

中银理财-债市通 2 号  
2023 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：2023 年 7 月 1 日至 2023 年 9 月 30 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
产品币种	人民币
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、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
830101	3,706,198,102.60	1.060075	1.180075	3,928,851,113.36	0.35%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：102.97%

### 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	3,084.98	0.77%	4,498.60	1.13%
同业存单	49,623.94	12.46%	49,623.94	12.45%

拆放同业及买入返售	13,000.00	3.26%	13,000.00	3.26%
债券	168,515.46	42.30%	331,473.22	83.16%
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	164,198.90	41.21%	-	0.00%
合计	398,423.28	100%	398,595.75	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	TRADE_6469789: 7日质押式逆回购	13,000.00	3.26%
2	190208: 19国开08	10,088.95	2.53%
3	102381267: 23中电投MTN018A	10,000.04	2.51%
4	102300372: 23华能MTN011	9,999.28	2.51%
5	230206: 23国开06	9,992.70	2.51%
6	102381219: 23中电投MTN017	9,986.32	2.51%
7	132380061: 23三峡GN002	9,942.22	2.49%
8	112306041: 23交通银行CD041	9,920.57	2.49%
9	102103276: 21建发MTN002	9,712.12	2.44%
10	185190: 21诚通23	9,665.07	2.42%

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

2023年三季度，我国经济基本面持续改善，化债、地产和资本市场政策持续发力，机构行为扰动增多。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2023年7月1日至2023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2023年7月1日至2023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）
中国银行股份有限公司	102300441	23 华能 MTN013	300,000	30,002,254.10
中国银行股份有限公司	132380061	23 三峡 GN002	1,000,000	100,023,606.56
中银国际证券股份有限公司	133671	23 珠高 01	347,150	34,634,126.42

本产品于 2023 年 7 月 1 日至 2023 年 9 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）
中银国际证券股份有限公司	ZYLCZYQ202115	中银证券中国红-汇中 15 号集合资产管理计划	113,004,991	120,000,000.00
中银国际证券股份有限公司	ZYLCZYQ202115	中银证券中国红-汇中 15 号集合资产管理计划	141,322,781	150,000,000.00
中银国际证券股份有限公司	ZYLCZYQ202115	中银证券中国红-汇中 15 号集合资产管理计划	141,389,386	150,000,000.00
中银国际证券股份有限公司	ZYLCZYQ202115	中银证券中国红-汇中 15 号集合资产管理计划	141,536,139	150,000,000.00
中银国际证券股份有限公司	ZYLCZYQ202115	中银证券中国红-汇中 15 号集合资产管理计划	187,969,925	200,000,000.00
中银国际证券股份有限公司	ZYLCZYQ202115	中银证券中国红-汇中 15 号集合资产管理计划	56,529,112	60,000,000.00
中银国际证券股份有限公司	ZYLCZYQ202115	中银证券中国红-汇中 15 号集合资产管理计划	94,099,934	100,000,000.00

本产品于 2023 年 7 月 1 日至 2023 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	4,338,458.15
产品托管费	中国银行股份有限公司	542,307.27
现券买入	中国银行股份有限公司	130,025,860.66

## 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，尽力提升组合业绩。