

中银理财-专精特新启航打新策略混合类（封闭式）2022  
年 06 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            | ZJTXQH2022006                        |
| 理财产品名称            | 中银理财-专精特新启航打新策略混合类<br>(封闭式) 2022年06期 |
| 全国银行业理财信息登记系统登记编码 | Z7001022000101                       |
| 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           | 2022-03-17                           |
| 理财产品到期日           | 2025-04-17                           |

### 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<br>份额代码  | 理财产品<br>总份额   | 理财产品<br>份额净值 | 理财产品<br>份额累计净值 | 理财产品<br>资产净值  | 较上一报告期<br>份额净值<br>增长率 |
|---------------|---------------|--------------|----------------|---------------|-----------------------|
| ZJTXQH2022006 | 85,281,238.00 | 1.050794     | 1.050794       | 89,613,049.96 | 1.44%                 |

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：114.13%

### 三、理财产品持仓情况

| 资产类别    | 穿透前金额<br>(万元) | 占全部产品总资<br>产的比例 | 穿透后金额<br>(万元) | 占全部产品总资<br>产的比例 |
|---------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|
| 现金及银行存款 | 50.00         | 0.56%           | 346.68        | 3.44%           |

|               |          |        |           |        |
|---------------|----------|--------|-----------|--------|
| 同业存单          | -        | 0.00%  | -         | 0.00%  |
| 拆放同业及买入<br>返售 | -        | 0.00%  | 143.77    | 1.43%  |
| 债券            | -        | 0.00%  | 8,496.34  | 84.30% |
| 非标准化债权类<br>资产 | -        | 0.00%  | -         | 0.00%  |
| 权益类投资         | -        | 0.00%  | 505.80    | 5.02%  |
| 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%  | 585.73    | 5.81%  |
| 私募基金          | -        | 0.00%  | -         | 0.00%  |
| 资产管理产品        | 8,918.82 | 99.44% | -         | 0.00%  |
| 合计            | 8,968.82 | 100%   | 10,078.30 | 100%   |

注：报告期末本理财产品持仓金融衍生品 0.58 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  | 082100802：21 光穗华电 ABN002<br>优先(碳中和债) | 571.97 | 5.68% |
| 2  | 2128016：21 民生银行永续债 01                | 440.46 | 4.37% |
| 3  | CNY：现金及银行存款                          | 346.68 | 3.44% |
| 4  | 092100012：21 长城资本债 01BC              | 245.23 | 2.43% |
| 5  | 189323：生物 R1 优                       | 243.40 | 2.42% |
| 6  | 102101443：21 国药租赁 MTN001             | 238.51 | 2.37% |
| 7  | 2228038：22 民生银行永续债 01                | 197.27 | 1.96% |
| 8  | 102101896：21 锡产业 MTN003              | 191.05 | 1.90% |
| 9  | 2120115：21 厦门国际银行永续债<br>01           | 147.64 | 1.46% |

|    |                           |        |       |
|----|---------------------------|--------|-------|
| 10 | 102100952: 21 中建投租 MTN001 | 142.75 | 1.42% |
|----|---------------------------|--------|-------|

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（专精特新启航打新混合封闭式 206） |
| 账号  | 341572157118                  |
| 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，合理控制利率风险，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，动态调整组合久期。

#### （2）权益部分：

运作期内，在控制权益敞口的基础上，积极把握市场的趋势性机会和结构性机会，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，在做好风险控制的基础上把握市场的趋势性机会；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 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              | 092280139 | 22 交行二级资本债 02A  | 3,429    | 351,745.99 |
| 中国银行股份有限公司              | 2028052   | 20 恒丰银行永续债      | 1,741    | 182,901.28 |
| 中国银行股份有限公司              | 2028052   | 20 恒丰银行永续债      | 1,770    | 185,976.14 |
| 中国银行股份有限公司              | 2120064   | 21 恒丰银行永续债      | 5,567    | 595,085.22 |
| 中国银行股份有限公司              | 2121026   | 21 杭州联合农商永续债 01 | 5,223    | 564,963.06 |
| 中国银行股份有限公司              | 212380032 | 24 浦发银行债 01     | 1,856    | 185,623.30 |
| 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     | 5,567    | 575,147.81 |
| 中国银行股份有限公司；中银国际证券股份有限公司 | 242380033 | 23 招行永续债 01     | 1,856    | 191,784.53 |

|                                     |           |                   |        |            |
|-------------------------------------|-----------|-------------------|--------|------------|
| 中国银行股份有限公司;<br>中银国际证<br>券股份有限<br>公司 | 242380033 | 23 招行永续债<br>01    | 3,711  | 383,565.35 |
| 中银国际亚<br>洲有限公司                      | 00788     | 中国铁塔              | 10,464 | 9,215.40   |
| 中银国际亚<br>洲有限公司                      | 00788     | 中国铁塔              | 10,615 | 9,278.63   |
| 中银国际亚<br>洲有限公司                      | 00788     | 中国铁塔              | 3,572  | 3,125.93   |
| 中银国际证<br>券股份有限<br>公司                | 2120110   | 21 北京银行永<br>续债 02 | 5,567  | 577,689.68 |
| 中银国际证<br>券股份有限<br>公司                | 600015    | 华夏银行              | 1,726  | 10,876.67  |
| 中银国际证<br>券股份有限<br>公司                | 600015    | 华夏银行              | 17,401 | 110,616.19 |
| 中银国际证<br>券股份有限<br>公司                | 600015    | 华夏银行              | 893    | 5,657.14   |
| 中银国际证<br>券股份有限<br>公司                | 600900    | 长江电力              | 1,922  | 45,197.38  |
| 中银国际证<br>券股份有限<br>公司                | 600900    | 长江电力              | 21     | 522.14     |
| 中银国际证<br>券股份有限<br>公司                | 600900    | 长江电力              | 603    | 14,655.04  |
| 中银国际证<br>券股份有限<br>公司                | 601088    | 中国神华              | 8      | 307.48     |
| 中银国际证<br>券股份有限<br>公司                | 601166    | 兴业银行              | 31     | 494.81     |
| 中银国际证<br>券股份有限<br>公司                | 601668    | 中国建筑              | 45     | 234.09     |
| 中银国际证<br>券股份有限<br>公司                | 601958    | 金钼股份              | 1,878  | 17,966.27  |

|                      |        |      |        |           |
|----------------------|--------|------|--------|-----------|
| 中银国际证<br>券股份有限<br>公司 | 601958 | 金钼股份 | 104    | 1,025.13  |
| 中银国际证<br>券股份有限<br>公司 | 603993 | 洛阳钼业 | 10,695 | 84,518.46 |

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<br>产品代码 | 资产管理产品<br>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 | 99,811.36 |
| 产品托管费 | 中国银行股份有限公司 | 4,436.06  |

## 八、后市展望及下阶段投资策略

宏观经济坚持高质量发展主线，重点培育新质生产力，通过大规模设备更新和消费品以旧换新等方式扩大内需，房地产政策适时调整优化。活跃资本市场、提振投资者信心的政策持续落实，随着经济企稳，股票市场存在向好趋势。低通胀环境有利于债券市场的稳健表现。下阶段重点关注政策力度和经济增长动能的变化。

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，重点布局新质生产力和扩内需相关领域，深入研究行业动向，积极捕捉阶段性投资机会。丰富投资策略，力争多渠道增厚产品收益，努力增强净值稳定性。同时，持续优化固收类资产配置，根据产品情况调整组合久期。