

建信理财“星座系列—白羊座”（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—白羊座”（按年）开放式净值型人民币理财产品于 2019 年 04 月 09 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 537,359,948.83 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 1.205899。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	1.205899	1.205899	537,359,948.83
一个月前	1.202014	1.202014	535,628,763.76
两个月前	1.198841	1.198841	539,384,168.76
三个月前	1.196265	1.196265	599,360,174.20
六个月前	1.187837	1.187837	595,137,525.48
一年前	1.172882	1.172882	587,644,329.61

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—白羊座”（按年）开放式净值型人民币理财产品	2019-03-26	2019-04-08	2019-04-09	-

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	1,655.22	3.08%	1,910.20	3.52%
同业存单	0.00	0.00%	13,304.25	24.53%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	4,113.90	7.59%
债券	0.00	0.00%	31,161.71	57.46%
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	3,469.97	6.46%	3,743.11	6.90%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	48,624.91	90.46%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	53,750.09	100.00%	54,233.17	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	41,139,041.62	7.59%
2	招商产业债券 A	34,699,697.53	6.40%
3	银行存款	19,079,770.19	3.52%
4	19 工商银行永续债	17,026,189.38	3.14%

5	19 农业银行永续债 01	16,719,473.36	3.08%
6	21 招商银行永续债	15,128,104.83	2.79%
7	23 农行永续债 01	11,175,585.13	2.06%
8	23 国开 03	10,896,806.43	2.01%
9	24 国开 05	10,327,970.75	1.90%
10	19 兴业银行二级 02	9,891,096.83	1.82%

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 000775-0007	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 02	商业性金融债券	242400009. IB	85,853	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
2	24 农行永续债 01	商业性金融债券	242400005. IB	28,617	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
3	23 农行永续债 01	商业性金融债券	242380017. IB	104,931	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
4	21 工商银行永续债 02	商业性金融债券	2128044. IB	19,078	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
5	21 中国银行永续债 01	商业性金融债券	2128019. IB	57,235	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
6	20 农业银行永续债 02	商业性金融债券	2028032. IB	66,774	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
7	21 工商银行永续债 01	商业性金融债券	2128021. IB	85,853	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
8	21 工商银行二级 01	商业性金融债券	2128002. IB	28,617	102.9621	中国建设银行股份有限公司	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
9	20 工商银行 二级 02	商业性金 融债券	2028049. IB	9, 539	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
10	20 工商银行 二级 01	商业性金 融债券	2028041. IB	66, 774	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
11	20 中国银行 永续债 02	商业性金 融债券	2028048. IB	66, 774	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
12	21 兴业银行 二级 01	商业性金 融债券	2128032. IB	47, 696	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
13	19 兴业银行 二级 02	商业性金 融债券	1928026. IB	95, 392	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
14	21 工商银行 二级 02	商业性金 融债券	2128051. IB	47, 696	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
15	24 重庆债 19	地方政府 债券	2405456. IB	41, 139	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
16	23 兴业银行 绿色金 融债 02	商业性金 融债券	2328018. IB	1, 327	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
17	24 交行绿 债 01	商业性金 融债券	222480001. IB	55, 737	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

18	24 海运集装 MTN001(科 创票据)	企业债务 融资工具	102481100. IB	22, 560	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 三峡 GN003(碳 中和债)	企业债务 融资工具	132280012. IB	1, 327	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
20	20 重庆轨 交 GN002	企业债务 融资工具	132000012. IB	1, 327	101. 2423	中国建设银行 股份有限公司	承销团成员
21	20 重庆轨 交 GN001	企业债务 融资工具	132000004. IB	9, 289	101. 1660	中国建设银行 股份有限公司	承销团成员
22	22 苏高新 GN001	企业债务 融资工具	132280005. IB	1, 327	100. 7580	中国建设银行 股份有限公司	承销团成员
23	24 招商局 SCP006	企业债务 融资工具	012481214. IB	66, 354	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
24	24 南昌轨 交 MTN001(绿 色)	企业债务 融资工具	102480235. IB	1, 327	101. 5647	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 天津轨 交 SCP003	企业债务 融资工具	012480458. IB	2, 654	100. 0000	中国建设银行 股份有限公司	承销团成员
26	24 招商局 港 SCP001	企业债务 融资工具	012481535. IB	26, 541	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
27	22 云能投 MTN005	企业债务 融资工具	102281652. IB	10, 616	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
28	24 招商租 赁 SCP008(绿 色)	企业债务 融资工具	012481754. IB	7, 962	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
29	24 云能投 MTN002	企业债务 融资工具	102480131. IB	13, 270	100. 0017	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
30	23 云能投 MTN005	企业债务 融资工具	102383266. IB	6, 635	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
31	23 光大银 行绿债 01	商业性金 融债券	222380004. IB	7, 962	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
32	24 贵州高 速 CP001	企业债务 融资工具	042480259. IB	6, 635	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
33	20 农业银 行永续债 01	商业性金 融债券	2028017. IB	69, 008	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
34	23 津城建 CP015	企业债务 融资工具	042380530. IB	13, 270	100. 0066	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 华为 SCP003	企业债务 融资工具	012481439. IB	26, 541	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
36	19 工商银 行永续债	商业性金 融债券	1928018. IB	163, 231	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
37	22 津城建 MTN011	企业债务 融资工具	102281818. IB	26, 541	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
38	22 苏国信 GN001 (碳 中和债)	企业债务 融资工具	132280006. IB	2, 654	100. 6746	中国建设银行 股份有限公司	承销团成员
39	23 信达乾 元 ABN001 优先 A1	资产支持 证券	082380804. IB	39, 812	100. 0067	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
--	--	--	--	--	--	----------------	--------------

（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—白羊座”（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—白羊座”（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。