

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 年二季度暨半年投资管理报告

报告日：2023 年 06 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 11,852,944,774.36 元。

一、报告期投资者实际收益率

截至 2023 年 06 月 30 日，产品单位净值为 1.054660。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)	1.054660	1.054660	11,852,944,774.36
一个月前	1.052792	1.052792	12,487,122,958.72
二个月前	1.049923	1.049923	13,200,690,554.85
三个月前	1.047483	1.047483	13,792,545,509.83
六个月前	1.035626	1.035626	19,280,753,162.82
一年前	1.033638	1.033638	40,700,091,076.20

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

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	161,142.44	13.59%	453,506.29	35.96%
同业存单	0.00	0.00%	2,838.36	0.23%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	1,875.99	0.15%
债券	2,097.39	0.18%	708,665.57	56.20%
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%	5,672.70	0.45%
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%	88,428.48	7.01%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	1,022,671.96	86.24%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	1,185,911.79	100.00%	1,260,987.40	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：106.33%

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	417,839,749.69	3.31%
2	定期存款	208,919,874.84	1.66%

3	22 川发展 ABN001 优先	204,609,808.22	1.62%
4	定期存款	199,858,089.22	1.58%
5	定期存款	199,858,089.22	1.58%
6	定期存款	164,130,839.67	1.30%
7	定期存款	133,238,726.14	1.06%
8	22 光穗兴城 ABN001 优先	122,922,575.34	0.97%
9	国保 11A3	110,394,752.05	0.88%
10	定期存款	109,420,559.78	0.87%

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	6,807	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	33,062	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 光穗铜冠 ABN001 优先	资产支持证券	082101007. IB	24,796	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	21 飞驰星火 ABN001 优先	资产支持证券	082101095. IB	7,852	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	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	28,774	101.2142	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

6	19 工商银行永续债	商业性金融债券	1928018. IB	100,401	101.9776	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
7	22 匈牙利债 01BC	外国债券	092280143. IB	111,509	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	20 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2028048. IB	28,774	103.6543	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
9	22 华阳新材 MTN002	企业债务融资工具	102280404. IB	65,179	100.8594	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
10	20 晋能 MTN018	企业债务融资工具	102002042. IB	5,754	102.9723	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
11	21 平度国资 MTN001	企业债务融资工具	102103182. IB	51,793	99.5914	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
12	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
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	21 昆明轨道 MTN001	企业债务融资工具	102101052. IB	181,888	102.1244	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	22 建发地产 MTN005	企业债务融资工具	102200182. IB	204,720	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	21 苏州文旅 MTN001	企业债务融资工具	102103107. IB	81,888	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	19 华发集团 MTN001	企业债务融资工具	101900052. IB	102,360	99.4068	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
19	22 云南交投 MTN001	企业债务融资工具	102280415. IB	81,888	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 湘投 MTN001B	企业债务融资工具	102000609. IB	20,472	99.3666	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
21	22 光穗甬开 ABN001 优先	资产支持证券	082280635. IB	61,416	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	19 天津港 MTN001	企业债务 融资工具	101901551. IB	307,081	98.6898	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	409,441	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	21 湘建工 MTN001	企业债务 融资工具	102101037. IB	348,025	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	20 渝医药 MTN001	企业债务 融资工具	102001572. IB	143,304	100.3629	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
26	21 保利久 联 MTN002	企业债务 融资工具	102102180. IB	40,944	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 海沧投 资 MTN001	企业债务 融资工具	102001878. IB	204,720	101.7762	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
28	20 晋江产 投 MTN001	企业债务 融资工具	102001585. IB	245,664	101.2047	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
29	20 株洲高 科 MTN001	企业债务 融资工具	102001327. IB	102,360	100.1825	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
30	23 汇聚达 2A1_bc	资产支持 证券	2389115. IB	100,000	100.0000	建信信托有 限责任公司	计划管理人
31	23 青岛华 通 CP001	企业债务 融资工具	042380308. IB	140,000	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 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

38	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
39	21 中建投资 MTN002	企业债务融资工具	102103346. IB	300,000	100.3862	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
40	23 天马电子 MTN002	企业债务融资工具	102380798. IB	100,000	100.4423	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
41	21 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2128045. IB	8,992	101.7653	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
42	21 中国银行永续债 01	商业性金融债券	2128019. IB	8,992	103.0521	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
43	23 中行永续债 01	商业性金融债券	242380008. IB	37,256	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	23 宁波国贸 SCP001	企业债务融资工具	012381513. IB	2,569	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	23 青岛国信 MTN004	企业债务融资工具	102381303. IB	3,854	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	22 洛阳城乡 MTN001	企业债务融资工具	102282164. IB	1,284	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	20 中国银行永续债 03	商业性金融债券	2028053. IB	8,992	104.2912	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
48	23 中国中药 SCP001	企业债务融资工具	012370004. IB	23,124	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	23 光大银行债 01	商业性金融债券	212380005. IB	41,647	99.8347	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
50	20 工商银行二级 02	商业性金融债券	2028049. IB	51,747	102.7559	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
51	23 交通银行小微债 01	商业性金融债券	2328006. IB	4,766	100.2682	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	2,383	103.0236	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
53	23 兴业银行绿债 01	商业性金融债券	222380003. IB	7,149	100.0595	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06月30日