

建信理财建信宝按日开放式净值型理财产品第 11 期 2024
年二季度暨半年投资管理报告

报告日：2024 年 06 月 30 日

建信理财建信宝按日开放式净值型理财产品第 11 期于 2023 年 11 月 15 日正式成立。截至报告日，本产品规模为 6,031,618,195.64 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 1.000000。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	1.000000	1.000000	6,031,618,195.64
一个月前	1.000000	1.000000	6,219,576,298.04
二个月前	1.000000	1.000000	6,186,329,693.82
三个月前	1.000000	1.000000	6,702,113,892.14
六个月前	1.000000	1.000000	18,826,301,113.60
一年前	-	-	-

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
建信理财建信宝按日开放式净值型理财产品第 11 期	2023-11-14	2023-11-14	2023-11-15	-

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上海市分行

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	76,348.92	12.65%	230,417.22	38.18%
同业存单	0.00	0.00%	287,641.72	47.67%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	0.00	0.00%
债券	0.00	0.00%	85,370.89	14.15%
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%	0.00	0.00%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	527,024.63	87.35%	0.00	0.00%
委托投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	603,373.55	100.00%	603,429.83	100.00%

期末穿透前杠杆比例为：100.04%

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	银行存款	2,302,931,781.07	38.17%
2	24 广发银行 CD013	199,802,917.00	3.31%
3	23 津城建 MTN003	178,798,767.74	2.96%
4	23 中信银行 CD156	99,973,495.35	1.66%

5	24 交通银行 CD018	99,927,746.28	1.66%
6	23 浦发银行 CD128	99,888,141.77	1.66%
7	24 广州农村商业银行 CD009	99,846,521.66	1.65%
8	24 广发银行 CD027	99,842,380.27	1.65%
9	23 兴业银行 CD248	99,709,781.07	1.65%
10	23 中信银行 CD175	99,704,433.40	1.65%

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

本理财产品主要投资于银行存款、高流动性信用债及银行存单等高流动性资产，故产品的流动性较好、风险较低。本产品在本季度期间流动性指标符合监管相关规定，未出现流动性问题。

（二）产品的投资风险情况

截至本报告期末，产品固定收益部分投资遵守合同规定的投资范围和比例限制，债券整体风险可控、价格波动可控。总体来看，债券组合整体票息尚可，估值较为稳定，持仓债券风险可控，组合债券仓位总体净值平稳。本产品所投资资产于本季度未发生违约等重大风险事件。

六、托管人报告

托管人在执行本理财产品的托管过程中，根据银监会的要求，严格遵守有关法律和保管合同的约定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何违背保管合同的行为。托管人未发现管理人有违背理财产品说明书约定的行为。

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	31050136360000 009646	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上海市分行

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 麓山投资 MTN001B	企业债务 融资工具	102000725. IB	200,000	101.4684	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 巨化 MTN002	企业债务 融资工具	102101263. IB	100,000	100.0267	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（元）	关联方名称
2024-06-28	建信资本稳盈 56 号单一资产管理计划	赎回	400000000	建信资本管理有限责任公司
2024-06-24	建信资本稳盈 56 号单一资产管理计划	申购	500000000	建信资本管理有限责任公司
2024-05-23	建信资本稳盈 56 号单一资产管理计划	申购	200000000	建信资本管理有限责任公司
2024-05-15	建信基金安心宝 2 号集合资产管理计划	赎回	20698913.6	建信基金管理有限责任公司
2024-04-18	建信基金安心宝 2 号集合资产管理计划	赎回	500029463.71	建信基金管理有限责任公司
2024-04-17	建信资本稳盈 56 号单一资产管理计划	赎回	300000000	建信资本管理有限责任公司
2024-04-11	建信资本稳盈 56 号单一资产管理计划	赎回	300000000	建信资本管理有限责任公司
2024-04-09	建信资本稳盈 56 号单一资产管理计划	申购	300000000	建信资本管理有限责任公司
2024-04-01	建信资本稳盈 56 号单一资产管理计划	申购	200000000	建信资本管理有限责任公司

（三）其他关联交易

无

九、期末现金管理类产品前十名份额持有人情况

序号	投资人类别	持有份额(万份)	占总份额比例(%)
1	普通个人	4,456.56	0.74%
2	普通个人	3,749.47	0.62%
3	普通个人	3,105.21	0.51%
4	普通个人	3,101.10	0.51%
5	普通个人	2,501.55	0.41%
6	普通个人	2,026.16	0.34%
7	普通个人	2,000.00	0.33%
8	普通个人	2,000.00	0.33%
9	普通个人	1,922.49	0.32%
10	普通个人	1,719.50	0.29%

十、投资非标准化债权及股权类资产清单（见附录一）

十一、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

2024 年 06 月 30 日

附录一

建信理财建信宝按日开放式净值型理财产品第 11 期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，现对建信理财建信宝按日开放式净值型理财产品第 11 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)	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。