

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 年四季度暨年度投资管理报告

报告日：2023 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 8,206,735,368.45 元。

一、报告期投资者实际收益率

截至 2023 年 12 月 31 日，产品单位净值为 1.066566。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	1.066566	1.066566	8,206,735,368.45
一个月前	1.064195	1.064195	8,690,556,676.28
二个月前	1.061902	1.061902	9,086,291,914.18
三个月前	1.060250	1.060250	9,572,298,080.80
六个月前	1.054660	1.054660	11,852,944,774.36
一年前	1.035626	1.035626	19,280,753,162.82

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	100,075.63	12.19%	512,577.69	63.30%
同业存单	0.00	0.00%	2,378.88	0.29%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	36,308.25	4.48%
债券	0.00	0.00%	189,228.66	23.37%
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%	69,292.19	8.56%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	721,036.48	87.81%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	821,112.11	100.00%	809,785.68	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.06%

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	291,183,137.08	3.60%
2	定期存款	291,183,137.08	3.60%

3	定期存款	203,322,263.53	2.51%
4	定期存款	203,322,263.53	2.51%
5	定期存款	194,122,091.39	2.40%
6	定期存款	154,025,492.27	1.90%
7	定期存款	147,446,480.77	1.82%
8	定期存款	147,446,480.77	1.82%
9	GC007	134,000,000.00	1.65%
10	定期存款	119,623,064.58	1.48%

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 昆明轨道 MTN001	企业债务融资工具	102101052. IB	130,644	102.1244	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	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, 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	22 建发地产 MTN005	企业债务融资工具	102200182. IB	76,610	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	21 苏州文旅 MTN001	企业债务融资工具	102103107. IB	30,644	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
5	19 华发集团 MTN001	企业债务融资工具	101900052. IB	38,305	99.4068	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	21 湘建工 MTN001	企业债务 融资工具	102101037. IB	130, 238	100. 3489	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	22 光穗甬 开 ABN001 优先	资产支持 证券	082280635. IB	22, 983	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
8	19 天津港 MTN001	企业债务 融资工具	101901551. IB	114, 916	98. 6898	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	20 湘投 MTN001B	企业债务 融资工具	102000609. IB	36, 241	99. 3666	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	21 保利久 联 MTN002	企业债务 融资工具	102102180. IB	15, 322	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	22 云南交 投 MTN001	企业债务 融资工具	102280415. IB	30, 644	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	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, 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 荣盛 MTN005	企业债务 融资工具	102282065. IB	110, 000	99. 9415	中国建设银行 股份有限公司	承销团成员
14	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, 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
15	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, 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	23 汇聚达 2A1_bc	资产支持 证券	2389115. IB	100,000	83.0000	建信信托有 限责任公司	计划管理人
17	20 海尔金 控 MTN001	企业债务 融资工具	102001785. IB	300,000	97.2496	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	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, 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	23 天马电 子 MTN002	企业债务 融资工具	102380798. IB	50,000	100.4423	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	22 楚天智 能 MTN001	企业债务 融资工具	102281666. IB	57,161	99.9958	中国建设银 行股份有限 公司	承销团成员
21	22 皖投集 MTN001	企业债务 融资工具	102281386. IB	57,161	100.1625	中国建设银 行股份有限 公司	承销团成员
22	22 中节能 MTN001	企业债务 融资工具	102280252. IB	57,161	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
23	23 招银金 租债 02	商业性金 融债券	2322019. IB	2,405	99.9196	中国建设银 行股份有限 公司	承销团成员
24	23 兴业银 行绿债 01	商业性金 融债券	222380003. IB	7,215	100.0595	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 光大银 行债 01	商业性金 融债券	212380005. IB	7,215	99.8065	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	21 工商银 行二级 01	商业性金 融债券	2128002. IB	2,405	103.0236	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	20 农业银 行永续债 01	商业性金 融债券	2028017. IB	3,849	100.7318	中国建设银 行股份有限 公司, 中国	主承销商或 联席承销

						建设银行股份有限公司	商, 承销团成员
28	20 工商银行二级 02	商业性金融债券	2028049. IB	3, 849	102. 5149	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	20 农业银行永续债 02	商业性金融债券	2028032. IB	3, 849	102. 7513	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	20 工商银行二级 01	商业性金融债券	2028041. IB	3, 849	102. 5045	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

2023 年 12 月 31 日

附录一

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
投资非标准化债权及股权类资产清单

报告日：2023 年 12 月 31 日

我司依照监管要求，现对建信理财“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。