

中银理财-债市通 2 号
2022 年三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 7 月 1 日至 2022 年 9 月 30 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	1,972,716,610.73
理财产品份额净值	1.039726
理财产品累计净值	1.159726
理财产品资产净值	2,051,084,979.67
较上一报告月份净值增长率	0.62%

三、理财产品持仓情况

资产类别	穿透前金额 (万元人民 币)	占全部产品总资 产的比例	穿透后金额 (万元人民 币)	占全部产品总资 产的比例
现金及银行存款	818.96	0.38%	818.96	0.38%
同业存单	49,705.39	23.13%	49,705.39	23.13%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	-	0.00%

债券	164,381.7 1	76.49%	164,381.7 1	76.49%
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	214,906.0 5	100%	214,906.0 5	100%

四、产品持仓前十项资产

序号	资产名称	持仓（万元人民币）	持仓比例
1	101901748: 19 海淀国资 MTN003	10,046.36	4.67%
2	166912: 20 威产 01	9,984.17	4.65%
3	112210051: 22 兴业银行 CD051	9,932.07	4.62%
4	112209032: 22 浦发银行 CD032	9,925.25	4.62%
5	101901729: 19 葛洲坝 MTN001	7,032.32	3.27%
6	031900904: 19 华电租赁 PPN001	7,025.68	3.27%
7	163098: 20 津保 01	7,008.63	3.26%
8	180411: 18 农发 11	5,234.28	2.44%
9	200315: 20 进出 15	5,153.24	2.40%
10	101800326: 18 川铁投 MTN002	5,098.18	2.37%

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 年三季度，央行超预期降息，资金面维持在合理充裕略偏宽松的状态，整体对债市有利，债券收益率呈震荡下行趋势。本产品根据债券市场走势灵活调整组合久期，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 7 月 1 日至 2022 年 9 月 30 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 7 月 1 日至 2022 年 9 月 30 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 7 月 1 日至 2022 年 9 月 30 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）
销售服务费	中国银行股份有限公司	1,006,197.05
产品托管费	中国银行股份有限公司	280,912.41

八、后市展望及下阶段投资策略

受疫情多点爆发、地产行业疲弱等因素影响，2022 年三季度经济基本面偏弱，预计后续经济复苏进展依赖于政策发力及疫情管控效果，存在一定的不确定性，而货币政策环境预计将保持宽松。在此宏观背景及市场条件下，本产品将严控组合久期，灵活调整票息类资产和交易性资产比例，力争稳健收益。