

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 2023 年一季度投资管理报告

报告日：2023 年 03 月 31 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 13,792,545,509.83 元。

一、报告期投资者实际收益率

截至 2023 年 03 月 31 日，产品单位净值为 1.047483。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)	1.047483	1.047483	13,792,545,509.83
一个月前	1.043556	1.043556	14,944,427,409.47
二个月前	1.039376	1.039376	17,124,169,934.89
三个月前	1.035626	1.035626	19,280,753,162.82
六个月前	1.040488	1.040488	46,375,948,186.32
一年前	1.023085	1.023085	35,714,912,585.58

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 (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	186,888.62	13.54%	539,639.61	37.08%
同业存单	0	0.00%	1,773.07	0.12%
拆放同业及买入返售	0	0.00%	624.56	0.04%
债券	29,992.76	2.17%	812,780.09	55.85%
理财直接融资工具	0	0.00%	0.00	0.00%
新增可投资资产	0	0.00%	0.00	0.00%
非标准化债权类资产	0	0.00%	0.00	0.00%
权益类投资	0	0.00%	0.00	0.00%
金融衍生品	0	0.00%	0.00	0.00%
代客境外理财投资 QDII	0	0.00%	2,037.98	0.14%
商品类资产	0	0.00%	0.00	0.00%
另类资产	0	0.00%	0.00	0.00%
公募基金	0	0.00%	98,486.30	6.77%
私募基金	0	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	1,163,301.57	84.29%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0	0.00%	0.00	0.00%
合计	1,380,182.95	100.00%	1,455,341.62	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：105.44%

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	定期存款	417,829,153.70	2.87%
2	定期存款	286,274,526.44	1.97%

3	定期存款	257,060,044.29	1.77%
4	定期存款	257,060,044.29	1.77%
5	定期存款	208,914,576.85	1.44%
6	22 川发展 ABN001 优先	201,769,774.14	1.39%
7	定期存款	190,849,684.29	1.31%
8	定期存款	190,849,684.29	1.31%
9	定期存款	190,849,684.29	1.31%
10	定期存款	190,849,684.29	1.31%

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	2,242	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	21 前海北投 ABN001 优先	资产支持证券	082100552. IB	31,797	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	21 飞驰星火 ABN001 优先	资产支持证券	082101095. IB	7,551	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
4	21 光穗铜冠 ABN001 优先	资产支持证券	082101007. IB	23,848	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 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
6	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

7	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
8	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
9	19 天津港 MTN001	企业债务融资工具	101901551. IB	636,149	98.6898	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
10	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
11	21 昆明轨道 MTN001	企业债务融资工具	102101052. IB	136,306	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	20 新疆金投 MTN001	企业债务融资工具	102000489. IB	568,153	100.3414	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
13	21 湘建工 MTN001	企业债务融资工具	102101037. IB	154,302	100.3489	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
14	22 云南交投 MTN001	企业债务融资工具	102280415. IB	36,306	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	22 建发地产 MTN005	企业债务融资工具	102200182. IB	90,766	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	21 保利久联 MTN002	企业债务融资工具	102102180. IB	27,229	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
17	20 闽建工 MTN002	企业债务融资工具	102001190. IB	113,457	101.8357	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
18	20 湘投 MTN001B	企业债务融资工具	102000609. IB	9,076	99.3666	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
19	21 苏州文旅 MTN001	企业债务融资工具	102103107. IB	36,306	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	20 渝医药 MTN001	企业债务融资工具	102001572. IB	63,536	100.3629	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
21	20 海沧投资 MTN001	企业债务融资工具	102001878. IB	90,766	101.7762	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
22	18 津城建 MTN009	企业债务融资工具	101800378. IB	63,536	101.4120	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

23	20 北部湾 MTN003	企业债务融资工具	102001383. IB	181,532	101.2178	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
24	19 华发集团 MTN001	企业债务融资工具	101900052. IB	45,383	99.4068	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
25	20 株洲高科 MTN001	企业债务融资工具	102001327. IB	45,383	100.1825	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
26	22 光穗甬开 ABN001 优先	资产支持证券	082280635. IB	27,229	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	20 云南交投 MTN001	企业债务融资工具	102000962. IB	18,153	99.2562	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
28	22 津城建 CP004	企业债务融资工具	042280222. IB	18,153	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	20 晋江产投 MTN001	企业债务融资工具	102001585. IB	108,919	101.2047	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
30	22 华阳新材 MTN002	企业债务融资工具	102280404. IB	60,000	101.2688	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
31	22 匈牙利债 01BC	外国债券	092280143. IB	100,000	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	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
33	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
34	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
35	22 陕煤化 MTN002	企业债务融资工具	102280224. IB	300,000	100.0530	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
36	22 北京时尚 MTN002	企业债务融资工具	102282017. IB	100,000	100.4817	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
37	20 兴荣控股 MTN001	企业债务融资工具	102000862. IB	102,082	100.5591	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
38	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

39	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
40	21 中建投 资 MTN002	企业债务 融资工具	102103346. IB	314,578	100.3862	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
41	19 晋焦煤 MTN003B	企业债务 融资工具	101901128. IB	2,082	101.2277	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
42	21 巨化 MTN003	企业债务 融资工具	102101467. IB	10,413	100.3328	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
43	21 巨化 MTN002	企业债务 融资工具	102101263. IB	6,248	99.7911	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
44	21 联发集 MTN002	企业债务 融资工具	102101940. IB	4,165	97.2994	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
45	20 中金集 MTN002	企业债务 融资工具	102000857. IB	6,248	100.0263	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
46	19 淄博城 运 MTN001	企业债务 融资工具	101900090. IB	2,082	100.2020	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
47	18 临沂矿 业 MTN002	企业债务 融资工具	101800872. IB	8,330	101.3918	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
48	21 深航空 MTN001	企业债务 融资工具	102101631. IB	12,496	99.0451	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
49	21 川投能 源 GN001(碳 中和债)	企业债务 融资工具	132100077. IB	8,330	99.7961	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
50	21 冀建投 MTN001	企业债务 融资工具	102100975. IB	4,165	100.7865	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
51	19 兴业银 行二级 02	商业性金 融债券	1928026. IB	50,079	101.3873	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
52	21 工商银 行二级 01	商业性金 融债券	2128002. IB	25,039	102.3979	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

2023年03月31日