

中银理财-债市通

2022 年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：2022 年 1 月 1 日至 2022 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：1,255,188,447.65 B类份额：4,089,593.32 |
| 理财产品份额净值 | A类份额：1.042286 B类份额：1.042718 |
| 理财产品份额累计净值 | A类份额：1.676286 B类份额：1.072718 |
| 理财产品资产净值 | A类份额：1,308,266,075.06 B类份额：4,264,296.14 |
| 较上一报告期份额净值增长率 | A类份额：1.45% B类份额：2.32% |
| 报告期末杠杆水平 | 102.62% |

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 | 1,330.37 | 1.00% | 1,330.37 | 1.00% |

| | | | | |
|---------------|------------|--------|------------|--------|
| 同业存单 | 49,527.45 | 37.25% | 49,527.45 | 37.25% |
| 拆放同业及买入 返售 | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 债券 | 82,093.38 | 61.75% | 82,093.38 | 61.75% |
| 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 | 132,951.19 | 100% | 132,951.19 | 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 | 102281094: 22 汇金 MTN002 | 9,968.55 | 7.50% |
| 2 | 112206077: 22 交通银行 CD077 | 9,965.14 | 7.50% |
| 3 | 112203040: 22 农业银行 CD040 | 9,919.45 | 7.46% |
| 4 | 112203048: 22 农业银行 CD048 | 9,913.05 | 7.46% |
| 5 | 112209151: 22 浦发银行 CD151 | 9,828.72 | 7.39% |
| 6 | 032000221: 20 淮南矿 PPN001 | 7,009.58 | 5.27% |
| 7 | 200315: 20 进出 15 | 5,116.08 | 3.85% |
| 8 | 2228019: 22 兴业银行 01 | 5,017.89 | 3.77% |
| 9 | 200303: 20 进出 03 | 5,002.52 | 3.76% |

| | | | |
|----|--------------------|----------|-------|
| 10 | 2028018: 20 交通银行二级 | 4,996.08 | 3.76% |
|----|--------------------|----------|-------|

注：本表列示穿透后投资规模占比较高的前十名资产

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

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，债券市场利率宽幅震荡，全年货币资金合理充裕，债券收益率在10月底前震荡下行；11月以来，随着经济预期向好，债券收益率快速上行；全年债券利率小幅上行。操作方面，本产品适时调整组合的杠杆和久期，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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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） |
| 中国银行股份有限公司 | 102280732 | 22 南昌城投 MTN001 | 100,000 | 10,002,654.79 |

本产品于 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日期间投资于关联方发行的资产管理产品

| 关联方名称 | 资产管理产品代码 | 资产管理产品简称 | 报告期内买入资产管理产品 | |
|-------|----------|----------|--------------|-----------|
| | | | 数量（单位：份） | 总金额（单位：元） |
| - | - | - | - | - |

本产品于 2022 年 1 月 1 日至 2022 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） |
|-------|------------|--------------|
| 销售服务费 | 中国银行股份有限公司 | 3,521,715.97 |
| 产品托管费 | 中国银行股份有限公司 | 929,951.14 |

八、后市展望及下阶段投资策略

受经济预期向好影响，2023 年国内经济将迎来复苏阶段，债券收益率中长期面临较大压力。后续，产品管理人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。

中银理财-债市通 2022 年年度托管人报告

中银理财有限责任公司：

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对中银理财-债市通（以下称“本理财产品”）的托管过程中，严格遵守《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《商业银行理财业务监督管理办法》和托管合同等文本的规定，认真履行了应尽的义务，不存在损害理财产品份额持有人利益的行为。

1、根据《商业银行理财业务监督管理办法》，本托管人对报告期内本理财产品的年度投资运作情况报告进行了复核，复核意见如下：经复核，净值数据核对无误。

2、报告期内，本托管人依据理财相关法律法规规定及托管合同对本理财产品的投资运作进行必要监督，报告期内尽职履行理财产品发行人通知及监管报告义务。

中国银行股份有限公司

上海分行托管中心

