

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“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 19,280,753,162.82 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 1.035626。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)	1.035626	1.035626	19,280,753,162.82
一个月前	1.038404	1.038404	28,291,496,187.05
二个月前	1.042611	1.042611	41,596,867,117.45
三个月前	1.040488	1.040488	46,375,948,186.32
六个月前	1.033638	1.033638	40,700,091,076.20
一年前	1.016145	1.016145	15,516,102,733.06

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	295,266.93	15.30%	398,766.11	18.25%
同业存单	0.00	0.00%	27.19	0.0012%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	23,000.07	1.05%
债券	0.00	0.00%	1,737,495.51	79.50%
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%	1,990.45	0.09%
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%	24,179.67	1.11%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	1,634,740.74	84.70%	0.00	0.00%
委托投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	1,930,007.67	100.00%	2,185,458.99	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.11%

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	22 川发展 ABN001 优先	200,000,000.00	0.92%

2	21 江东 03	164,332,800.00	0.75%
3	22 光穗兴城 ABN001 优先	120,000,000.00	0.55%
4	21 光穗山钢 ABN002 优先	116,327,612.48	0.53%
5	18 邵阳城投 MTN001	112,885,790.00	0.52%
6	20 海控 03	110,023,100.00	0.50%
7	国保 11A3	109,000,000.00	0.50%
8	20 桂金 01	103,199,557.86	0.47%
9	20 诚通控股 MTN001A	101,316,720.00	0.46%
10	21 兴铜 01	100,980,000.00	0.46%

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	2,853	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 溧水产投 PPN002	企业债务融资工具	032280367. IB	22,567	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 宿迁经开 CP002	企业债务融资工具	042280227. IB	45,135	99.8701	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
4	21 昆明轨道 MTN001	企业债务融资工具	102101052. IB	132,522	102.1244	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
5	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
6	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

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	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
9	19 天津港 MTN001	企业债务融资工具	101901551. IB	638,221	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 光穗山钢 ABN002 优先	资产支持证券	082101463. IB	1,162,612	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	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
12	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
13	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
14	19 华发集团 MTN001	企业债务融资工具	101900052. IB	243,919	99.4068	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
15	21 北部湾 MTN002	企业债务融资工具	102100618. IB	16,261	102.0221	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
16	21 湘建工 MTN001	企业债务融资工具	102101037. IB	138,221	100.3489	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
17	21 长春城投 PPN001	企业债务融资工具	032100048. IB	24,391	100.5537	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
18	22 联发集 MTN002	企业债务融资工具	102281663. IB	16,261	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
19	22 建发地产 MTN005	企业债务融资工具	102200182. IB	81,306	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	22 渝兴永 MTN002	企业债务融资工具	102200124. IB	8,130	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
21	21 金阳投资 MTN002	企业债务融资工具	102180035. IB	56,914	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 重庆临空 MTN002	企业债务融资工具	102103111. IB	32,522	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	20 晋江产投 MTN001	企业债务融资工具	102001585. IB	97, 567	101. 2047	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
24	21 益阳城投 MTN001	企业债务融资工具	102102158. IB	40, 653	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
25	22 津城建 CP004	企业债务融资工具	042280222. IB	16, 261	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 厦国贸控 MTN001	企业债务融资工具	102100313. IB	121, 959	101. 1760	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
27	21 保利久联 MTN002	企业债务融资工具	102102180. IB	24, 391	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	22 光穗甬开 ABN001 优先	资产支持证券	082280635. IB	56, 914	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 丰城发投 PPN002	企业债务融资工具	032191345. IB	16, 261	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	20 渝医药 MTN001	企业债务融资工具	102001572. IB	56, 914	100. 3629	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
31	21 渝兴永 MTN001	企业债务融资工具	102101916. IB	32, 522	100. 9338	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
32	20 海沧投资 MTN001	企业债务融资工具	102001878. IB	162, 612	101. 7762	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
33	22 云南交投 MTN001	企业债务融资工具	102280415. IB	32, 522	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	21 晋江产投 MTN001	企业债务融资工具	102100494. IB	56, 914	102. 0744	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
35	21 桂铁投 MTN001	企业债务融资工具	102103064. IB	40, 653	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 桂投资 MTN001	企业债务融资工具	102100020. IB	86, 184	100. 3434	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
37	22 晋能煤业 PPN006	企业债务融资工具	032280247. IB	48, 783	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	21 北部湾 MTN006	企业债务融资工具	102102191. IB	32, 522	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	21 苏州文旅 MTN001	企业债务融资工具	102103107. IB	32, 522	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	20 湘投 MTN001B	企业债务融资工具	102000609. IB	73, 175	99. 3666	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
41	22 河钢集 MTN005	企业债务融资工具	102280608. IB	24, 391	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	20 株洲高科 MTN001	企业债务融资工具	102001327. IB	105, 698	100. 1825	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
43	22 泉州台商 MTN002	企业债务融资工具	102280528. IB	24, 391	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	20 北部湾 MTN003	企业债务融资工具	102001383. IB	162, 612	101. 2178	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
45	20 闽建工 MTN002	企业债务融资工具	102001190. IB	101, 633	101. 8357	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
46	21 津地铁 MTN001	企业债务融资工具	102101453. IB	8, 130	103. 1633	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
47	20 阳煤 MTN008	企业债务融资工具	102001606. IB	40, 653	100. 2825	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
48	20 云南交投 MTN001	企业债务融资工具	102000962. IB	16, 261	99. 2562	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
49	22 匈牙利债 01BC	外国债券	092280143. IB	132, 522	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 海沧投资 MTN001	企业债务融资工具	102100016. IB	81, 306	101. 6851	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
51	20 河钢集 MTN012	企业债务融资工具	102001898. IB	40, 653	100. 7018	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
52	20 新疆金投 MTN001	企业债务融资工具	102000489. IB	566, 261	100. 3414	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
53	21 冀旅投 MTN001	企业债务融资工具	102102289. IB	16, 261	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 津城建 MTN008	企业债务融资工具	102281425. IB	16, 261	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	18 津城建 MTN009	企业债务 融资工具	101800378. IB	56,914	101.4120	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
56	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
57	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
58	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
59	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
60	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
61	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
62	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
63	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
64	18 临沂矿 业 MTN002	企业债务 融资工具	101800872. IB	200,278	104.3990	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
65	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
66	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
67	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
68	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
69	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

70	20 兴荣控股 MTN001	企业债务融资工具	102000862. IB	100,278	100.5591	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
71	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
72	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
73	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
74	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
75	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
76	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
77	22 三峡 GN010(碳中和债)	企业债务融资工具	132280114. IB	12,484	99.0045	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
78	20 汾湖投资 MTN001	企业债务融资工具	102002118. IB	24,969	100.5931	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
79	18 吴江经开 MTN002	企业债务融资工具	101800193. IB	24,969	100.8979	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
80	18 谷财 MTN002	企业债务融资工具	101800993. IB	49,938	100.6142	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
81	18 谷财 MTN001	企业债务融资工具	101800851. IB	99,876	100.7373	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
82	18 泉州台商 MTN002	企业债务融资工具	101800116. IB	49,938	100.7778	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
83	21 川投能源 GN001(碳中和债)	企业债务融资工具	132100077. IB	1,113	99.7961	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
84	21 巨化 MTN002	企业债务融资工具	102101263. IB	835	99.7911	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

85	19 淄博城运 MTN001	企业债务融资工具	101900090. IB	278	100.2020	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
86	21 联发集 MTN002	企业债务融资工具	102101940. IB	1,113	97.2994	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
87	19 工商银行永续债	商业性金融债券	1928018. IB	280,403	103.6931	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
88	22 乌高新 MTN002	企业债务融资工具	102281994. IB	5,966	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
89	22 国贸房产 MTN001	企业债务融资工具	102281839. IB	23,864	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
90	22 栖霞国资 MTN001	企业债务融资工具	102281837. IB	53,694	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
91	22 淮北建投 MTN004	企业债务融资工具	102281832. IB	5,966	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
92	22 云投 MTN001	企业债务融资工具	102281793. IB	5,966	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
93	22 中航租赁 MTN006	企业债务融资工具	102281646. IB	65,626	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
94	22 华发 MTN003	企业债务融资工具	102280400. IB	5,966	101.8019	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
95	22 泉州台商 MTN001	企业债务融资工具	102280014. IB	17,898	102.2099	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
96	22 洛阳城乡 MTN001	企业债务融资工具	102282164. IB	5,966	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
97	19 济宁城投 MTN001	企业债务融资工具	101900122. IB	53,694	101.8811	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
98	21 威海城投 MTN003	企业债务融资工具	102101984. IB	29,830	102.0809	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。

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