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	4,639,929.55	100.00%	4,996,816.14	100.00%

#### 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	广发货币 B	725,546,080.70	1.45%
2	鹏华金元宝货币	619,383,319.12	1.24%
3	广发活期宝 B	607,169,210.63	1.22%
4	华夏惠利货币 B	593,299,587.14	1.19%
5	交银天鑫宝货币 E	564,553,449.75	1.13%
6	博时合惠货币 B	546,350,253.87	1.09%
7	广发天天红货币 B	544,970,395.20	1.09%
8	鹏华添利宝货币 B	544,956,778.10	1.09%

9	易方达现金增利货币 B	503,843,978.57	1.01%
10	19 国开 08	411,770,630.14	0.83%

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、货币基金等高流动性资产，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）

截至本季度末，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。

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

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 006370	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	交易数量	交易净价	关联方名称	关联方角色
1	21 中国信达债 01	商业性金融债券	092100008. IB	16,152	100.2193	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
2	22 广州地铁 SCP006	企业债务融资工具	012283389. IB	11,885	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	17 华发集团 MTN002	企业债务融资工具	101752047. IB	356,567	102.6535	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
4	22 宿迁经开 CP001	企业债务融资工具	042280026. IB	65,370	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
5	22 溧水产投 PPN002	企业债务融资工具	032280367. IB	175,316	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
6	22 宿迁经开 CP002	企业债务融资工具	042280227. IB	74,127	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	20 晋能 MTN018	企业债务融资工具	102002042. IB	11,885	102.9723	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
8	22 华阳新材 MTN002	企业债务融资工具	102280404. IB	70,697	100.8594	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
9	17 华发集团 MTN001	企业债务融资工具	101752044. IB	83,198	101.8447	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
10	20 北部湾 MTN003	企业债务融资工具	102001383. IB	1,303,800	101.2859	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
11	21 昆明轨道 MTN001	企业债务融资工具	102101052. IB	160,760	102.1244	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
12	21 越秀小微 ABN003 优先 A2	资产支持证券	082101398. IB	360,000	58.2000	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

						有限公司	
13	21 淮矿上信 ABN001 优先	资产支持证券	082101481. 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
14	22 威宁投资 MTN001	企业债务融资工具	102280258. IB	200,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
15	21 托克集团 PPN001	企业债务融资工具	032191420. IB	200,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
16	18 海尔金控 MTN001	企业债务融资工具	101801448. IB	500,000	101.8395	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
17	21 光穗山钢 ABN002 优先	资产支持证券	082101463. IB	1,303,800	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
18	万融 06 优	资产支持证券	193666. SH	390,000	99.9990	建信资本管理有限责任公司	计划管理人
19	22 吴中城建 PPN001	企业债务融资工具	032280048. 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
20	19 天津港 MTN001	企业债务融资工具	101901551. IB	758,230	98.6898	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
21	21 平度国资 MTN001	企业债务融资工具	102103182. 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
22	21 成都交子 ABN001 优先	资产支持证券	082180076. IB	360,000	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
23	21 北部湾 MTN002	企业债务融资工具	102100618. IB	30,380	102.0221	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
24	21 湘建工 MTN001	企业债务融资工具	102101037. IB	258,230	100.3489	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
25	21 桂投资 MTN001	企业债务融资工具	102100020. IB	161,014	100.3434	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
26	21 桂铁投 MTN001	企业债务融资工具	102103064. IB	75,950	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 海沧投资 MTN001	企业债务融资工具	102100016. IB	151,900	101.6851	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
28	21 长春城	企业债务	032100048. IB	45,570	100.5537	中国建设银	主承销商或

	投 PPN001	融资工具				行股份有限 公司	联席承销商
29	22 联发集 MTN002	企业债务 融资工具	102281663. IB	30,380	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	22 广西旅 发 SCP001	企业债务 融资工具	012281068. IB	91,140	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	22 建发地 产 MTN005	企业债务 融资工具	102200182. IB	151,900	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 重庆临 空 MTN002	企业债务 融资工具	102103111. IB	106,330	100.0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
33	21 苏州文 旅 MTN001	企业债务 融资工具	102103107. IB	60,760	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	20 晋江产 投 MTN001	企业债务 融资工具	102001585. IB	182,280	101.2047	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
35	21 益阳城 投 MTN001	企业债务 融资工具	102102158. IB	75,950	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	21 达州投 资 CP001	企业债务 融资工具	042100509. IB	75,950	100.0034	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
37	20 海沧投 资 MTN001	企业债务 融资工具	102001878. IB	303,800	101.7762	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
38	21 渝兴永 MTN001	企业债务 融资工具	102101916. IB	60,760	100.9338	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
39	21 厦国贸 控 MTN001	企业债务 融资工具	102100313. IB	227,850	101.1760	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
40	21 保利久 联 MTN002	企业债务 融资工具	102102180. IB	45,570	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 光穗甬 开 ABN001 优先	资产支持 证券	082280635. IB	106,330	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	21 丰城发 投 PPN002	企业债务 融资工具	032191345. IB	30,380	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	17 云能投 PPN001	企业债务 融资工具	031754031. IB	258,230	100.0781	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商

44	20 渝医药 MTN001	企业债务融资工具	102001572. IB	106,330	100.3629	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
45	22 云南交投 MTN001	企业债务融资工具	102280415. IB	60,760	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 晋江产投 MTN001	企业债务融资工具	102100494. IB	106,330	102.0744	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
47	21 远东租赁 MTN001	企业债务融资工具	102100363. IB	30,380	101.0306	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
48	22 津城建 CP004	企业债务融资工具	042280222. IB	30,380	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	22 云投 SCP021	企业债务融资工具	012282270. IB	151,900	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	20 晋能 MTN014	企业债务融资工具	102001709. IB	75,950	99.7067	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
51	21 金阳投资 MTN002	企业债务融资工具	102180035. IB	106,330	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	20 湘投 MTN001B	企业债务融资工具	102000609. IB	136,710	99.3666	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
53	20 株洲高科 MTN001	企业债务融资工具	102001327. IB	197,470	100.1825	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
54	22 泉州台商 MTN002	企业债务融资工具	102280528. IB	45,570	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	20 云南交投 MTN001	企业债务融资工具	102000962. IB	30,380	99.2562	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
56	20 阳煤 MTN008	企业债务融资工具	102001606. IB	75,950	100.2825	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
57	20 河钢集 MTN012	企业债务融资工具	102001898. IB	75,950	100.7018	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
58	20 新疆金投 MTN001	企业债务融资工具	102000489. IB	580,380	100.3414	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
59	21 冀旅投 MTN001	企业债务融资工具	102102289. IB	30,380	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 晋能煤 业 PPN006	企业债务 融资工具	032280247. IB	91,140	100.0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
61	22 津城建 MTN008	企业债务 融资工具	102281425. IB	30,380	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 闽建工 MTN002	企业债务 融资工具	102001190. IB	189,875	101.8357	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
63	21 津地铁 MTN001	企业债务 融资工具	102101453. IB	15,190	103.1633	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
64	22 河钢集 MTN005	企业债务 融资工具	102280608. IB	45,570	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 渝兴永 MTN002	企业债务 融资工具	102200124. IB	15,190	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 景德城 投 SCP001	企业债务 融资工具	012281008. IB	15,190	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	19 华发集 团 MTN001	企业债务 融资工具	101900052. IB	455,700	99.4068	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
68	18 津城建 MTN009	企业债务 融资工具	101800378. IB	106,330	101.4120	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
69	21 北部湾 MTN006	企业债务 融资工具	102102191. IB	60,760	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 厦门火 炬 MTN001	企业债务 融资工具	102280248. IB	75,950	100.0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
71	22 闽电子 SCP001	企业债务 融资工具	012280429. IB	30,380	100.0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
72	20 粤珠江 MTN001	企业债务 融资工具	102000014. IB	200,000	100.6486	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
73	19 豫投资 MTN003	企业债务 融资工具	101901628. IB	500,000	100.9870	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
74	19 赣高速 MTN003	企业债务 融资工具	101901714. IB	200,000	100.9802	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
75	20 首钢 MTN005	企业债务 融资工具	102001475. IB	500,000	101.8444	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商



76	20 海尔金控 MTN001	企业债务融资工具	102001785. IB	600,000	97.2496	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
77	21 厦门特房 MTN001	企业债务融资工具	102100851. IB	100,000	101.9280	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
78	21 晋江产投 MTN002	企业债务融资工具	102180022. IB	300,000	100.3081	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
79	22 恒泰 MTN001	企业债务融资工具	102280001. IB	400,000	100.2781	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
80	22 陕煤化 MTN002	企业债务融资工具	102280224. IB	500,000	100.0530	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
81	21 福瑞能源 GN001 (革命老区)	企业债务融资工具	132100116. IB	300,000	101.5038	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
82	18 临沂矿业 MTN002	企业债务融资工具	101800872. IB	200,000	104.3990	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
83	19 紫金矿业 MTN001B	企业债务融资工具	101900303. IB	100,000	102.6738	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
84	19 晋焦煤 MTN003B	企业债务融资工具	101901128. IB	100,000	102.4105	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
85	19 川高速 MTN003	企业债务融资工具	101901206. IB	100,000	101.9826	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
86	19 金隅 MTN003	企业债务融资工具	101901550. IB	200,000	103.2172	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
87	20 川高速 MTN001	企业债务融资工具	102000321. IB	600,000	101.4172	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
88	20 中化工 MTN007A	企业债务融资工具	102000602. IB	200,000	100.0100	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
89	20 鞍钢 MTN002	企业债务融资工具	102000789. IB	200,000	99.9740	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
90	20 豫高管 MTN005	企业债务融资工具	102001336. IB	100,000	100.8059	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
91	20 兆润投资 MTN002	企业债务融资工具	102001635. IB	100,000	101.0561	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

						公司	
92	20 冀交投 MTN003	企业债务融资工具	102002176. IB	600,000	102.3918	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
93	20 粤珠江 MTN004	企业债务融资工具	102002307. IB	100,000	102.1969	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
94	21 深航空 MTN001	企业债务融资工具	102101631. IB	400,000	100.2204	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
95	21 中建投资 MTN002	企业债务融资工具	102103346. IB	400,000	100.3862	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
96	20 兴业银行小微债 01	商业性金融债券	2028015. IB	800,000	99.6649	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
97	22 工商银行二级 01	商业性金融债券	2228004. IB	101,564	100.4912	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
98	20 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2028048. IB	118,491	105.2809	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
99	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	710,951	101.7735	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
100	19 工商银行永续债	商业性金融债券	1928018. IB	880,225	103.6931	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
101	22 云投 MTN001	企业债务融资工具	102281793. IB	16,927	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
102	22 汾湖投资 MTN002	企业债务融资工具	102282076. IB	16,927	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
103	22 乌高新 MTN002	企业债务融资工具	102281994. IB	16,927	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
104	22 国贸房产 MTN001	企业债务融资工具	102281839. IB	67,709	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
105	22 栖霞国资 MTN001	企业债务融资工具	102281837. IB	152,346	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
106	22 淮北建投 MTN004	企业债务融资工具	102281832. IB	16,927	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
107	21 工商银	商业性金	2128051. IB	67,709	101.3158	中国建设银	主承销商或

	行二级 02	融债券				行股份有限 公司	联席承销商
108	22 中航租 赁 MTN006	企业债务 融资工具	102281646. IB	186,201	100.0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
109	22 华发 MTN003	企业债务 融资工具	102280400. IB	16,927	101.8019	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
110	22 泉州台 商 MTN001	企业债务 融资工具	102280014. IB	50,782	102.2099	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
111	19 济宁城 投 MTN001	企业债务 融资工具	101900122. IB	152,346	101.8811	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
112	21 威海城 投 MTN003	企业债务 融资工具	102101984. IB	84,637	102.0809	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
113	20 工商银 行二级 02	商业性金 融债券	2028049. IB	101,564	104.3443	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
114	22 洛阳城 乡 MTN001	企业债务 融资工具	102282164. IB	16,927	100.0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
115	22 农行永 续债 02	商业性金 融债券	092280086. IB	355,475	100.0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
116	20 工商银 行二级 01	商业性金 融债券	2028041. IB	389,330	104.1265	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
117	20 淄博城 运 MTN001	企业债务 融资工具	102000175. IB	33,854	102.4413	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

无

## 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

2022年09月30日