

建信理财“星座系列—双子座”（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—双子座”（按年）开放式净值型人民币理财产品于 2019 年 06 月 17 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 525,509,826.86 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 1.134860。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) | 1.134860 | 1.134860 | 525,509,826.86 |
| 一个月前 | 1.136258 | 1.136258 | 526,157,493.80 |
| 二个月前 | 1.144844 | 1.144844 | 530,133,250.37 |
| 三个月前 | 1.140486 | 1.140486 | 528,115,032.65 |
| 六个月前 | 1.129347 | 1.129347 | 522,957,394.52 |
| 一年前 | 1.108581 | 1.108581 | 425,365,632.94 |

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 1.134860。

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—双子座”（按年）开放式净值型人民币理财产品 | 2019-06-01 | 2019-06-16 | 2019-06-17 | - |

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 | 355.34 | 0.68% | 1,773.75 | 3.20% |
| 同业存单 | 0.00 | 0.00% | 540.29 | 0.98% |
| 拆放同业及买入返售 | 0.00 | 0.00% | 9,011.17 | 16.27% |
| 债券 | 0.00 | 0.00% | 43,001.52 | 77.65% |
| 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% | -0.17 | 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% | 1,052.36 | 1.90% |
| 私募基金 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 资产管理产品 | 52,236.10 | 99.32% | 0.00 | 0.00% |
| 委托投资——协议方式 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 合计 | 52,591.45 | 100.00% | 55,378.92 | 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 | 57,817,565.29 | 10.33% |
| 2 | R014 | 25,860,369.07 | 4.62% |

| | | | |
|----|-------------------|---------------|-------|
| 3 | 21 飞驰建瓴 ABN001 优先 | 16,478,555.25 | 2.94% |
| 4 | 铁托 2 优 | 8,389,610.35 | 1.50% |
| 5 | 生物 R1 优 | 7,806,305.22 | 1.39% |
| 6 | 21 光穗华能 ABN001 优先 | 7,641,293.17 | 1.36% |
| 7 | 20 汇鑫 ABN001 优先 | 7,331,758.34 | 1.31% |
| 8 | 21 光穗华电 ABN001 优先 | 7,246,194.58 | 1.29% |
| 9 | 20 信创 ABN001 优先 | 7,215,240.45 | 1.29% |
| 10 | PR 上万优 | 6,897,559.67 | 1.23% |

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 000775-0009 | 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 | 16, 152 | 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 | 32, 304 | 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 | 32, 304 | 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 | 53, 302 | 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 | 33,919 | 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 | 161,807 | 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 | 29,074 | 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 | 43,611 | 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 | 48,456 | 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 | 14,860 | 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 | 3,230 | 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 | 20,997 | 21.3700 | 建信信托有限责任公司 | 计划管理人 |
| 13 | 19 建元 1A3_bc | 资产支持证券 | 1989045. IB | 12,303 | 50.1187 | 建信信托有限责任公司 | 计划管理人 |
| 14 | 步步高 1 | 资产支持证券 | 121539. SZ | 5,659 | 99.5208 | 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 粤澳 ABN001 优先 | 资产支持证券 | 082280418. IB | 10,950 | 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 | 20 云南资产 PPN001 | 企业债务融资工具 | 032000644. IB | 18,455 | 102.1182 | 中国建设银行股份有限公司 | 主承销商或联席承销商 |
| 17 | 20 建发集 MTN003 | 企业债务融资工具 | 102001509. IB | 6,151 | 100.9385 | 中国建设银行股份有限公司 | 主承销商或联席承销商 |
| 18 | 21 中联重科 ABN001 优先 A2 | 资产支持证券 | 082100800. IB | 23,376 | 62.9900 | 中国建设银行股份有限公司 | 主承销商或联席承销商 |
| 19 | 20 金风科技 MTN001 | 企业债务融资工具 | 102001672. IB | 36,910 | 101.8657 | 中国建设银行股份有限公司 | 主承销商或联席承销商 |

| | | | | | | | |
|----|-----------------------|----------|---------------|--------|----------|----------------------------|-------------------|
| 20 | 20 辽交投 MTN001 | 企业债务融资工具 | 102000898. IB | 52,905 | 99.8104 | 中国建设银行股份有限公司 | 主承销商或联席承销商 |
| 21 | 21 中电元恒 ABN005 优先 A | 资产支持证券 | 082101373. IB | 7,136 | 42.0000 | 中国建设银行股份有限公司 | 主承销商或联席承销商 |
| 22 | 21 粤澳 ABN001 优先 | 资产支持证券 | 082180078. IB | 3,691 | 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 | 21 光穗华能 ABN001 优先 | 资产支持证券 | 082100470. IB | 75,447 | 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 | GC 绿源 03 | 资产支持证券 | 183484. SH | 1,399 | 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 |
| 25 | 22 中国银行永续债 01 | 商业性金融债券 | 2228023. IB | 37,674 | 100.4858 | 中国建设银行股份有限公司 | 主承销商或联席承销商 |
| 26 | 22 农业银行永续债 01 | 商业性金融债券 | 2228011. IB | 25,567 | 99.9615 | 中国建设银行股份有限公司 | 主承销商或联席承销商 |
| 27 | 22 浙银租赁货运物流主题债 | 商业性金融债券 | 2222004. IB | 423 | 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 | 21 中国银行永续债 02 | 商业性金融债券 | 2128045. IB | 5,502 | 100.0365 | 中国建设银行股份有限公司 | 主承销商或联席承销商 |
| 29 | 22 昆山国创 MTN007 | 企业债务融资工具 | 102282049. IB | 4,233 | 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 | 21 工商银行永续债 02 | 商业性金融债券 | 2128044. IB | 5,926 | 100.0824 | 中国建设银行股份有限公司 | 主承销商或联席承销商 |
| 31 | 22 云天化 MTN001 | 企业债务融资工具 | 102281519. IB | 4,233 | 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 晋能煤业 MTN013 (科创票据) | 企业债务融资工具 | 102281337. IB | 4,656 | 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 长沙轨交 MTN001 | 企业债务融资工具 | 102281302. IB | 423 | 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 | 22 新庐陵 MTN001 | 企业债务融资工具 | 102281265. IB | 5,926 | 100.0000 | 中国建设银行股份有限公司 | 主承销商或联席承销商 |

| | | | | | | | |
|----|----------------------------------|--------------|---------------|--------|----------|----------------------|----------------|
| 35 | 22 合肥产 投 MTN001 (科 创票据) | 企业债务 融资工具 | 102281241. IB | 7,196 | 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 苏海投 资 MTN001 | 企业债务 融资工具 | 102103327. IB | 2,116 | 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 | 22 五凌 1 号 ABN001 优先 A | 资产支持 证券 | 082280989. IB | 1,269 | 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 | 22 中建投 资 MTN001 (绿 色) | 企业债务 融资工具 | 102280709. IB | 338 | 100.4816 | 中国建设银 行股份有限 公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 39 | 22 渝兴永 MTN001 | 企业债务 融资工具 | 102280163. IB | 634 | 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 | 22 扬州经 开 MTN002 | 企业债务 融资工具 | 102282013. IB | 2,963 | 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 | 22 曲文投 MTN001 | 企业债务 融资工具 | 102281604. IB | 17,409 | 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 淮北建 投 MTN003 | 企业债务 融资工具 | 102281419. IB | 1,269 | 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 贵州交 通 MTN002 | 企业债务 融资工具 | 102200161. IB | 4,233 | 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 渝高建 投 MTN001 | 企业债务 融资工具 | 102102220. IB | 2,539 | 100.1898 | 中国建设银 行股份有限 公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 45 | 22 北部湾 MTN001 | 企业债务 融资工具 | 102280032. IB | 2,963 | 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 宿迁水 务 MTN002 | 企业债务 融资工具 | 102281374. IB | 423 | 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 | 21 淮安国 投 MTN003 | 企业债务 融资工具 | 102103248. IB | 1,269 | 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 | 21 淄博城 运 MTN003 | 企业债务 融资工具 | 102103220. IB | 4,656 | 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 | 21 靖江港 口 PPN001 | 企业债务 融资工具 | 032191490. IB | 2,539 | 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 江门高新 MTN001 | 企业债务融资工具 | 102103204. IB | 1,693 | 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 晋能电力 MTN015 | 企业债务融资工具 | 102103210. IB | 5,926 | 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 珠海华发 ABN001 优先 | 资产支持证券 | 082282014. IB | 1,227 | 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 昆钢 MTN001 | 企业债务融资工具 | 102280779. IB | 10,159 | 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 | 21 临沂投资 MTN003 | 企业债务融资工具 | 102102176. IB | 2,116 | 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 威经开 MTN001 | 企业债务融资工具 | 101800643. IB | 1,269 | 102.8289 | 中国建设银行股份有限公司 | 主承销商或联席承销商 |
| 56 | 22 象屿 MTN001 (科创票据) | 企业债务融资工具 | 102281255. IB | 8,466 | 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 渝医药 MTN001 | 企业债务融资工具 | 102280164. IB | 1,269 | 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 | 20 重庆发展 MTN001 | 企业债务融资工具 | 102002033. IB | 3,809 | 100.4810 | 中国建设银行股份有限公司 | 主承销商或联席承销商 |
| 59 | 21 益阳城投 MTN001 | 企业债务融资工具 | 102102158. IB | 2,116 | 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 昆交产 SCP002 | 企业债务融资工具 | 012283632. IB | 8,610 | 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 | 21 高淳经开 PPN002 | 企业债务融资工具 | 032191360. IB | 2,116 | 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 农行永续债 02 | 商业性金融债券 | 092280086. IB | 8,466 | 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 中国银行永续债 02 | 商业性金融债券 | 2228029. IB | 55,453 | 100.5922 | 中国建设银行股份有限公司 | 主承销商或联席承销商 |
| 64 | 21 长安汇通 PPN001 | 企业债务融资工具 | 032191358. IB | 1,269 | 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 | 21 淄博城资 MTN002 | 企业债务融资工具 | 102103081. IB | 8,466 | 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 津城建 MTN004 | 企业债务 融资工具 | 102281111. IB | 7, 576 | 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 滨建投 SCP012 | 企业债务 融资工具 | 012283364. IB | 8, 659 | 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 | 22 津城建 MTN008 | 企业债务 融资工具 | 102281425. IB | 6, 494 | 100. 0000 | 中国建设银行 股份有限公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 69 | 22 津城建 CP033 | 企业债务 融资工具 | 042280492. IB | 4, 329 | 100. 0000 | 中国建设银行 股份有限公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 70 | 22 广投能 源 SCP002 | 企业债务 融资工具 | 012282144. IB | 3, 247 | 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 | 22 津城建 CP024 | 企业债务 融资工具 | 042280419. IB | 1, 623 | 100. 0000 | 中国建设银行 股份有限公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 72 | 22 云能投 MTN005 | 企业债务 融资工具 | 102281652. IB | 10, 823 | 100. 0000 | 中国建设银行 股份有限公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 73 | 22 晋能山 西 CP001 | 企业债务 融资工具 | 042280163. IB | 6, 494 | 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 | 22 滨建投 SCP011 | 企业债务 融资工具 | 012283237. IB | 14, 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 |
| 75 | 22 株洲城 建 SCP003 | 企业债务 融资工具 | 012284147. IB | 2, 164 | 100. 0000 | 中国建设银行 股份有限公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 76 | 22 云能投 SCP011 | 企业债务 融资工具 | 012281558. IB | 21, 647 | 100. 0000 | 中国建设银行 股份有限公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 77 | 22 津城建 CP025 | 企业债务 融资工具 | 042280423. IB | 3, 788 | 100. 0000 | 中国建设银行 股份有限公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 78 | 20 淮北建 投 PPN004 | 企业债务 融资工具 | 032000669. IB | 1, 066 | 102. 6776 | 中国建设银行 股份有限公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 79 | 20 飞驰鹏 誉 ABN002 优先 | 资产支持 证券 | 082000486. IB | 3, 333 | 101. 3298 | 中国建设银行 股份有限公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 80 | 22 光穗甬 开 ABN001 优先 | 资产支持 证券 | 082280635. IB | 266 | 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 | 19 住元 1A2 | 资产支持 证券 | 1989071. IB | 13, 335 | 43. 5760 | 建信信托有 限责任公 司, 中国建 | 计划管理 人, 主承销 商或联席承 |

| | | | | | | | |
|----|-----------------------------|--------------|---------------|--------|----------|----------------------|----------------|
| | | | | | | 设银行股份 有限公司 | 销商 |
| 82 | 19 建元 8A3_bc | 资产支持 证券 | 1989325. IB | 2,667 | 69.9545 | 建信信托有 限责任公司 | 计划管理人 |
| 83 | 21 兴业银 行二级 03 | 商业性金 融债券 | 2128043. IB | 3,915 | 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 建设银 行二级 01 | 商业性金 融债券 | 2128025. IB | 1,957 | 99.7281 | 中国建设银 行股份有限 公司 | 债务主体 |
| 85 | 21 工商银 行二级 01 | 商业性金 融债券 | 2128002. IB | 7,830 | 102.1997 | 中国建设银 行股份有限 公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 86 | 22 兴业银 行二级 01 | 商业性金 融债券 | 2228003. IB | 3,262 | 99.8249 | 中国建设银 行股份有限 公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 87 | 21 建设银 行二级 05 | 商业性金 融债券 | 2128049. IB | 1,305 | 100.3469 | 中国建设银 行股份有限 公司 | 债务主体 |
| 88 | 21 兴业银 行二级 01 | 商业性金 融债券 | 2128032. IB | 3,915 | 101.4388 | 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 MTN002B | 企业债务 融资工具 | 102101521. IB | 3,915 | 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 中建四 局 MTN001 | 企业债务 融资工具 | 102001942. IB | 652 | 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 | 21 中交二 公 MTN001 | 企业债务 融资工具 | 102101056. IB | 5,220 | 100.5447 | 中国建设银 行股份有限 公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 92 | 20 兖矿 MTN002 | 企业债务 融资工具 | 102001743. IB | 1,305 | 100.0033 | 中国建设银 行股份有限 公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 93 | 22 万鑫建 发 ABN001 优先 | 资产支持 证券 | 082200121. IB | 1,305 | 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 | 21 兴业银 行二级 02 | 商业性金 融债券 | 2128042. IB | 3,262 | 100.7699 | 中国建设银 行股份有限 公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 95 | 22 工商银 行二级 01 | 商业性金 融债券 | 2228004. IB | 10,441 | 99.0085 | 中国建设银 行股份有限 公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 96 | 20 昊华(疫 情防控 债) MTN001 | 企业债务 融资工具 | 102000760. IB | 652 | 97.9596 | 中国建设银 行股份有限 公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 97 | 20 中建四 局 MTN002 | 企业债务 融资工具 | 102002093. IB | 1,305 | 100.0000 | 中国建设银 行股份有限 | 主承销商或 联席承销商 |

| | | | | | | | |
|-----|--------------------|--------------|---------------|--------|----------|------------------|----------------|
| | | | | | | 公司 | |
| 98 | 20 苏豪 MTN001 | 企业债务 融资工具 | 102000229. IB | 652 | 98.5135 | 中国建设银行 股份有限公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 99 | 21 川能投 MTN002A | 企业债务 融资工具 | 102101520. IB | 2,610 | 100.0000 | 中国建设银行 股份有限公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 100 | 20 中交一 公 MTN002 | 企业债务 融资工具 | 102001134. IB | 3,262 | 99.7043 | 中国建设银行 股份有限公司 | 主承销商或 联席承销商 |
| 101 | 21 建设银 行二级 03 | 商业性金 融债券 | 2128033. IB | 14,356 | 100.5610 | 中国建设银行 股份有限公司 | 债务主体 |
| 102 | 22 鲁宏桥 CP002 | 企业债务 融资工具 | 042280376. IB | 1,957 | 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