

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 2024 年一季度投资管理报告

报告日：2024 年 03 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 398,663,625.50 元。

一、报告期投资者实际收益率

截至 2024 年 03 月 31 日，产品单位净值为 1.183283。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	1.183283	1.183283	398,663,625.50
一个月前	1.180898	1.180898	397,860,186.39
两个月前	1.177629	1.177629	396,758,689.35
三个月前	1.174586	1.174586	395,733,661.99
六个月前	1.166760	1.166760	393,096,849.87
一年前	1.148543	1.148543	531,846,064.68

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	1,297.90	3.25%	7,917.74	19.54%
同业存单	0.00	0.00%	6,705.09	16.55%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	4,777.23	11.79%
债券	0.00	0.00%	20,855.05	51.46%
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%	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%	269.94	0.67%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	38,578.60	96.75%	0.00	0.00%
委托投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	39,876.49	100.00%	40,525.06	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	GC007	40,959,852.98	10.01%
2	19 工商银行永续债	18,902,799.40	4.62%
3	19 农业银行永续债	16,539,975.05	4.04%

4	24 农业银行 CD024	12,685,980.25	3.10%
5	20 农业银行永续债 01	12,383,625.56	3.03%
6	23 国开 03	9,515,220.34	2.33%
7	19 华夏银行永续债	8,818,856.63	2.16%
8	19 交通银行永续债	7,489,514.53	1.83%
9	19 兴业银行二级 02	7,368,416.68	1.80%
10	24 国开 05	7,331,663.37	1.79%

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、流动性风险可控。

（二）市场情况

一季度经济延续复苏，2月CPI为0.7%，出口数据同比超预期，3月制造业PMI重回荣枯线以上，非制造业PMI也继续回升，显示出经济基本面的企稳修复。债市1月和2月利率显著下行，进入3月份后开始震荡。展望二季度，虽然一季度的出口和PMI数据超预期，但地产投资的持续低迷和房企资金链紧张的局面未得到有效缓解，这可能会对市场情绪产生一定的压制，需要进一步跟踪宏观数据情况进行判断。

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	32050159863600000775-0009	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	24 农行永续债 01	商业性金融债券	242400005. IB	21, 460	100. 0683	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
2	21 工商银行二级 02	商业性金融债券	2128051. IB	35, 767	102. 2957	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
3	21 工商银行永续债 02	商业性金融债券	2128044. IB	14, 307	102. 5786	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
4	21 兴业银行二级 01	商业性金融债券	2128032. IB	28, 614	103. 1313	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
5	20 农业银行永续债 02	商业性金融债券	2028032. IB	50, 075	103. 1440	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
6	21 工商银行永续债 01	商业性金融债券	2128021. IB	64, 382	103. 0317	中国建设银行股份有限公司, 中国	主承销商或联席承销

						建设银行股份有限公司	商, 承销团成员
7	21 工商银行二级 01	商业性金融债券	2128002. IB	21, 460	102. 9621	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
8	20 工商银行二级 02	商业性金融债券	2028049. IB	7, 153	102. 6671	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
9	20 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2028048. IB	50, 075	103. 7384	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
10	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	118, 781	101. 0947	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
11	20 工商银行二级 01	商业性金融债券	2028041. IB	50, 075	102. 6668	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
12	19 兴业银行二级 02	商业性金融债券	1928026. IB	71, 535	100. 9147	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
13	21 中国银行永续债 01	商业性金融债券	2128019. IB	42, 921	102. 8562	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
14	19 兴业银行二级 01	商业性金融债券	1928022. IB	5, 285	101. 0724	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
15	23 云能投 MTN005	企业债务融资工具	102383266. IB	6, 606	100. 0020	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
16	23 津城建 CP015	企业债务融资工具	042380530. IB	13, 212	100. 0066	中国建设银行股份有限	主承销商或联席承销

						公司, 中国建设银行股份有限公司	商, 承销团成员
17	24 招商局 SCP004	企业债务融资工具	012480901. IB	62, 100	100. 0032	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
18	24 海运集装 MTN001 (科创票据)	企业债务融资工具	102481100. IB	22, 461	100. 0046	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
19	22 云能投 MTN005	企业债务融资工具	102281652. IB	10, 570	100. 0026	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
20	24 天津轨交 SCP003	企业债务融资工具	012480458. IB	2, 642	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
21	24 云能投 MTN002	企业债务融资工具	102480131. IB	13, 212	100. 0017	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
22	22 津城建 MTN011	企业债务融资工具	102281818. IB	26, 425	100. 0000	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
23	23 信达乾元 ABN001 优先 A1	资产支持证券	082380804. IB	39, 638	100. 0067	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员
24	19 工商银行永续债	商业性金融债券	1928018. IB	182, 337	102. 3864	中国建设银行股份有限公司, 中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商, 承销团成员

(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
2024-03-14	建信基金乐赢 2 号集合资产管理计划	申购	107000000		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

2024 年 03 月 31 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：2024 年 03 月 31 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。