

中银理财-专精特新启航打新策略混合类（封闭式）2022
年 22 期
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 | ZJTXQH2022022 |
| 理财产品名称 | 中银理财-专精特新启航打新策略混合类 (封闭式) 2022 年 22 期 |
| 全国银行业理财信息登记系统登记编码 | Z7001022000471 |
| 产品类型 | 混合类产品 |
| 募集方式 | 公募 |
| 产品运作模式 | 封闭式净值型产品 |
| 产品币种 | 人民币 |
| 风险级别 | 03 三级(中) |
| 理财产品成立日 | 2022-10-25 |
| 理财产品到期日 | 2025-12-03 |

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 |
|---------------|---------------|--------------|----------------|---------------|-----------------------|
| ZJTXQH2022022 | 13,227,840.00 | 1.024828 | 1.024828 | 13,556,268.73 | 0.67% |

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：113.79%

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 | 27.45 | 2.02% | 52.14 | 3.41% |

| | | | | |
|---------------|----------|--------|----------|--------|
| 同业存单 | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 拆放同业及买入 返售 | - | 0.00% | 5.40 | 0.35% |
| 债券 | - | 0.00% | 1,369.69 | 89.51% |
| 非标准化债权类 资产 | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 权益类投资 | - | 0.00% | 70.86 | 4.63% |
| 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% | 32.03 | 2.09% |
| 私募基金 | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 资产管理产品 | 1,329.30 | 97.98% | - | 0.00% |
| 合计 | 1,356.75 | 100% | 1,530.13 | 100% |

注：报告期末本理财产品持仓金融衍生品 0.08 万元。

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 | CNY：现金及银行存款 | 52.14 | 3.41% |
| 2 | 185686：22 鄂交 Y3 | 23.78 | 1.55% |
| 3 | 102281495：22 中交二航 MTN001 | 23.73 | 1.55% |
| 4 | 2128016：21 民生银行永续债 01 | 23.46 | 1.53% |
| 5 | 2021044：20 无锡农商永续债 | 21.47 | 1.40% |
| 6 | 133602：23 岳建 03 | 20.78 | 1.36% |
| 7 | 242380021：23 建行永续债 02 | 16.56 | 1.08% |
| 8 | 152618：20 蓉高 G1 | 16.08 | 1.05% |
| 9 | 185990：22 城建 02 | 16.01 | 1.05% |
| 10 | 042380232：23 开滦 CP001 | 16.01 | 1.05% |

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（专精特新启航打新混合封闭式 2 2 2） |
| 账号 | 324672822001 |
| 开户行 | 中国银行北京中银大厦支行营业部 |

六、产品组合流动性风险分析

本产品为封闭式产品，报告期内，产品管理人合理安排资产配置结构，控制资产久期，严格按照产品说明书约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本报告期内，本产品未发生重大流动性风险事件。

七、本运作期主要操作回顾

（一） 主要投资策略及操作

主要投资策略及操作

（1） 固收部分：

运作期内，合理控制久期风险，严格控制信用风险，延续高等级、中短久期票息策略，将其作为组合重要基础收益来源。操作上，主要持有高等级信用债和部分债券型基金，动态控制组合久期。

（2） 权益部分：

运作期内，在控制权益敞口的基础上，积极把握市场的结构性机会，一方面，根据市场情况，围绕收益目标和波动控制，动态管理权益资产配置比例；另一方面，持续优化权益资产结构，挖掘市场主线，积极把握市场热点机会。

（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 | 032380472 | 23 常德城投 PPN007 | 240 | 24,710.95 |
| 中国银行股份有限公司 | 032380472 | 23 常德城投 PPN007 | 240 | 24,705.53 |
| 中国银行股份有限公司 | 101901234 | 19 华电 MTN002B | 1,150 | 121,206.40 |
| 中国银行股份有限公司 | 102101189 | 21 豫水利 MTN001(乡村振兴) | 1,150 | 116,313.66 |
| 中国银行股份有限公司 | 102280427 | 22 江宁经开 MTN001 | 400 | 40,793.49 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382436 | 23 大唐集 MTN014 | 240 | 24,002.18 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382520 | 23 河钢集 MTN013 | 720 | 72,007.95 |
| 中国银行股份有限公司 | 2028037 | 20 光大银行永续债 | 2,160 | 232,561.73 |
| 中国银行股份有限公司 | 2028037 | 20 光大银行永续债 | 210 | 22,552.38 |
| 中国银行股份有限公司 | 2028037 | 20 光大银行永续债 | 240 | 25,830.31 |
| 中国银行股份有限公司 | 2028040 | 20 交通银行永续债 | 1,050 | 112,949.59 |
| 中国银行股份有限公司 | 2121026 | 21 杭州联合农商永续债 01 | 1,150 | 118,479.17 |
| 中国银行股份有限公司 | 2128022 | 21 交通银行永续债 | 1,200 | 124,497.47 |
| 中国银行股份有限公司 | 600751 | 海航科技 | 134 | 339.45 |

| | | | | |
|--------------------------|---------|---------------|-------|------------|
| 中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司 | 2028017 | 20 农业银行永续债 01 | 1,050 | 107,420.84 |
| 中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司 | 2028017 | 20 农业银行永续债 01 | 1,050 | 107,191.86 |
| 中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司 | 2028017 | 20 农业银行永续债 01 | 2,730 | 279,492.64 |
| 中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司 | 2028017 | 20 农业银行永续债 01 | 630 | 64,278.59 |
| 中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司 | 2028017 | 20 农业银行永续债 01 | 840 | 85,671.83 |
| 中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司 | 2028032 | 20 农业银行永续债 02 | 1,050 | 113,262.76 |
| 中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司 | 2028032 | 20 农业银行永续债 02 | 630 | 67,782.94 |
| 中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司 | 2128021 | 21 工商银行永续债 01 | 240 | 24,890.55 |

| | | | | |
|--------------------------|-----------|---------------|-------|------------|
| 中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司 | 2328021 | 23 兴业银行小微债 01 | 990 | 99,006.89 |
| 中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司 | 242380017 | 23 农行永续债 01 | 2,100 | 210,036.84 |
| 中银国际证券股份有限公司 | 003816 | 中国广核 | 28 | 87.29 |
| 中银国际证券股份有限公司 | 110053 | 苏银转债 | 10 | 1,244.81 |
| 中银国际证券股份有限公司 | 110053 | 苏银转债 | 13 | 1,721.53 |
| 中银国际证券股份有限公司 | 110053 | 苏银转债 | 18 | 2,306.09 |
| 中银国际证券股份有限公司 | 110053 | 苏银转债 | 4 | 575.07 |
| 中银国际证券股份有限公司 | 113052 | 兴业转债 | 11 | 1,125.74 |
| 中银国际证券股份有限公司 | 113052 | 兴业转债 | 16 | 1,593.12 |
| 中银国际证券股份有限公司 | 113052 | 兴业转债 | 18 | 1,816.59 |
| 中银国际证券股份有限公司 | 113052 | 兴业转债 | 18 | 1,808.01 |
| 中银国际证券股份有限公司 | 113052 | 兴业转债 | 27 | 2,711.29 |
| 中银国际证券股份有限公司 | 113052 | 兴业转债 | 9 | 918.34 |

| | | | | |
|----------------------|---------|-------------------|-------|-----------|
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 113055 | 成银转债 | 10 | 1,193.92 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 113055 | 成银转债 | 13 | 1,619.03 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 113055 | 成银转债 | 13 | 1,614.50 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 113055 | 成银转债 | 14 | 1,778.03 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 113055 | 成银转债 | 18 | 2,124.12 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 113055 | 成银转债 | 22 | 2,753.43 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2028023 | 20 招商银行永 续债 01 | 420 | 42,950.28 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 300232 | 洲明科技 | 21 | 177.77 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 300232 | 洲明科技 | 37 | 311.61 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600919 | 江苏银行 | 1,042 | 7,364.89 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600919 | 江苏银行 | 1,523 | 11,024.02 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600919 | 江苏银行 | 101 | 727.29 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600919 | 江苏银行 | 116 | 816.59 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600919 | 江苏银行 | 121 | 858.97 |

| | | | | |
|----------------------|--------|------|-----|----------|
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600919 | 江苏银行 | 20 | 138.43 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600919 | 江苏银行 | 252 | 1,764.03 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600919 | 江苏银行 | 257 | 1,864.15 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600919 | 江苏银行 | 294 | 2,094.99 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600919 | 江苏银行 | 467 | 3,378.93 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600919 | 江苏银行 | 60 | 427.55 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600919 | 江苏银行 | 88 | 640.86 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600941 | 中国移动 | 14 | 1,327.34 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600941 | 中国移动 | 40 | 3,961.94 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600962 | 国投中鲁 | 109 | 1,248.02 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600962 | 国投中鲁 | 130 | 1,465.09 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600962 | 国投中鲁 | 178 | 2,083.59 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600962 | 国投中鲁 | 220 | 2,567.83 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600962 | 国投中鲁 | 94 | 1,065.42 |

| | | | | |
|----------------------|--------|------|-----|-----------|
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601088 | 中国神华 | 134 | 3,711.35 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601088 | 中国神华 | 152 | 4,363.72 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601088 | 中国神华 | 276 | 8,286.40 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601088 | 中国神华 | 363 | 10,641.42 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601088 | 中国神华 | 42 | 1,196.48 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601088 | 中国神华 | 444 | 12,612.05 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601088 | 中国神华 | 55 | 1,543.30 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601088 | 中国神华 | 71 | 2,008.22 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601088 | 中国神华 | 78 | 2,287.17 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601166 | 兴业银行 | 163 | 2,616.54 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601166 | 兴业银行 | 204 | 3,322.98 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601166 | 兴业银行 | 425 | 6,904.05 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601225 | 陕西煤业 | 305 | 5,581.21 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601225 | 陕西煤业 | 364 | 5,911.72 |

| | | | | |
|----------------------|--------|------|-------|-----------|
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601225 | 陕西煤业 | 4 | 84.40 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601225 | 陕西煤业 | 6 | 117.19 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601668 | 中国建筑 | 1,776 | 10,843.56 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601668 | 中国建筑 | 130 | 734.69 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601668 | 中国建筑 | 220 | 1,245.26 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601668 | 中国建筑 | 246 | 1,449.77 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601668 | 中国建筑 | 269 | 1,563.28 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601668 | 中国建筑 | 303 | 1,862.08 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601668 | 中国建筑 | 744 | 4,567.21 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601669 | 中国电建 | 116 | 594.14 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601669 | 中国电建 | 125 | 744.16 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601669 | 中国电建 | 19 | 110.36 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601669 | 中国电建 | 22 | 127.38 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 601669 | 中国电建 | 61 | 317.64 |

| | | | | |
|--------------------------|--------|----------|-----|----------|
| 中银国际证 券股份有 限公 司 | 601728 | 中国电 信 | 16 | 91.10 |
| 中银国际证 券股份有 限公 司 | 601728 | 中国电 信 | 44 | 263.64 |
| 中银国际证 券股份有 限公 司 | 601728 | 中国电 信 | 742 | 4,417.52 |
| 中银国际证 券股份有 限公 司 | 601728 | 中国电 信 | 858 | 5,095.60 |
| 中银国际证 券股份有 限公 司 | 603993 | 洛阳钼 业 | 20 | 116.11 |

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） |
| - | - | - | - | - |

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 | 15,347.83 |
| 产品托管费 | 中国银行股份有限公司 | 682.13 |
| 现券买入 | 中国银行股份有限公司 | 48,006.31 |

八、后市展望及下阶段投资策略

宏观政策坚持稳中求进总基调，加强逆周期调节，积极扩大内需，大力支持科技创新，房地产政策适时调整优化，经济运行有望好转。活跃资本市场、提振投资者信心的政策方向明确，资本市场面临新的发展机遇。随着经济企稳、市场信心改善，股票市场存在向好的基础和空间。货币环境宽松有利于债券市场的稳健表现，但受经济复苏力度的影响存在不确定性。下阶段重点关注政策方向以及经济复苏的情况。

资产配置方面，将继续围绕收益目标和波动控制，动态管理权益资产配置比例，沿着

国家政策引导的方向适度加大权益投资力度，重点布局扩大内需和现代化产业体系建设相关领域，深入研究行业动向，抓住阶段性投资机会。通过参与新股申购、量化策略等，力争多渠道增厚产品组合收益。同时，持续优化固收类资产配置，控制组合久期，力争获得稳健收益。