

建信理财“星座系列—白羊座”（按年）开放式净值型人民币理财产品 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“星座系列—白羊座”（按年）开放式净值型人民币理财产品于 2019 年 04 月 09 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 554,989,927.95 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 1.147849。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)	1.147849	1.147849	554,989,927.95
一个月前	1.149416	1.149416	555,747,388.66
二个月前	1.159578	1.159578	560,660,623.11
三个月前	1.154661	1.154661	558,283,446.54
六个月前	1.140704	1.140704	551,535,186.39
一年前	1.123674	1.123674	369,930,772.15

超额业绩报酬暂估测算：报告日预测超额业绩报酬暂估计提金额 0.00 元，计提后单位净值 1.147849。

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“星座系列—白羊座”（按年）开放式净值型人民币理财产品	2019-03-26	2019-04-08	2019-04-09	—

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江苏省分行

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	394.10	0.71%	3,165.93	5.46%
同业存单	0.00	0.00%	726.29	1.25%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	12,113.46	20.88%
债券	0.00	0.00%	37,378.32	64.44%
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%	-0.16	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	3,224.41	5.81%	4,617.68	7.96%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	51,919.77	93.48%	0.00	0.00%
委托投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	55,538.28	100.00%	58,001.52	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.08%

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	R007	77,722,498.28	13.28%
2	R014	34,763,354.01	5.94%

3	招商产业债券 A	32,244,110.05	5.51%
4	21 飞驰建瓴 ABN001 优先	15,312,012.99	2.62%
5	R1M	8,648,717.37	1.48%
6	20 汇鑫 ABN001 优先	8,094,518.76	1.38%
7	21 光穗华电 ABN001 优先	8,000,053.36	1.37%
8	20 信创 ABN001 优先	7,965,878.91	1.36%
9	嘉实超短债 A	7,277,114.77	1.24%
10	22 上海银行 CD202	7,272,369.24	1.24%

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

本产品主要投资于标准化资产，资产流动性较好。

（二）市场情况

固收方面，主要债券品种全年均为上行，其中 10 年期国债上行 5bp、5 年期国有大行永续债上行 61bp、3 年期 AAA 信用债上行 25bp、3 年期 AA+信用债上行 47bp，全年资本利得均为负。此外，2022 年 11 月份以来，债市受防疫政策放开及房地产政策不断加码影响，市场普遍预期宏观经济回升，债市随之大幅调整。同时，受“债市调整-资管产品赎回-债市继续调整”这一负向反馈影响，本轮债市调整幅度深、时间短，为 16 年以来最大的一次。

展望 2023 年，债市回归基本面逻辑。在疫后消费复苏、基建托底经济等政策支持下，经济复苏概率较大，市场分歧在于经济复苏的程度，在一定程度上会压制债市表现。随着年初两会经济增长目标的制定，强刺激政策出台概率降低，偏向于经济内生增长。货币政策依然维持宽松态势，资金利率将围绕政策利率波动。全年债市大概率根据经济复苏程度处于震荡态势。

本产品持仓少量国债期货，主要是套保仓位，以对冲组合久期带来的利率波动风险。

六、托管人报告

报告期内，管理人能够按照法规、合同协议等要求进行规范投资，未发现管理人存在违规失责行为。

报告期内，托管人认真履行托管职责，安全保管托管账户内资产，及时准确地执行清算指令，办理本产品名下的资金往来；托管人严格履行监督职责，不存在任何损害本产品运营事项，完全尽职尽责地履行了应尽义务，确保托管资产安全、合法、合规运营。

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	32050159863600 000775-0007	中国建设银行股份有限公司江苏省分行投资银行理财产品托管专户	中国建设银行股份有限公司江苏省分行

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	持仓数量	交易净价	关联方名称	关联方角色
1	20 飞驰建瓴 ABN001 优先	资产支持证券	082000628. IB	17,832	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
2	20 上润金泰 ABN001 优先	资产支持证券	082000845. IB	35,665	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	20 声赫鞍钢 ABN001 优先	资产支持证券	082000940. IB	35,665	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	20 中电西藏 ABN002 优先	资产支持证券	082001038. IB	58,847	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	20 中交投资 ABN001 优先	资产支持证券	082001046. IB	37,448	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	21 飞驰建瓴 ABN001 优先	资产支持证券	082100312. IB	150,352	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
7	21 成都交子 ABN001 优先	资产支持证券	082180076. IB	32,098	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	22 鲁黄金 ABN001 优先	资产支持证券	082280280. IB	48,148	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	22 飞驰财信 ABN001 优先	资产支持证券	082280456. IB	53,497	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
10	22 飞驰财信 ABN002 优先	资产支持证券	082280586. IB	16,406	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 四川能投 ABN001 优先	资产支持证券	082280643. IB	3,566	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	20 飞驰建普 2B	资产支持证券	2089420. IB	23,182	21.3700	建信信托有限责任公司	计划管理人
13	21 光穗华能 ABN001 优先	资产支持证券	082100470. IB	56,962	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	GC 绿源 03	资产支持证券	183484. SH	1,056	100.0000	建信资本管理有限责任公司, 建信资本管理有限责任公司	计划管理人, 主承销商或联席承销商
15	22 中国银行永续债 01	商业性金融债券	2228023. IB	35,113	100.4858	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
16	22 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2228011. IB	23,829	99.9615	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
17	22 浙银租赁货运物流主题债	商业性金融债券	2222004. IB	394	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	21 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2128045. IB	5,128	100.0365	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
19	22 昆山国创 MTN007	企业债务融资工具	102282049. IB	3,945	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	21 工商银行永续债 02	商业性金融债券	2128044. IB	5, 523	100. 0824	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
21	22 云天化 MTN001	企业债务融资工具	102281519. IB	3, 945	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	22 晋能煤业 MTN013 (科创票据)	企业债务融资工具	102281337. IB	4, 339	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	22 长沙轨交 MTN001	企业债务融资工具	102281302. IB	394	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
24	22 新庐陵 MTN001	企业债务融资工具	102281265. IB	5, 523	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 合肥产投 MTN001 (科创票据)	企业债务融资工具	102281241. IB	6, 707	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 苏海投资 MTN001	企业债务融资工具	102103327. IB	1, 972	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	22 五凌 1 号 ABN001 优先 A	资产支持证券	082280989. IB	1, 183	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 中建投资 MTN001 (绿色)	企业债务融资工具	102280709. IB	315	100. 4816	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
29	22 渝兴永 MTN001	企业债务融资工具	102280163. IB	591	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	22 扬州经开 MTN002	企业债务融资工具	102282013. IB	2, 761	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
31	22 曲文投 MTN001	企业债务融资工具	102281604. IB	21, 134	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	22 淮北建投 MTN003	企业债务融资工具	102281419. IB	1, 183	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
33	22 贵州交通 MTN002	企业债务融资工具	102200161. IB	3, 945	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 渝高建投 MTN001	企业债务融资工具	102102220. IB	2, 367	100. 1898	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

35	22 北部湾 MTN001	企业债务融资工具	102280032. IB	2,761	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	22 宿迁水务 MTN002	企业债务融资工具	102281374. IB	394	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
37	21 淮安国投 MTN003	企业债务融资工具	102103248. IB	1,183	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 淄博城运 MTN003	企业债务融资工具	102103220. IB	4,339	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 靖江港口 PPN001	企业债务融资工具	032191490. IB	2,367	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	21 江门高新 MTN001	企业债务融资工具	102103204. IB	1,578	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
41	21 晋能电力 MTN015	企业债务融资工具	102103210. IB	5,523	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	22 珠海华发 ABN001 优先	资产支持证券	082282014. IB	1,144	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
43	22 昆钢 MTN001	企业债务融资工具	102280779. IB	9,468	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	21 临沂投资 MTN003	企业债务融资工具	102102176. IB	1,972	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	18 威经开 MTN001	企业债务融资工具	101800643. IB	1,183	102.8289	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
46	22 象屿 MTN001 (科创票据)	企业债务融资工具	102281255. IB	7,890	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	22 渝医药 MTN001	企业债务融资工具	102280164. IB	1,183	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
48	20 重庆发展 MTN001	企业债务融资工具	102002033. IB	3,550	100.4810	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
49	21 益阳城投 MTN001	企业债务融资工具	102102158. IB	1,972	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	22 昆交产 SCP002	企业债务融资工具	012283632. IB	10,702	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

51	21 高淳经开 PPN002	企业债务融资工具	032191360. IB	1,972	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
52	22 农行永续债 02	商业性金融债券	092280086. IB	7,890	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
53	22 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2228029. IB	51,683	100.5922	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
54	21 长安汇通 PPN001	企业债务融资工具	032191358. IB	1,183	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	21 淄博城资 MTN002	企业债务融资工具	102103081. IB	7,890	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
56	22 津城建 MTN004	企业债务融资工具	102281111. IB	10,185	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
57	22 滨建投 SCP012	企业债务融资工具	012283364. IB	11,640	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
58	22 津城建 MTN008	企业债务融资工具	102281425. IB	8,730	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
59	22 津城建 CP033	企业债务融资工具	042280492. IB	5,820	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
60	22 广投能源 SCP002	企业债务融资工具	012282144. IB	4,365	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
61	22 津城建 CP024	企业债务融资工具	042280419. IB	2,182	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
62	22 云能投 MTN005	企业债务融资工具	102281652. IB	14,550	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
63	22 晋能山西 CP001	企业债务融资工具	042280163. IB	8,730	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
64	22 滨建投 SCP011	企业债务融资工具	012283237. IB	19,642	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
65	22 株洲城建 SCP003	企业债务融资工具	012284147. IB	2,910	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
66	22 云能投 SCP011	企业债务融资工具	012281558. IB	29,100	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

67	22 津城建 CP025	企业债务融资工具	042280423. IB	5, 092	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
68	20 淮北建投 PPN004	企业债务融资工具	032000669. IB	3, 129	102. 6776	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
69	20 飞驰鹏誉 ABN002 优先	资产支持证券	082000486. IB	9, 779	101. 3298	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
70	22 光穗甬开 ABN001 优先	资产支持证券	082280635. IB	782	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
71	19 住元 1A2	资产支持证券	1989071. IB	39, 117	43. 5760	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
72	19 建元 8A3_bc	资产支持证券	1989325. IB	7, 823	69. 9545	建信信托有限责任公司	计划管理人
73	21 兴业银行二级 03	商业性金融债券	2128043. IB	3, 186	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
74	21 建设银行二级 01	商业性金融债券	2128025. IB	1, 593	99. 7281	中国建设银行股份有限公司	债务主体
75	21 工商银行二级 01	商业性金融债券	2128002. IB	6, 372	102. 1997	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
76	22 兴业银行二级 01	商业性金融债券	2228003. IB	2, 655	99. 8249	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
77	21 建设银行二级 05	商业性金融债券	2128049. IB	1, 062	100. 3469	中国建设银行股份有限公司	债务主体
78	21 兴业银行二级 01	商业性金融债券	2128032. IB	3, 186	101. 4388	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
79	21 川能投 MTN002B	企业债务融资工具	102101521. IB	3, 186	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
80	20 中建四局 MTN001	企业债务融资工具	102001942. IB	531	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
81	21 中交二公 MTN001	企业债务融资工具	102101056. IB	4, 248	100. 5447	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
82	20 尧矿 MTN002	企业债务融资工具	102001743. IB	1, 062	100. 0033	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

						公司	
83	22 万鑫建发 ABN001 优先	资产支持证券	082200121. IB	1, 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
84	21 兴业银行二级 02	商业性金融债券	2128042. IB	2, 655	100. 7699	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
85	22 工商银行二级 01	商业性金融债券	2228004. IB	8, 496	99. 0085	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
86	20 昊华(疫情防控债) MTN001	企业债务融资工具	102000760. IB	531	97. 9596	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
87	20 中建四局 MTN002	企业债务融资工具	102002093. IB	1, 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
88	20 苏豪 MTN001	企业债务融资工具	102000229. IB	531	98. 5135	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
89	21 川能投 MTN002A	企业债务融资工具	102101520. IB	2, 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
90	20 中交一公 MTN002	企业债务融资工具	102001134. IB	2, 655	99. 7043	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
91	21 建设银行二级 03	商业性金融债券	2128033. IB	11, 683	100. 5610	中国建设银行股份有限公司	债务主体
92	22 鲁宏桥 CP002	企业债务融资工具	042280376. IB	1, 593	100. 0000	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

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。

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