

中银理财-债市通 2 号
2022 年一季度投资运作情况报告

理财产品管理人：中银理财有限责任公司

理财产品托管人：中国银行股份有限公司

报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日

一、理财产品基本情况

理财产品代码	830101
理财产品名称	中银理财-债市通 2 号
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001020000260
产品类型	固定收益类产品
募集方式	公募
产品运作模式	开放式净值型产品
风险级别	02 二级(中低)
理财产品成立日	2018-11-15
理财产品到期日	无固定期限

二、存续规模和收益表现

截至报告期末，理财产品存续规模及收益表现如下：

理财产品总份额	2,161,161,897.88
理财产品份额净值	1.053853
理财产品累计净值	1.143853
理财产品资产净值	2,277,548,917.77
较上一报告月份净值增长率	0.73%

三、理财产品持仓情况

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	2,000.60	0.88%	2,000.60	0.88%
同业存单	39,330.64	17.23%	39,330.64	17.23%
拆放同业及买入返售	70,400.00	30.84%	70,400.00	30.84%
债券	116,517.24	51.05%	116,517.24	51.05%
非标准化债权类资产	-	0.00%	-	0.00%

权益类投资	-	0.00%	-	0.00%
境外投资资产	-	0.00%	-	0.00%
商品类资产	-	0.00%	-	0.00%
另类资产	-	0.00%	-	0.00%
公募基金	-	0.00%	-	0.00%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	-	0.00%	-	0.00%
合计	228,248.47	100%	228,248.47	100%

四、产品持仓前十项资产

序号	资产名称	持仓（万元）	持仓比例
1	TRADE_4748793：7日质押式逆回购	30,000.00	13.14%
2	TRADE_4748792：7日质押式逆回购	20,000.00	8.76%
3	TRADE_4748794：7日质押式逆回购	14,000.00	6.13%
4	101901748：19 海淀国资 MTN003	10,057.13	4.41%
5	166912：20 威产 01	9,873.44	4.33%
6	112210051：22 兴业银行 CD051	9,785.23	4.29%
7	101901729：19 葛洲坝 MTN001	7,062.23	3.09%
8	031900904：19 华电租赁 PPN001	7,033.54	3.08%
9	163098：20 津保 01	6,840.14	3.00%
10	101800326：18 川铁投 MTN002	5,161.37	2.26%

注：本表列示穿透后投资规模占比较高的前十项资产

五、投资账户信息

户名	中银理财有限责任公司（债市通2号）
账号	758873891715
开户行	中国银行深圳市分行营业部

六、产品组合流动性风险分析

报告期内，产品管理人通过合理安排资产配置结构，保持一定比例的高流动性资产，控制资产久期、杠杆融资比例，管控产品流动性风险。

七、本运作期主要操作回顾

（一） 主要投资策略及操作

2022 年 1 季度，受地产下行及疫情反复影响，国内经济增长预期承压。市场方面，利率先下后上，权益震荡下行，市场表现总体较弱。操作方面，降低投资组合的杠杆和久期，投资安全边际可控且有相对票息优势的债券，追求长期稳健收益。

（二） 非标资产投资情况

无。

（三） 关联交易情况

本产品于 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日期间投资于关联方发行的证券

关联方名称	证券代码	证券简称	报告期内买入证券	
			数量（单位：张）	总金额（单位：元）
-	-	-	-	-

本产品于 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日期间投资于关联方承销的证券

关联方名称	证券代码	证券简称	报告期内买入证券	
			数量（单位：张）	总金额（单位：元）
-	-	-	-	-

本产品于 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日期间的其他关联交易

交易类型	关联方名称	总金额（单位：元）
关联方报酬-销售服务费	中国银行股份有限公司	1,827,809.35
关联方报酬-产品托管费	中国银行股份有限公司	228,476.17

八、后市展望及下阶段投资策略

2022 年 2 季度，国内疫情控制后，在稳增长政策带动下，基建企稳、地产修复，经济将恢复增长动能。后续，将视机会调整投资组合的久期和杠杆，债券以票息策略为主，交易策略为辅，尽力提升组合收益。