

中银理财-债券指数 1 号（中短期高等级信用债）
2023 年半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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

一、理财产品基本情况

理财产品代码	AMZYCLZS01
理财产品名称	中银理财-债券指数1号（中短期高等级信用债）
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001020000261
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
产品币种	人民币
风险级别	02 二级(中低)
理财产品成立日	2018-12-21
理财产品到期日	无固定期限

二、存续规模、收益表现及杠杆水平

(一) 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 份额代码	理财产品 总份额	理财产品 份额净值	理财产品 份额累计净值	理财产品 资产净值	较上一报告期 份额净值 增长率
AMZYCLZS01	1,630,840,725.66	1.141752	1.141752	1,862,015,762.09	1.66%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：109.44%

三、理财产品持仓情况

资产类别	穿透前金额 (万元)	占全部产品总资 产的比例	穿透后金额 (万元)	占全部产品总资 产的比例
现金及银行存款	9,667.74	4.82%	9,667.74	4.82%

同业存单	-	0.00%	-	0.00%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	-	0.00%
债券	190,968.8 7	95.18%	190,968.8 7	95.18%
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	200,636.6 1	100%	200,636.6 1	100%

四、产品持仓前十项资产

序号	资产名称	持仓（万元）	持仓比例
1	102102025: 21 深圳地铁 MTN005	10,094.03	5.03%
2	102281691: 22 中电投 MTN023	9,983.63	4.98%
3	CNY: 现金及银行存款	9,667.74	4.82%
4	102101385: 21 南电 MTN003	9,050.96	4.51%
5	102101480: 21 中石化 MTN002	9,050.88	4.51%
6	102101574: 21 华能 MTN001(可持续挂钩)	8,042.96	4.01%
7	102281326: 22 华电股 MTN003	8,017.68	4.00%
8	101901386: 19 中石油 MTN005	7,096.58	3.54%
9	102102309: 21 中电投 MTN011	7,051.15	3.51%

10	102280874: 22 中电投 MTN009	7,017.89	3.50%
----	--------------------------	----------	-------

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（债券指数 1 号）
账号	455980170528
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

组合持仓全部为现金以及 1-3 年高等级的信用债，日常运作中保留 5%以上的现金以应对投资者的赎回，债券部分资质较高，市场流动性较好。

七、本运作期主要操作回顾

（一） 主要投资策略及操作

主要产品以跟踪 CFETS-BOC 1-3 年期高等级信用债指数为目的，通过配置相似资质的债券维持组合久期和到期收益率与指数的相似性。

（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 6 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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）
中国银行股份有限公司	102101480	21 中石化 MTN002	100,000	10,310,884.38
中国银行股份有限公司	102102121	21 华电股 MTN005	200,000	20,619,384.38

本产品于 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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	2,036,871.23
产品托管费	中国银行股份有限公司	564,801.38

八、后市展望及下阶段投资策略

目前债券收益率下行的幅度有限，预计仍以票息收益为主，投资经理将继续提高管理精细度，力争降低产品的跟踪误差。

中银理财-债券指数 1 号（中短期高等级信用债）

2023 年半年度托管人报告

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-债券指数 1 号（中短期高等级信用债）”（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半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
二〇二三年八月

