

中银理财-稳富固收增强（6个月滚续）  
2023年一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：2023年1月1日至2023年3月31日

### 一、理财产品基本情况

理财产品代码	WFZQ6M001A
理财产品名称	中银理财-稳富固收增强（6个月滚续）
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001020000336
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	2021-03-02
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	4,485,323,740.22
理财产品份额净值	1.068955
理财产品份额累计净值	1.068955
理财产品资产净值	4,794,611,143.15
较上一报告月份净值增长率	1.23%
报告期末杠杆水平	115.38%

### 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	19,824.72	4.15%	29,602.72	5.48%
同业存单	-	0.00%	-	0.00%

拆放同业及买入返售	-	0.00%	-	0.00%
债券	90,192.61	18.88%	498,404.30	92.19%
非标准化债权类资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	1,482.81	0.27%
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	3,077.79	0.64%	11,131.48	2.06%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	364,658.02	76.33%	-	0.00%
合计	477,753.13	100%	540,621.31	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	019674: 22 国债 09	40,000.68	7.40%
2	133052: 21 桂铁 02	30,277.02	5.60%
3	CNY: 现金及银行存款	29,602.72	5.48%
4	188044: 21 山招 Y1	14,177.80	2.62%
5	137613: 22 鲁能 01	13,680.80	2.53%
6	175865: 21 国丰 Y2	10,068.00	1.86%
7	185547: 22 云交 01	10,002.00	1.85%
8	185366: 22 远东三	9,919.00	1.83%
9	188271: 21 鄂交 Y1	9,075.60	1.68%
10	092100012: 21 长城资本债 01BC	8,126.30	1.50%

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（稳富固收增强 6 个月滚续）
账号	770574556209
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，控制资产久期和杠杆融资比例，管控流动性风险。产品融资渠道畅通多元，风险总体可控。

## 七、本运作期主要操作回顾

### （一）主要投资策略及操作

产品管理人保持合理的组合杠杆水平，持仓主要为高等级信用债，久期处于中等水平，并根据市场变化灵活调整持仓结构。

### （二）非标资产投资情况

无

### （三）关联交易情况

本产品于 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 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）
中银国际证 券股份有限 公司	601669	中国电建	15,996	122,349.64

本产品于 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 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）
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202109	中银证券-中 银理财 9 号单 一资产管理计 划	563,313,479.00	600,000,000.00

本产品于 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 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	8,878,736.26
现券卖出	中银国际证券股份有限公司	31,151,376.17
产品托管费	中国银行股份有限公司	591,915.75
7 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	67,009,600.00
21 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	309,879,000.00

## 八、后市展望及下阶段投资策略

基本面弱复苏背景下，短期内货币政策仍维持相对宽松。产品管理人将继续采取稳健的投资策略，继续配置高等级信用债、金融债等，谨慎增加权益资产，配合适当久期，优化资产配置。