

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2023年一季度投资管理报告

报告日：2023年03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350,573,627.39元。

一、报告期投资者实际收益率

截至2023年03月31日，产品单位净值为1.008352。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) | 1.008352 | 1.008352 | 350,573,627.39 |
| 一个月前 | 1.007190 | 1.007190 | 350,169,805.84 |
| 二个月前 | 1.007361 | 1.007361 | 350,229,047.74 |
| 三个月前 | 0.989624 | 0.989624 | 344,062,487.21 |
| 六个月前 | 0.994378 | 0.994378 | 345,715,345.93 |
| 一年前 | 0.990621 | 0.990621 | 345,399,663.03 |

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1.008352。

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 | 1,421.65 | 4.04% | 2,612.46 | 7.38% |
| 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% | 14.23 | 0.04% |
| 债券 | 0.00 | 0.00% | 2,527.08 | 7.14% |
| 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% | 76.22 | 0.22% |
| 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% | 421.92 | 1.19% |
| 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 | 14,449.45 | 41.01% | 29,749.25 | 84.03% |
| 私募基金 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 资产管理产品 | 19,360.88 | 54.95% | 0.00 | 0.00% |
| 委托投资——协议方式 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 合计 | 35,231.98 | 100.00% | 35,401.16 | 100.00% |

期末穿透前杠杆比例为：100.50%

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 | 15,516,597.99 | 4.38% |
| 2 | 华泰柏瑞新利混合 A | 14,285,244.66 | 4.03% |

| | | | |
|----|--------------|---------------|-------|
| 3 | 富国双债增强债券 C | 13,372,471.53 | 3.77% |
| 4 | 招商安华债券 C | 12,443,553.67 | 3.51% |
| 5 | 华泰柏瑞恒泽混合 C | 12,382,956.04 | 3.49% |
| 6 | 广发集裕债券 C | 11,431,574.39 | 3.23% |
| 7 | 富国双债增强债券 A | 10,949,622.65 | 3.09% |
| 8 | 广发集裕债券 A | 10,675,504.95 | 3.01% |
| 9 | 鹏华弘惠混合 A | 10,527,211.37 | 2.97% |
| 10 | 南方荣光灵活配置混合 A | 10,509,480.74 | 2.96% |

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，一季度积极把握市场超跌机会，适当拉长久期。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。

一季度主要进行以下操作：一是，一月份增加权益仓位，把握

权益市场上行的机会；二是，二三月份积极把握债券市场的机会，适当拉长久期。

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 南京钢铁 MTN001 | 企业债务融资工具 | 102001076. IB | 4,743 | 100.6813 | 中国建设银行股份有限公司 | 主承销商或联席承销商 |
| 2 | 19 工商银行永续债 | 商业性金融债券 | 1928018. IB | 3,162 | 101.4723 | 中国建设银行股份有限公司 | 主承销商或联席承销商 |
| 3 | 22 农行永续债 02 | 商业性金融债券 | 092280086. IB | 11,947 | 97.2930 | 中国建设银行股份有限公司 | 主承销商或联席承销商 |
| 4 | 22 工商银行二级 01 | 商业性金融债券 | 2228004. IB | 19,911 | 98.2368 | 中国建设银行股份有限公司 | 主承销商或联席承销商 |
| 5 | 22 农业银行永续债 01 | 商业性金融债券 | 2228011. IB | 11,947 | 98.0438 | 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。

特此公告

建信理财有限责任公司

2023年03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：2023年03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。