

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 年二季度暨半年投资管理报告

报告日：2024 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 330,817,865.59 元。

一、报告期投资者实际收益率

截至 2024 年 06 月 30 日，产品单位净值为 1.192873。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	1.192873	1.192873	330,817,865.59
一个月前	1.189208	1.189208	400,659,847.69
两个月前	1.186174	1.186174	399,637,703.61
三个月前	1.183283	1.183283	398,663,625.50
六个月前	1.174586	1.174586	395,733,661.99
一年前	1.160581	1.160581	391,014,921.25

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	1,030.62	3.11%	1,235.59	3.67%
同业存单	0.00	0.00%	8,527.10	25.30%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	2,173.56	6.45%
债券	0.00	0.00%	21,618.42	64.15%
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%	144.31	0.43%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	32,060.81	96.89%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	33,091.43	100.00%	33,698.97	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	21,735,605.02	6.45%
2	银行存款	12,343,104.13	3.66%
3	24 国开 05	9,231,534.13	2.74%
4	21 招商银行永续债	9,074,239.96	2.69%

5	19 工商银行永续债	8,995,701.23	2.67%
6	19 农业银行永续债 01	8,833,649.37	2.62%
7	23 农行永续债 01	6,703,413.44	1.99%
8	23 国开 03	6,536,194.55	1.94%
9	19 兴业银行二级 02	5,932,943.16	1.76%
10	24 农业银行 CD058	5,636,815.03	1.67%

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

2024 年 2 季度，债券市场方面，债券市场资产荒的主线逻辑未变，各品种、期限的收益率曲线整体继续下行，30 年国债收益率下行至低于 2.5%。

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	23 川投资 MTN002	企业债务融资工具	102383108. IB	1,435	101.7364	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
2	23 中银投资 MTN001	企业债务融资工具	102381123. IB	4,306	101.6263	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
3	22 兴蓉环境 MTN001	企业债务融资工具	102280864. IB	1,435	100.3015	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
4	21 赣铁航 MTN001	企业债务融资工具	102100122. IB	2,871	103.0896	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
5	24 汇金 MTN002	企业债务融资工具	102481828. IB	7,177	99.9268	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
6	23 锡产业 MTN005	企业债务融资工具	102381009. IB	1,435	101.8336	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
7	22 国联 MTN003	企业债务融资工具	102281491. IB	1,435	100.9506	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
8	24 农行永续债 02	商业性金融债券	242400009. IB	51,497	100.4156	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	24 农行永续债 01	商业性金融债券	242400005. IB	17,165	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
10	23 农行永续债 01	商业性金融债券	242380017. IB	62,940	103.5102	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	21 工商银行永续债 02	商业性金融债券	2128044. IB	11, 443	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
12	21 中国银行永续债 01	商业性金融债券	2128019. IB	34, 331	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
13	20 农业银行永续债 02	商业性金融债券	2028032. IB	40, 053	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
14	21 工商银行永续债 01	商业性金融债券	2128021. IB	51, 497	103. 0317	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	21 工商银行二级 01	商业性金融债券	2128002. IB	17, 165	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
16	20 工商银行二级 02	商业性金融债券	2028049. IB	5, 721	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
17	20 工商银行二级 01	商业性金融债券	2028041. IB	40, 053	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
18	20 中国银行永续债 02	商业性金融债券	2028048. IB	40, 053	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
19	21 兴业银行二级 01	商业性金融债券	2128032. IB	28, 609	103. 1844	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	19 兴业银行二级 02	商业性金融债券	1928026. IB	57, 218	100. 9147	中国建设银行股份有限公司, 中国	主承销商或联席承销商, 承销团成员

						建设银行股份有限公司	
21	21 工商银行二级 02	商业性金融债券	2128051. IB	28,609	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
22	24 重庆债 19	地方政府债券	2405456. IB	21,735	100.0261	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 兴业银行绿色金融债 02	商业性金融债券	2328018. IB	701	101.2801	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	24 交行绿债 01	商业性金融债券	222480001. IB	29,448	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
25	24 海运集装 MTN001(科创票据)	企业债务融资工具	102481100. IB	11,919	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
26	22 三峡 GN003(碳中和债)	企业债务融资工具	132280012. IB	701	100.3249	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
27	20 重庆轨交 GN002	企业债务融资工具	132000012. IB	701	101.2423	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
28	20 重庆轨交 GN001	企业债务融资工具	132000004. IB	4,908	101.1660	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
29	22 苏高新 GN001	企业债务融资工具	132280005. IB	701	100.7580	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
30	24 招商局 SCP006	企业债务融资工具	012481214. IB	35,057	100.0010	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
31	24 南昌轨交	企业债务融资工具	102480235. IB	701	101.5647	中国建设银行股份有限公司, 中国	主承销商或联席承销

	MTN001 (绿色)					建设银行股份有限公司	商, 承销团成员
32	24 天津轨交 SCP003	企业债务融资工具	012480458. IB	1, 402	100. 0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
33	24 招商局港 SCP001	企业债务融资工具	012481535. IB	14, 023	100. 0011	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
34	22 云能投 MTN005	企业债务融资工具	102281652. IB	5, 609	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
35	24 招商租赁 SCP008 (绿色)	企业债务融资工具	012481754. IB	4, 206	100. 0011	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
36	24 云能投 MTN002	企业债务融资工具	102480131. IB	7, 011	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
37	23 云能投 MTN005	企业债务融资工具	102383266. IB	3, 505	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
38	23 光大银行绿债 01	商业性金融债券	222380004. IB	4, 206	101. 5791	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
39	24 贵州高速 CP001	企业债务融资工具	042480259. IB	3, 505	100. 0012	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
40	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	36, 460	101. 2575	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
41	23 津城建 CP015	企业债务融资工具	042380530. IB	7, 011	100. 0066	中国建设银行股份有限公司, 中国	主承销商或联席承销商, 承销团成员

						建设银行股份有限公司	
42	24 华为 SCP003	企业债务融资工具	012481439. IB	14, 023	100. 0010	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
43	19 工商银行永续债	商业性金融债券	1928018. IB	86, 242	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
44	22 津城建 MTN011	企业债务融资工具	102281818. IB	14, 023	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
45	22 苏国信 GN001 (碳中和债)	企业债务融资工具	132280006. IB	1, 402	100. 6746	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
46	23 信达乾元 ABN001 优先 A1	资产支持证券	082380804. IB	21, 034	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

（二）理财产品投资关联方发行的资产管理产品

无

（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 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：2024 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)	产品投资 项目收益 率	风险状 况	本金余额 (万元)
------	--------	------	-------------------	-------------------	----------	--------------

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。