

# 中银理财-债市通

## 2021 年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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

### 一、理财产品基本情况

理财产品代码	A类份额：830100 B类份额：830100B
理财产品名称	中银理财-债市通
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001020000259
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	2010-05-26
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	A类份额：1,291,780,915.16 B类份额：1,079,015.68
理财产品份额净值	A类份额：1.048386 B类份额：1.048440
理财产品累计净值	A类份额：1.652386 B类份额：1.652440
理财产品资产净值	A类份额：1,354,286,276.01 B类份额：1,131,283.87
较上一报告期份额净值增长率	A类份额：2.45% B类份额：2.46%

### 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	682.48	0.51%	682.48	0.51%
同业存单	24,584.44	18.41%	24,584.44	18.41%
拆放同业及买入返售	-	0.00%	-	0.00%
债券	108,300.97	81.08%	108,300.97	81.08%
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	133,567.89	100%	133,567.89	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	166912: 20 威产 01	9,836.14	7.36%
2	032000221: 20 淮南矿 PPN001	7,068.26	5.29%
3	101901357: 19 云能投 MTN003	6,953.73	5.21%
4	210312: 21 进出 12	5,038.38	3.77%
5	032000104: 20 建安投资 PPN001	5,037.61	3.77%
6	170409: 17 农发 09	5,026.04	3.76%
7	102102196: 21 宁河西 MTN004A	5,024.23	3.76%
8	101773002: 17 蓉经开 MTN001	5,016.95	3.76%
9	102101764: 21 临沂城投 MTN002(革命老区)	5,015.14	3.75%
10	101900077: 19 巨化 MTN001	5,002.88	3.75%

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）
账号	435180171836
开户行	中国银行上海市中银大厦支行营业部

## 六、产品组合流动性风险分析

截至 2021 年 12 月 31 日，“中银债市通”产品规模 13.56 亿元，产品资产久期 1 年左右。全年债市通规模稳定，资金缺口较小，流动性风险可控。

## 七、本运作期主要操作回顾

### （一）主要投资策略及操作

2021 年，因对债券市场整体看好，产品配置了大量的收益率尚可的 AA+及以上评级债券，以公开发行债券为主，资产流动性较好，充分享受了债券市场上涨带来的收益回报，同时保证了流动性管理的需求。

### （二）非标资产投资情况

无。

### （三）关联交易情况

本产品于 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 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	6,079,775.10
关联方报酬-产品托管费	中国银行股份有限公司	789,579.47

## 八、后市展望及下阶段投资策略

2022 年上半年，预期财政、货币政策均维持宽松，对于市场流动性判断较为乐观，各类资产仍有水涨船高行情可期，其中的优质标的可长期持有。预计全年债市先牛后熊，需注意安全边际，组合保持一定的防御性。可转债有波段机会，信用债投资可以挖掘龙头民企和房地产债的配置价值，整体以票息策略和交易策略为主。