

中银理财-ESG 优享固收（封闭式）2023 年 09 期
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	ESGYXGS202309
理财产品名称	中银理财-ESG 优享固收（封闭式）2023年09期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001023000567
产品类型	固定收益类产品
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	02 二级(中低)
理财产品成立日	2023-11-08
理财产品到期日	2024-12-25

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
ESGYXGS202309	154,187,046.44	1.013294	1.013294	156,236,848.20	0.83%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：101.20%

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	19.21	0.12%	1,384.28	8.87%

同业存单	-	0.00%	-	0.00%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	-	0.00%
债券	-	0.00%	14,224.98	91.13%
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	15,611.64	99.88%	-	0.00%
合计	15,630.85	100%	15,609.26	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	CNY：现金及银行存款	1,384.28	8.87%
2	194091：22 港城 01	345.61	2.21%
3	166941：20 济轨 02	333.81	2.14%
4	194925：22 汇成 01	326.38	2.09%
5	177823：21 绍城 01	324.64	2.08%
6	194137：22 泰交 02	316.14	2.03%
7	196153：22 锡公 02	314.95	2.02%
8	112130：沪建 02 优	309.77	1.98%
9	178679：21 宜春 02	285.59	1.83%
10	196710：21 保控 02	254.77	1.63%

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-ESG 优享固收（封闭式）2023 年 09 期
账号	350648714715
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

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，努力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

报告期内，受益于较为宽松的货币环境，国内债券收益率快速下行，本产品积极把握市场机会，适度加大了信用债的一二级投资和利率债的波段交易。

（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）
中银国际证 券股份有限 公司	253444	24 嵯交 D1	3,192	319,228.54

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	58,180.90
产品托管费	中国银行股份有限公司	7,757.46

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。