

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 年三季度投资管理报告

报告日：2024 年 09 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 538,515,434.88 元。

一、报告期投资者实际收益率

截至 2024 年 09 月 30 日，产品单位净值为 1.208492。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	1.208492	1.208492	538,515,434.88
一个月前	1.209756	1.209756	539,078,782.40
二个月前	1.209971	1.209971	539,174,360.71
三个月前	1.205899	1.205899	537,359,948.83
六个月前	1.196265	1.196265	599,360,174.20
一年前	1.179332	1.179332	590,876,181.60

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	1,619.75	3.01%	2,020.81	3.62%
同业存单	0.00	0.00%	16,626.73	29.78%
拆放同业及买入返售	0.00	0.00%	5,939.71	10.64%
债券	0.00	0.00%	27,563.83	49.37%
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	3,473.26	6.45%	3,678.01	6.59%
私募基金	0.00	0.00%	0.00	0.00%
资产管理产品	48,772.74	90.54%	0.00	0.00%
委外投资——协议方式	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	53,865.75	100.00%	55,829.09	100.00%

本产品截至报告期末的穿透后杠杆率为：100.03%

注：穿透后杠杆率=期末穿透后总资产/期末穿透后净资产*100%

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	59,397,118.29	10.64%
2	招商产业债券 A	34,732,619.44	6.22%
3	银行存款	20,208,078.93	3.62%

4	24 工行永续债 01	19,216,744.19	3.44%
5	24 兴业银行永续债 01	18,039,649.86	3.23%
6	24 交行永续债 01BC	15,295,703.08	2.74%
7	23 农行永续债 01	14,305,757.94	2.56%
8	21 招商银行永续债	12,955,654.32	2.32%
9	24 农行永续债 02	11,417,936.23	2.05%
10	23 国开 05	8,787,042.00	1.57%

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 年第三季度，稳增长政策和资本市场政策力度大超预期。十年期国债震荡下行，从二季度末的 2.20% 下行到 2.15%；信用债先下后上，信用利差大幅走扩。展望后市，货币政策需持续保持支持性，预计广谱利率将继续下行。

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 工行永续债 01	商业性金融债券	242480007. IB	192, 225	100. 4926	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 02	商业性金融债券	242400009. IB	113, 342	100. 5900	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	24 农行永续债 01	商业性金融债券	242400005. IB	24, 487	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
4	23 农行永续债 01	商业性金融债券	242380017. IB	138, 760	103. 5937	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 兴业银行二级 01	商业性金融债券	2128032. IB	40, 811	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
6	22 兴业银行二级 01	商业性金融债券	2228003. IB	24, 487	103. 1588	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 中国银行永续债 01	商业性金融债券	2128019. IB	48, 974	102. 8562	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	
8	21 工商银 行永续债 01	商业性金 融债券	2128021. IB	73, 461	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
9	21 工商银 行二级 01	商业性金 融债券	2128002. IB	24, 487	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
10	20 工商银 行二级 02	商业性金 融债券	2028049. IB	8, 162	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
11	20 工商银 行二级 01	商业性金 融债券	2028041. IB	57, 136	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	24 大唐发 电 GN001(碳 中和债)	企业债务 融资工具	132480080. IB	65, 299	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
13	21 工商银 行永续债 02	商业性金 融债券	2128044. IB	16, 324	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
14	20 中国银 行永续债 02	商业性金 融债券	2028048. IB	57, 136	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
15	21 工商银 行二级 02	商业性金 融债券	2128051. IB	40, 811	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
16	24 交行永 续债 01BC	商业性金 融债券	242400020. IB	153, 861	100. 5083	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 中行永 续债 01	商业性金 融债券	242480008. IB	40, 811	99. 4917	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
18	24 湖北债 54	地方政府债券	2405686. IB	3,964	99.9200	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	24 重庆债 19	地方政府债券	2405456. IB	20,815	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
20	24 江西债 59	地方政府债券	2405826. IB	3,964	99.9800	中国建设银行股份有限公司	主承销商或联席承销商
21	24 吉林债 17	地方政府债券	2405546. IB	9,912	99.9920	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 河北债 37	地方政府债券	2405537. IB	25,771	99.8707	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	24 交行绿债 01	商业性金融债券	222480001. IB	41,630	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
24	23 光大银行绿债 01	商业性金融债券	222380004. IB	5,947	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
25	20 农业银行永续债 01	商业性金融债券	2028017. IB	51,542	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
26	22 三峡 GN003(碳中和债)	企业债务融资工具	132280012. IB	991	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	22 苏国信 GN001(碳中和债)	企业债务融资工具	132280006. IB	1,982	100.6746	中国建设银行股份有限公司	承销团成员

28	20 重庆轨交 GN002	企业债务融资工具	132000012. IB	991	101.2423	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	991	100.7580	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
30	24 天津轨交 SCP003	企业债务融资工具	012480458. IB	1,982	100.0000	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
31	24 新疆债 29	地方政府债券	2405628. IB	44,604	100.4070	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 厦翔业 SCP004	企业债务融资工具	012483096. IB	5,947	100.0034	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	23 兴业银行绿色金融债 02	商业性金融债券	2328018. IB	991	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
34	24 华为 SCP003	企业债务融资工具	012481439. IB	19,824	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
35	24 南昌轨交 MTN001 (绿色)	企业债务融资工具	102480235. IB	991	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
36	24 五凌电力 SCP001 (资产担保科创)	企业债务融资工具	012482644. IB	991	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
37	24 招商租赁 SCP008 (绿色)	企业债务融资工具	012481754. IB	5,947	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
38	23 云能投 MTN005	企业债务融资工具	102383266. IB	4,956	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

39	24 湖北债 22	地方政府债券	2405404. IB	4,956	100.9587	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	24 海运集装 MTN001 (科创票据)	企业债务融资工具	102481100. IB	16,850	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
41	23 信达乾元 ABN001 优先 A1	资产支持证券	082380804. IB	29,736	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
42	24 贵州高速 CP001	企业债务融资工具	042480259. IB	4,956	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
43	20 重庆轨交 GN001	企业债务融资工具	132000004. IB	6,938	101.1660	中国建设银行股份有限公司	承销团成员
44	24 云能投 MTN002	企业债务融资工具	102480131. IB	9,912	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
45	24 吉林债 19	地方政府债券	2405599. IB	19,824	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

(二) 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09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09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。