

中银理财-专精特新启航 FOF 策略（年年开）2021 年 01 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	ZJTXQHNNK202101
理财产品名称	中银理财-专精特新启航 FOF 策略（年年开）2021 年 01 期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001021000583
产品类型	混合类产品
募集方式	公募
产品运作模式	开放式净值型产品
风险级别	03 三级(中)
理财产品成立日	2021-10-28
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	423,135,156.00
理财产品份额净值	0.998817
理财产品累计净值	0.998817
理财产品资产净值	422,634,683.23
较上一报告期份额净值增长率	-0.95%

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	51.00	0.12%	794.29	1.85%
同业存单	-	0.00%	166.43	0.39%
拆放同业及买入返售	-	0.00%	646.43	1.50%

债券	-	0.00%	4,066.65	9.47%
非标准化债权类 资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	2,693.30	6.27%
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	20,140.29	47.61%	34,587.59	80.52%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	22,109.43	52.27%	-	0.00%
合计	42,300.72	100%	42,954.68	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	006874：创金合信恒兴 A	4,142.40	9.64%
2	005159：华泰保兴尊合 A	4,125.19	9.60%
3	006646：汇添富短债 A	4,057.99	9.45%
4	002650：东方红稳添利	4,040.84	9.41%
5	003327：万家鑫璟 A	2,110.63	4.91%
6	000084：博时安盈 A	1,663.24	3.87%
7	001338：安信稳健 C	966.19	2.25%
8	003328：万家鑫璟纯债 C	902.03	2.10%
9	CNY：现金及银行存款	794.29	1.85%
10	007171：易方达中债 3-5 年国开 行债券 A	409.77	0.95%

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 FOF 年年开 2101）
账号	455982166861
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

本产品为开放式产品，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	484,314.78
产品托管费	中国银行股份有限公司	21,525.10

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。