

中银理财-专精特新启航打新策略混合类（封闭式）2023
年 04 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	ZJTXQH2023004
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) 2023 年 04 期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001023000152
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	2023-04-07
理财产品到期日	2026-05-08

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
ZJTXQH2023004	120,623,584.00	1.013523	1.013523	122,254,833.51	0.43%

(二) 截至报告期末, 理财产品杠杆水平: 112.46%

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	126.64	1.04%	341.61	2.52%

同业存单	-	0.00%	-	0.00%
拆放同业及买入返售	-	0.00%	1,216.04	8.96%
债券	-	0.00%	11,342.49	83.56%
非标准化债权类资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	547.68	4.03%
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%	125.98	0.93%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	12,109.05	98.96%	-	0.00%
合计	12,235.69	100%	13,573.81	100%

注：报告期末本理财产品持仓金融衍生品 1.12 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	0W812220230928R014101：14 日质押式逆回购	623.27	4.59%
2	082100802：21 光穗华电 ABN002 优先(碳中和债)	517.68	3.81%
3	2128016：21 民生银行永续债 01	425.14	3.13%
4	2328007：23 浦发银行绿色金融债 01	392.34	2.89%
5	0W812220230928R014102：14 日质押式逆回购	346.65	2.55%
6	CNY：现金及银行存款	341.61	2.52%
7	2028013：20 农业银行二级 01	295.08	2.17%
8	2328006：23 交通银行小微债 01	294.38	2.17%

9	212380003: 23 华夏银行债 01	261.62	1.93%
10	189323: 生物 R1 优	218.74	1.61%

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-专精特新启航打新混合类（封闭式）2023 年 04 期
账号	320773369324
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	012283965	22 韵达股份 SCP004	5,390	552,215.27
中国银行股份有限公司	012383098	23 金风科技 SCP001(科创票据)	2,695	269,550.59
中国银行股份有限公司	101901234	19 华电 MTN002B	6,650	700,889.19
中国银行股份有限公司	102101189	21 豫水利 MTN001(乡村振兴)	6,650	672,596.41
中国银行股份有限公司	102280427	22 江宁经开 MTN001	800	81,586.99
中国银行股份有限公司	102300441	23 华能 MTN013	10,780	1,078,081.00
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	1,230	132,092.50
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	6,150	661,561.86
中国银行股份有限公司	2121026	21 杭州联合农商永续债 01	6,650	685,118.65
中国银行股份有限公司	2228032	22 建设银行绿色金融债 01	6,360	640,249.23
中国银行股份有限公司	2228061	22 交通银行小微债 02	13,040	1,342,440.96
中国银行股份有限公司	2328006	23 交通银行小微债 01	12,720	1,288,994.97

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	15,990	1,637,028.29
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	3,690	376,488.91
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	4,920	501,792.16
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	6,150	629,179.19
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	6,150	627,838.02
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	3,690	397,014.36
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	6,150	663,396.19
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	1,980	198,013.78

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	12,300	1,230,215.75
中银国际亚洲有限公司	01024	快手-W	293	17,971.42
中银国际亚洲有限公司	01024	快手-W	293	17,971.42
中银国际亚洲有限公司	01024	快手-W	33	1,824.11
中银国际亚洲有限公司	02099	中国黄金国际	51	1,445.70
中银国际亚洲有限公司	02869	绿城服务	3,325	12,035.43
中银国际证券股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	2,460	251,565.92
中银国际证券股份有限公司	600030	中信证券	202	4,827.01
中银国际证券股份有限公司	600030	中信证券	407	9,740.02
中银国际证券股份有限公司	600900	长江电力	134	3,004.87
中银国际证券股份有限公司	600900	长江电力	147	3,221.79
中银国际证券股份有限公司	600900	长江电力	72	1,564.31
中银国际证券股份有限公司	600900	长江电力	747	16,290.75
中银国际证券股份有限公司	600919	江苏银行	175	1,281.72
中银国际证券股份有限公司	600919	江苏银行	2,084	14,729.77

中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	231	1,633.17
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	242	1,717.95
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	3,046	22,048.05
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	503	3,528.06
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	513	3,728.30
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	589	4,189.97
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	934	6,757.86
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	27	2,654.68
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	79	7,923.87
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	189	2,130.84
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	218	2,496.05
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	260	2,930.18
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	355	4,167.18
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	440	5,135.66

中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	110	3,086.60
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	141	4,016.44
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	156	4,574.35
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	268	7,422.70
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	304	8,727.44
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	553	16,572.81
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	725	21,282.84
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	84	2,392.96
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	888	25,224.10
中银国际证 券股份有限 公司	601098	中南传媒	1,151	13,016.15
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	325	5,233.08
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	409	6,645.95
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	850	13,808.10
中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	610	11,162.42

中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	727	11,823.44
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,488	9,134.41
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	260	1,469.37
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	3,552	21,687.11
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	441	2,490.52
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	492	2,899.55
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	538	3,126.55
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	607	3,724.16
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	1,484	8,835.03
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	1,717	10,191.21
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	88	527.27
中银国际证 券股份有限 公司	601991	大唐发电	525	1,742.14
中银国际证 券股份有限 公司	601995	中金公司	297	12,757.38
中银国际证 券股份有限 公司	601995	中金公司	88	3,503.99

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	138,659.93
产品托管费	中国银行股份有限公司	6,162.66

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。