

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 2023 年二季度暨半年投资管理报告

报告日：2023 年 06 月 30 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 391,014,921.25 元。

一、报告期投资者实际收益率

截至 2023 年 06 月 30 日，产品单位净值为 1.160581。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)	1.160581	1.160581	391,014,921.25
一个月前	1.157960	1.157960	536,206,891.12
二个月前	1.153130	1.153130	533,969,972.42
三个月前	1.148543	1.148543	531,846,064.68
六个月前	1.134860	1.134860	525,509,826.86
一年前	1.129347	1.129347	522,957,394.52

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

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	488.81	1.25%	1,104.99	2.83%
同业存单	0.00	0.00%	4,716.33	12.06%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	2,690.82	6.88%
债券	0.00	0.00%	30,154.21	77.10%
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%	443.52	1.13%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	38,624.50	98.75%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	39,113.31	100.00%	39,109.88	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.03%

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	13,468,659.77	3.39%
2	铁托 2 优	12,995,247.86	3.27%

3	GC007	12,337,358.72	3.11%
4	北控1优	9,252,402.79	2.33%
5	19工商银行永续债	8,908,150.20	2.24%
6	生物R1优	8,599,632.99	2.16%
7	21光穗华能ABN001优先	8,480,848.21	2.13%
8	PR上万优	7,575,072.19	1.91%
9	19中国银行永续债01	6,457,294.08	1.63%
10	中上航优	6,407,666.85	1.61%

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

回顾 2023 上半年，债市总体走强，且结构性“资产荒”演绎不断深化，背后关键在于基本面的弱修复形态，以及政策端的“稳中求进”：（1）2023 年初-春节前：市场主要交易疫后复苏，资金面季节性收敛，叠加理财赎回潮余震仍存，债市利率总体上行；（2）春节后-两会召开前：信贷投放加速背景下，流动性受到挤占，资金面紧平衡，短端利率抬升；而经济基本面和政策均处观察期，预期定价相对充分，长端利率横盘震荡；信用债表现较强；（3）两会召开后-3 月底：两会后市场预期下修，基本面不弱，长端震荡向下但幅度不大，资金面由紧转松，助推市场行情，结构性“资产荒”不断深化，二永债受到追捧；（4）4 月初-5 月初：经济金融修复放缓，资金面好于预期，4 月末政治局会议并无超预期表述，利多因素叠加下，利率债表现更强，信用债表现也仍不弱，机构投资者进

一步拉长久期；（5）5月初-6月中旬：基本面和政策因素已经在定价当中体现，长端利率难以进一步下探，资金面偏宽之下，曲线向“牛陡”演绎；而信用利差有所走扩；（6）6月中旬至二季度末：降息落地后市场又快速转向至交易政策预期，叠加季末资金面边际收敛，利率债与二永债演绎“过山车”行情，而信用利差则在降息回调之后有所走扩。回顾二季度，十年期国债下行 22bp、5 年期国有大行永续债下行 38bp、3 年期 AAA 信用债下行 16bp、3 年期 AA+ 信用债下行 30bp。进入三季度，从当前经济金融宏观图景看，预计货币政策仍需精准投放呵护流动性平稳，资金面整体仍维持宽松基调，在一揽子稳经济政策下，加强各类政策的协调配合；增量政策的出台力度和方式仍需持续观察，但整体基调来看，高质量发展目标下或维持政策体系的延续性和协调性，继续关注政治局会议定调与后续稳增长措施的落地，预计债市波动将加大。

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	数量	净价	关联方名称	关联方角色
1	21 粤澳 ABN001 优先	资产支持证券	082180078. IB	5,604	100.0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
2	22 粤澳 ABN001 优先	资产支持证券	082280418. IB	16,625	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	步步高 1	资产支持证券	121539. SZ	8,592	98.9208	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
4	21 中联重科 ABN001 优先 A2	资产支持证券	082100800. IB	35,492	9.2100	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
5	20 金风科技 MTN001	企业债务融资工具	102001672. IB	56,040	101.8657	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
6	19 建元 1A3_bc	资产支持证券	1989045. IB	18,680	37.2487	建信信托有限责任公司	计划管理人
7	20 云南资产 PPN001	企业债务融资工具	032000644. IB	28,020	102.1182	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
8	21 光穗华能 ABN001 优先	资产支持证券	082100470. IB	83,825	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	GC 绿源 03	资产支持证券	183484. SH	1,555	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
10	21 飞驰建瓴 ABN001 优先	资产支持证券	082100312. IB	44,945	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
11	22 中国银行永续债 01	商业性金融债券	2228023. IB	16,532	100.4858	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
12	22 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2228011. IB	8,596	99.9615	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

13	22 中国银行二级 01	商业性金融债券	2228006. IB	5, 878	100. 5711	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
14	22 工商银行二级 01	商业性金融债券	2228004. IB	13, 889	100. 8247	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
15	22 浙银租赁货运物流主题债	商业性金融债券	2222004. IB	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
16	21 工商银行二级 02	商业性金融债券	2128051. IB	367	101. 0138	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
17	21 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2128038. IB	9, 919	100. 5399	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
18	20 工商银行二级 02	商业性金融债券	2028049. IB	734	102. 8110	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
19	22 工商银行二级 03	商业性金融债券	2228024. IB	1, 836	101. 0028	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
20	23 中行永续债 01	商业性金融债券	242380008. IB	18, 369	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
21	22 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2228029. IB	27, 921	100. 5922	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
22	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	6, 236	100. 3616	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
23	19 工商银行永续债	商业性金融债券	1928018. IB	84, 041	101. 7981	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
24	21 工商银行永续债 01	商业性金融债券	2128021. IB	6, 245	101. 5918	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
25	21 临沂投资 MTN003	企业债务融资工具	102102176. IB	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
26	22 晋能煤业 MTN013(科创票据)	企业债务融资工具	102281337. IB	4, 041	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 淄博城运 MTN003	企业债务融资工具	102103220. IB	4, 041	96. 3159	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商

28	22 昆山国 创 MTN007	企业债务 融资工具	102282049. IB	3, 673	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
29	22 北部湾 MTN001	企业债务 融资工具	102280032. IB	2, 571	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 曲文投 MTN001	企业债务 融资工具	102281604. IB	12, 759	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 象屿 MTN001 (科 创票据)	企业债务 融资工具	102281255. IB	7, 347	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 合肥产 投 MTN001 (科 创票据)	企业债务 融资工具	102281241. IB	6, 245	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 新庐陵 MTN001	企业债务 融资工具	102281265. IB	5, 143	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 昆钢 MTN001	企业债务 融资工具	102280779. IB	7, 347	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 中建投 资 MTN001 (绿 色)	企业债务 融资工具	102280709. IB	293	100. 4816	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
36	22 渝兴永 MTN001	企业债务 融资工具	102280163. IB	551	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 晋能电 力 MTN015	企业债务 融资工具	102103210. IB	5, 143	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 渝高建 投 MTN001	企业债务 融资工具	102102220. IB	2, 204	100. 1898	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
39	21 淮安国 投 MTN003	企业债务 融资工具	102103248. IB	1, 102	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 渝医药 MTN001	企业债务 融资工具	102280164. IB	1, 102	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 昆交产 SCP002	企业债务 融资工具	012283632. IB	9, 682	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 五凌 1 号 ABN001 优先 A	资产支持 证券	082280989. IB	1, 102	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	23 赣投 MTN001	企业债务 融资工具	102381502. IB	1, 836	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 长安汇 通 PPN001	企业债务 融资工具	032191358. IB	1, 102	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	21 工商银 行永续债 02	商业性金 融债券	2128044. IB	1, 836	100. 1892	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
46	21 川能投 MTN002A	企业债务 融资工具	102101520. IB	4, 326	100. 2123	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
47	22 云天化 MTN001	企业债务 融资工具	102281519. IB	3, 673	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 江门高 新 MTN001	企业债务 融资工具	102103204. IB	1, 102	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 淄博城 资 MTN002	企业债务 融资工具	102103081. IB	6, 613	95. 8070	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
50	19 兴业银 行二级 01	商业性金 融债券	1928022. IB	6, 531	101. 4951	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
51	22 云能投 MTN005	企业债务 融资工具	102281652. IB	11, 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
52	23 滨建投 SCP003	企业债务 融资工具	012380454. IB	7, 257	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 津城建 MTN004	企业债务 融资工具	102281111. IB	5, 080	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	22 津城建 CP024	企业债务 融资工具	042280419. IB	1, 836	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	23 津城建 SCP001	企业债务 融资工具	012380174. IB	5, 080	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 CP025	企业债务 融资工具	042280423. IB	4, 285	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 津城建 CP033	企业债务 融资工具	042280492. IB	2, 902	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 株洲城 建 SCP003	企业债务 融资工具	012284147. IB	2, 947	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 MTN011	企业债务 融资工具	102281818. IB	9,975	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	23 甬交投 SCP002	企业债务 融资工具	012381182. IB	4,987	100.0008	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
61	23 南通高 新 SCP004	企业债务 融资工具	012381591. IB	1,496	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	23 津城建 SCP016	企业债务 融资工具	012381163. IB	2,493	100.0107	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
63	23 交通银 行小微债 01	商业性金 融债券	2328006. IB	3,536	100.1882	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
64	22 兴业银 行二级 01	商业性金 融债券	2228003. IB	3,536	99.8249	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
65	21 建设银 行二级 05	商业性金 融债券	2128049. IB	1,414	100.3469	中国建设银行 股份有限公司	债务主体
66	21 建设银 行二级 03	商业性金 融债券	2128033. IB	15,562	100.5610	中国建设银行 股份有限公司	债务主体
67	21 建设银 行二级 01	商业性金 融债券	2128025. IB	2,122	99.7281	中国建设银行 股份有限公司	债务主体
68	21 兴业银 行二级 01	商业性金 融债券	2128032. IB	4,244	101.4388	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
69	21 兴业银 行二级 02	商业性金 融债券	2128042. IB	3,536	100.7699	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
70	22 鲁宏桥 CP002	企业债务 融资工具	042280376. IB	2,122	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	21 兴业银 行二级 03	商业性金 融债券	2128043. IB	4,244	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	20 中建四 局 MTN001	企业债务 融资工具	102001942. IB	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
73	21 工商银 行二级 01	商业性金 融债券	2128002. IB	8,488	102.1997	中国建设银行 股份有限公司	主承销商或 联席承销商
74	21 川能投 MTN002B	企业债务 融资工具	102101521. IB	4,244	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	20 中建四局 MTN002	企业债务融资工具	102002093. IB	1,414	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）理财产品投资关联方发行的资产管理产品

日期	资产管理产品名称	投资类型	金额	份额	关联方名称
2023-06-06	建信基金乐赢 2 号集合资产管理计划	赎回	30,802,203.30	30,000,000.00	建信基金管理有限责任公司

（三）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

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。

特此公告

建信理财有限责任公司

2023 年 06 月 30 日

附录一

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投资非标准化债权及股权类资产清单

报告日：2023 年 06 月 30 日

我司依照监管要求，现对建信理财“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。