

中银理财-专精特新启航打新策略混合类（封闭式）2022
年 06 期
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	ZJTXQH2022006
理财产品名称	中银理财-专精特新启航打新策略混合类 (封闭式) 2022年06期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000101
产品类型	混合类产品
募集方式	公募
产品运作模式	封闭式净值型产品
风险级别	03 三级(中)
理财产品成立日	2022-03-17
理财产品到期日	2025-04-17

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	85,281,238.00
理财产品份额净值	1.009004
理财产品累计净值	1.009004
理财产品资产净值	86,049,189.40
较上一报告期份额净值增长率	-0.32%

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	108.71	1.26%	583.51	5.44%
同业存单	-	0.00%	284.56	2.65%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	312.57	2.91%

债券	-	0.00%	8,027.80	74.82%
非标准化债权类资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	896.90	8.36%
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%	623.79	5.81%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	8,503.72	98.74%	-	0.00%
合计	8,612.43	100%	10,729.13	100%

注：报告期末本理财产品持仓金融衍生品 27.59 万元。

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	CNY：现金及银行存款	583.51	5.44%
2	ZFXQJJ202003272022092601 ：14 日质押式逆回购	152.04	1.42%
3	ZFZSJJ2021042820220929213 00599：1 日质押式逆回购	100.19	0.93%
4	511360：中证短融 ETF	94.88	0.88%
5	110059：浦发转债	86.06	0.80%
6	220208：22 国开 08	80.96	0.75%
7	102101212：21 电网 MTN006(可持续挂钩)	71.48	0.67%
8	1928021：19 农业银行永续债 01	63.42	0.59%
9	112282806：22 上海农商银行 CD059	63.21	0.59%
10	006797：嘉实中短债债券 A	62.23	0.58%

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（专精特新启航打新混合封闭式206）
账号	341572157118
开户行	中国银行北京中银大厦支行营业部

六、产品组合流动性风险分析

本产品为封闭式产品，报告期内，产品管理人合理安排资产配置结构，控制资产久期，严格按照产品说明书约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本报告期内，本产品未发生重大流动性风险事件。

七、本运作期主要操作回顾

（一） 主要投资策略及操作

（1） 固收部分：

运作期内，固收部分延续高等级、中短久期票息策略，将其作为组合重要基础收益来源。操作上，主要持有评级 AAA 的央企、国企信用债和部分债券型基金，动态管理组合久期。

（2） 权益部分：

运作期内，通过灵活的敞口处理，积极把握市场机会，一方面，根据市场情况，围绕风险预算和收益目标，动态管理权益资产投资比例；另一方面，持续优化权益资产结构，积极跟踪市场热点机会。

（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	98,174.71
产品托管费	中国银行股份有限公司	4,363.32

八、后市展望及下阶段投资策略

随着疫情的好转以及稳增长措施的出台，政府投资和消费者需求逐渐改善，经济进入复苏期，投资者信心逐渐好转，同时市场整体估值仍处于较低位置，都将对权益市场产生支撑。但海外经济从滞涨进入衰退，外需拉动放缓，美联储持续加息也会抑制国内货币政策宽松的节奏，近期汇率快速贬值带来恐慌，后续市场仍存不确定性。下阶段将根据经济、政策、估值等多方面因素的变化灵活摆布资产配置和策略组合。

资产配置方面，将合理控制权益比例，通过多重手段动态管理权益敞口暴露，持续优化底层持仓结构，同时做精做实固收类资产收益，积极把握市场趋势和结构性机会。