

中银理财-债券指数 1 号（中短期高等级信用债）
2024 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 31 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	1,297,732,580.43	1.161704	1.161704	1,507,581,158.22	0.75%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：105.32%

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	8,465.36	5.41%	8,465.36	5.41%

同业存单	-	0.00%	-	0.00%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	-	0.00%
债券	147,879.43	94.59%	147,879.43	94.59%
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	156,344.79	100%	156,344.79	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	102382914: 23 汇金 MTN006A	11,102.41	7.10%
2	102381596: 23 中电投 MTN024	9,030.70	5.78%
3	102281691: 22 中电投 MTN023	9,026.10	5.77%
4	CNY: 现金及银行存款	8,465.36	5.41%
5	102280800: 22 光大集团 MTN001	7,043.70	4.51%
6	102381750: 23 中交建 MTN001	7,032.11	4.50%
7	102281736: 22 苏国信 MTN005	7,021.58	4.49%
8	102380981: 23 汇金 MTN002	6,057.42	3.87%
9	102381224: 23 汇金 MTN003	6,044.57	3.87%
10	102103096: 21 华能 MTN002(可持 续挂钩)	6,028.56	3.86%

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

报告期内，产品管理人不断调整持仓结构，保持持有资产的高流动性。

七、本运作期主要操作回顾

（一）主要投资策略及操作

本产品以跟踪 CFETS-BOC 1-3 年期高等级信用债为目标，在运作期内努力保持产品的久期和凸性与指数保持一致

（二）非标资产投资情况

无

（三）关联交易情况

本产品于 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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）

中国银行股份有限公司	102101970	21 华电股 MTN004	100,000	10,361,816.23
中国银行股份有限公司	102382914	23 汇金 MTN006A	300,000	30,438,413.28

本产品于 2024 年 1 月 1 日至 2024 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）
-	-	-	-	-

本产品于 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	1,298,766.07
产品托管费	中国银行股份有限公司	185,538.01

八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市，国内债券收益率已处于较低的历史分位数水平，在当前状态下线性外推，债券市场收益率继续大幅下行的空间有限，也存在小幅反弹的可能。后续在债券策略上可适当降低风险敞口，通过票息资产的挖掘和交易机会的把握努力提升产品业绩。