

中银理财-债市通 2 号  
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	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	1,164,973,114.36
理财产品份额净值	1.040417
理财产品份额累计净值	1.160417
理财产品资产净值	1,212,058,425.73
较上一报告月份净值增长率	2.19%
报告期末杠杆水平	100.29%

### 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	6,974.99	5.82%	6,974.99	5.82%
同业存单	29,934.69	24.96%	29,934.69	24.96%

拆放同业及买入 返售	10,000.00	8.34%	10,000.00	8.34%
债券	73,005.41	60.88%	73,005.41	60.88%
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	119,915.0 9	100%	119,915.0 9	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	TRADE_5575303: 7 日质押式逆 回购	10,000.00	8.34%
2	112210051: 22 兴业银行 CD051	9,981.02	8.32%
3	112209032: 22 浦发银行 CD032	9,969.71	8.31%
4	163098: 20 津保 01	6,996.55	5.83%
5	CNY: 现金及银行存款	6,974.99	5.82%
6	200315: 20 进出 15	5,116.08	4.27%
7	200313: 20 进出 13	5,039.37	4.20%
8	092118003: 21 农发清发 03	5,013.22	4.18%
9	102000466: 20 山东国惠 MTN001	5,002.39	4.17%
10	032000065: 20 常德城投 PPN001	5,001.83	4.17%

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，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	012281453	22 华为 SCP002	500,000	50,010,068.49
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	5,059,607.37
产品托管费	中国银行股份有限公司	1,008,257.32

## 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。



深圳市分行托管业务部

中银理财-债市通 2 号  
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 2 号（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。

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 2022 年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。

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深圳市分行托管业务部

2023 年 02 月 23 日

