

建信理财私行精选“恒星”五星优选混合类封闭式产品

2021年第2期2022年四季度暨年度投资管理报告

报告日：2022年12月31日

建信理财私行精选“恒星”五星优选混合类封闭式产品2021年第2期于2022年01月11日正式成立。截至报告日，本产品规模为344,062,487.21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0.989624。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)	0.989624	0.989624	344,062,487.21
一个月前	0.996617	0.996617	346,493,952.56
二个月前	0.989492	0.989492	344,016,612.83
三个月前	0.994378	0.994378	345,715,345.93
六个月前	0.999589	0.999589	347,527,214.05
一年前	-	-	-

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0.989624。

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
建信理财私行精选“恒星”五星优选混合类封闭式产品2021年第2期	2021-12-28	2022-01-10	2022-01-11	2024-01-17

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陕西省分行

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	160.86	0.47%	1,205.72	3.38%
同业存单	0.00	0.00%	0.00	0.00%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	0.00	0.00%
债券	0.00	0.00%	7,645.18	21.46%
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%	69.88	0.20%
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%	318.85	0.89%
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	11,152.54	32.28%	26,386.55	74.07%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	23,233.65	67.25%	0.00	0.00%
委托投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	34,547.05	100.00%	35,626.19	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.41%

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	华夏磐泰混合 (LOF) C	15,020,990.44	4.20%
2	交银恒益灵活配置混合 C	14,697,917.93	4.11%
3	华泰柏瑞鼎利混合 A	13,913,062.64	3.89%

4	华泰柏瑞新利混合 A	13,903,205.13	3.89%
5	华泰柏瑞恒泽混合 C	12,033,886.95	3.37%
6	华夏睿磐泰利混合 C	11,752,104.05	3.29%
7	鹏华弘惠混合 A	10,401,038.44	2.91%
8	南方荣光灵活配置混合 A	10,364,474.77	2.90%
9	交银稳固收益债券 A	9,438,696.46	2.64%
10	兴全稳泰债券 A	8,041,672.41	2.25%

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

本产品为封闭式产品。主要投资于标准化资产，资产流动性较好。若产品投资非标债权类资产，则严格匹配产品期限，非标债权类资产的到期日在产品到期日之前。

（二）产品的投资风险情况

本产品为混合类策略，以固收资产打底，通过配置权益资产获得收益，权益投资主要以公募基金为主。其中固收类资产投资占比不高于 80%，其他非固收类资产投资占比不超过 30%，目标是在承受较低的风险水平下获取收益。

本产品动态调整组合资产之间的配比。在固收资产上，四季度维持短久期策略，控制组合利率风险。在权益资产上，权益资产主要优选偏股型基金和股票型基金，配置比例较上季度末有所增加，权益风格偏均衡。产品配置金融衍生品的目的均为对冲组合面临的风险。

全年来看，由于受疫情影响，各大类资产波动较大，为了控制

产品波动，主要进行以下操作：一是，二季度末降低债券基金配置比例，降低组合久期，规避债券市场调整对组合净值影响；二是，在三季度，根据市场风格变化，逐步降低前期涨幅较大偏股型基金和股票型基金比例，使持仓风格更均衡，并通过增配打新公募基金，获取稳健收益。

未来产品积极挖掘固收市场和公募基金中潜在的投资机会，实现产品投资策略多元化，力争在实现产品净值稳定的基础上提升产品收益。

六、托管人报告

1. 报告期内本计划托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在对理财产品的托管过程中，严格遵守了国家有关法律法规、理财产品说明书和其他有关规定，不存在损害产品份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

2. 托管人对报告期内本计划投资运作遵规守信、财产估值等情况的说明

本报告期内，本托管人严格按照国家法律法规、本理财产品说明书和其他有关规定，对本理财产品财产估值的计算等方面进行了认真的复核，对本理财产品的投资运作方面进行了监督，未发现管理人存在损害产品份额持有人利益的行为。

3. 托管人对本报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本理财产品报告中的报告期投资者实际收益率内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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	61050190290009 200068	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 陕西省分行
---	-----	--------------------------	------------------------	-----------------------

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	交易数量	交易净价	关联方名称	关联方角色
1	20 赣国资 MTN001	企业债务融资工具	102000037. IB	2,092	100.3832	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
2	20 南京钢铁 MTN001	企业债务融资工具	102001076. IB	6,277	100.6813	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
3	19 工商银行永续债	商业性金融债券	1928018. IB	4,184	101.4723	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
4	22 飞驰财信 ABN002 优先	资产支持证券	082280586. IB	1,647	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
5	22 四川能投 ABN001 优先	资产支持证券	082280643. IB	366	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	22 鲁黄金 ABN001 优先	资产支持证券	082280280. IB	3,661	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
7	21 西电电力 ABN001 优先	资产支持证券	082101446. IB	3,661	98.3626	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
8	21 前海北投 ABN001 优先	资产支持证券	082100552. IB	8,456	100.3612	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
9	22 飞驰强链 ABN001 优先	资产支持证券	082280559. IB	366	99.9000	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
10	22 飞驰财信 ABN001 优先	资产支持证券	082280456. IB	5,345	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	21 山西建投 ABN002 优先	资产支持证券	082101489. IB	4,004	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	21 飞驰惟安 ABN001	资产支持证券	082100172. IB	1,592	100.0000	建信信托有限责任公司	计划管理人, 主承销

	优先 A1					司, 中国建设银行股份 有限公司	商或联席承 销商
13	20 金泰国 贸 ABN001 优先	资产支持 证券	082000962. IB	2, 068	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 飞驰惟 安 ABN001 优先 A2	资产支持 证券	082100173. IB	1, 574	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
15	20 建光广 投 ABN001 优先	资产支持 证券	082000529. IB	9, 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
16	22 农业银 行永续债 01	商业性金 融债券	2228011. IB	33, 354	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 中国银 行永续债 02	商业性金 融债券	2128045. IB	796	99. 9951	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
18	22 杭州日 报 MTN001	企业债务 融资工具	102280897. IB	99	100. 0000	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
19	21 厦国贸 控 MTN006	企业债务 融资工具	102101666. IB	995	100. 4576	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
20	21 苏豪 MTN001	企业债务 融资工具	102100394. IB	995	102. 1295	中国建设银 行股份有限 公司	主承销商或 联席承销商
21	21 晋能电 力 MTN015	企业债务 融资工具	102103210. IB	1, 493	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 云南交 投 MTN001	企业债务 融资工具	102280415. IB	2, 688	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 华阳新 材 MTN002	企业债务 融资工具	102280404. IB	2, 489	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 鲁能源 MTN001	企业债务 融资工具	102280239. IB	99	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 河南农 开 MTN001	企业债务 融资工具	102280223. IB	298	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 淮安国 投 MTN003	企业债务 融资工具	102103248. IB	398	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	21 赣投 MTN001	企业债务 融资工具	102101632. IB	1,493	100.5436	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
28	21 皖农垦 MTN001	企业债务 融资工具	102101976. IB	995	100.9302	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
29	22 华润资 产 MTN001	企业债务 融资工具	102280868. IB	99	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 中建投 资 MTN002	企业债务 融资工具	102103346. IB	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
31	21 苏海投 资 MTN001	企业债务 融资工具	102103327. IB	597	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	21 湖北文 旅 MTN003	企业债务 融资工具	102102330. IB	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
33	21 长沙经 开 MTN002	企业债务 融资工具	102103192. IB	398	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 闽国资 MTN001	企业债务 融资工具	102102247. IB	497	99.4239	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
35	21 渝医药 MTN001	企业债务 融资工具	102103043. IB	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
36	21 长发集 团 MTN002	企业债务 融资工具	102101977. IB	1,991	100.9574	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
37	21 昆明轨 道 MTN001	企业债务 融资工具	102101052. IB	995	102.1700	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
38	21 海沧投 资 MTN003	企业债务 融资工具	102102299. IB	99	99.5884	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
39	22 渝医药 MTN001	企业债务 融资工具	102280164. IB	298	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 中国银 行永续债 01	商业性金 融债券	2128019. IB	2,589	102.5102	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
41	21 云能投 MTN002	企业债务 融资工具	102101660. IB	2,987	100.5653	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
42	21 江门高 新 MTN001	企业债务 融资工具	102103204. IB	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

43	21 华发集团 MTN009	企业债务融资工具	102101775. IB	1,493	100.7593	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
44	21 益阳交投 MTN002	企业债务融资工具	102101823. IB	1,095	100.1841	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
45	21 中国信达债 01	商业性金融债券	092100008. IB	5,277	99.9144	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
46	21 建发 MTN001	企业债务融资工具	102101832. IB	2,987	101.3505	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
47	22 滨江城建 MTN001	企业债务融资工具	102200091. IB	99	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 长安汇通 PPN001	企业债务融资工具	032191358. IB	995	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 鄂联投 MTN001	企业债务融资工具	102102242. IB	497	101.4651	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
50	21 陕投集团 MTN005	企业债务融资工具	102101525. IB	298	101.0980	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
51	21 淄博城资 MTN002	企业债务融资工具	102103081. IB	697	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	21 川能投 MTN002B	企业债务融资工具	102101521. IB	1,493	101.2730	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
53	21 高淳经开 PPN002	企业债务融资工具	032191360. IB	1,394	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
54	21 长城资本债 01BC	商业性金融债券	092100012. IB	3,983	100.8533	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
55	22 北部湾 MTN001	企业债务融资工具	102280032. IB	697	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	21 临沂投资 MTN002(革命老区)	企业债务融资工具	102102008. IB	2,632	100.8405	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
57	21 苏豪 MTN002	企业债务融资工具	102100747. IB	597	102.2872	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
58	21 津城建 MTN001	企业债务融资工具	102101907. IB	1,194	98.0409	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

						公司	
59	21 华电山能 ABN001 优先	资产支持证券	082180086. IB	234	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 飞驰林语 ABN001 优先	资产支持证券	082280315. IB	1,483	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
61	22 中国信达债 01	商业性金融债券	092280003. IB	10,953	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	8,512	97.2930	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
63	22 中行二级资本债 02A	商业性金融债券	092280108. IB	19,862	97.3888	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
64	22 工商银行二级 01	商业性金融债券	2228004. IB	14,187	98.2368	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（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。

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

附录一

建信理财私行精选“恒星”五星优选混合类封闭式产品 2021 年第 2 期投资非 标准化债权及股权类资产清单

报告日：2022 年 12 月 31 日

我司依照监管要求，现对建信理财私行精选“恒星”五星优选混合类封闭式产品 2021 年第 2 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。