

# 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 2024 年二季度暨半年投资管理报告

报告日：2024 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 6,418,721,775.76 元。

## 一、报告期投资者实际收益率

截至 2024 年 06 月 30 日，产品单位净值为 1.080264。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	1.080264	1.080264	6,418,721,775.76
一个月前	1.078056	1.078056	6,642,972,098.30
两个月前	1.075700	1.075700	6,911,084,908.42
三个月前	1.073492	1.073492	7,200,963,227.03
六个月前	1.066566	1.066566	8,206,735,368.45
一年前	1.054660	1.054660	11,852,944,774.36

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	79,718.93	12.41%	442,602.62	65.60%
同业存单	0.00	0.00%	4,913.28	0.73%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	11,575.00	1.72%
债券	0.00	0.00%	161,024.18	23.87%
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%	54,597.30	8.09%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	562,528.29	87.59%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	642,247.21	100.00%	674,712.38	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	221,915,726.21	3.29%
2	定期存款	221,915,726.21	3.29%
3	定期存款	211,839,260.21	3.14%
4	定期存款	211,839,260.21	3.14%

5	定期存款	141,226,173.47	2.09%
6	定期存款	129,640,750.84	1.92%
7	定期存款	129,640,750.84	1.92%
8	定期存款	110,957,863.11	1.64%
9	定期存款	110,957,863.11	1.64%
10	定期存款	110,957,863.11	1.64%

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 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
2	19 天津港 MTN001	企业债务融资工具	101901551. IB	580,203	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
3	21 保利久联 MTN002	企业债务融资工具	102102180. IB	77,360	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	22 云南交投 MTN001	企业债务融资工具	102280415. IB	154,720	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	22 建发地产 MTN005	企业债务融资工具	102200182. IB	386,802	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

6	20 湘投 MTN001B	企业债务融资工具	102000609. IB	38,680	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
7	21 苏州文旅 MTN001	企业债务融资工具	102103107. IB	154,720	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	22 光穗甬开 ABN001 优先	资产支持证券	082280635. IB	116,040	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
9	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
10	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
11	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
12	23 光大银行债 02	商业性金融债券	212380020. IB	100,000	100.2036	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	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
14	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
15	24 东方债 01BC	商业性金融债券	252480007. IB	2,405	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
16	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	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
--	--	--	--	--	--	----------------	-------------

(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

2024年06月30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：2024年06月30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)	产品投资 项目收益 率	风险状 况	本金余额 (万元)
------	--------	------	-------------------	-------------------	----------	--------------

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。