

中银理财-专精特新启航打新策略混合类（封闭式）2023
年 10 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	ZJTXQH2023010
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 10 期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001023000356
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	2023-07-25
理财产品到期日	2025-08-18

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
ZJTXQH2023010	6,323,928.10	1.019785	1.019785	6,449,052.51	0.85%

(二) 截至报告期末, 理财产品杠杆水平: 113.21%

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	0.51	0.08%	146.95	20.21%

同业存单	-	0.00%	106.69	14.67%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	205.28	28.23%
债券	-	0.00%	244.39	33.60%
非标准化债权类 资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	23.95	3.29%
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	644.57	99.92%	-	0.00%
合计	645.08	100%	727.27	100%

注：报告期末本理财产品持仓金融衍生品 0.01 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	72.10	9.91%
2	DPTA00007088：存放同业	18.26	2.51%
3	DPTA00007090：存放同业	18.26	2.51%
4	DPTA00007278：存放同业	16.43	2.26%
5	DPTA00007259：存放同业	10.95	1.51%
6	TZBZ171118115229：13 日质押式逆 回购	9.13	1.26%
7	TZBZ171118437588：7 日质押式逆 回购	9.13	1.26%
8	TZBZ171118457766：7 日质押式逆 回购	9.13	1.26%

9	TZBZ171118457915: 7日质押式逆回购	9.13	1.26%
10	TZBZ171118676961: 14日质押式逆回购	9.13	1.26%

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10期
账号	327273733665
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）
中国银行股份有限公司	112304017	23 中国银行 CD017	160	15,881.52
中国银行股份有限公司	112304020	23 中国银行 CD020	139	13,770.00
中国银行股份有限公司	112304021	23 中国银行 CD021	101	10,029.94
中国银行股份有限公司	112304021	23 中国银行 CD021	51	5,014.97
中国银行股份有限公司	112304021	23 中国银行 CD021	57	5,703.18
中国银行股份有限公司	112304021	23 中国银行 CD021	57	5,703.18
中国银行股份有限公司	112304021	23 中国银行 CD021	60	5,905.43
中国银行股份有限公司	112304022	23 中国银行 CD022	123	12,256.50
中国银行股份有限公司	112304022	23 中国银行 CD022	144	14,353.70
中国银行股份有限公司	112304022	23 中国银行 CD022	433	43,061.10
中国银行股份有限公司	112304023	23 中国银行 CD023	69	6,851.05
中国银行股份有限公司	112304024	23 中国银行 CD024	139	13,859.37
中国银行股份有限公司	112304024	23 中国银行 CD024	209	20,789.06
中国银行股份有限公司	112304024	23 中国银行 CD024	278	27,718.33
中国银行股份有限公司	112304024	23 中国银行 CD024	57	5,691.76

中国银行股份有限公司	112304024	23 中国银行 CD024	58	5,824.91
中国银行股份有限公司	112304024	23 中国银行 CD024	70	6,929.69
中国银行股份有限公司	112304025	23 中国银行 CD025	61	6,026.80
中国银行股份有限公司	112304026	23 中国银行 CD026	160	15,879.43
中国银行股份有限公司	112304026	23 中国银行 CD026	209	20,787.85
中国银行股份有限公司	112304026	23 中国银行 CD026	57	5,732.18
中国银行股份有限公司	112304026	23 中国银行 CD026	57	5,732.18
中国银行股份有限公司	112304027	23 中国银行 CD027	207	20,550.74
中国银行股份有限公司	112304027	23 中国银行 CD027	68	6,747.37
中国银行股份有限公司	112304033	23 中国银行 CD033	152	15,058.25
中国银行股份有限公司	112304037	23 中国银行 CD037	101	10,005.78
中国银行股份有限公司	112304044	23 中国银行 CD044	70	6,868.02
中国银行股份有限公司	112304054	23 中国银行 CD054	176	17,485.24
中国银行股份有限公司	112304055	23 中国银行 CD055	152	15,041.59
中国银行股份有限公司	112304056	23 中国银行 CD056	152	15,041.59
中国银行股份有限公司	112304065	23 中国银行 CD065	176	17,435.26
中国银行股份有限公司	112304065	23 中国银行 CD065	72	7,144.59
中国银行股份有限公司	112304068	23 中国银行 CD068	353	34,863.86

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	289	29,697.43

中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永续债	147	15,442.07
中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永续债	149	15,701.77
中国银行股份有限公司	2120064	21 恒丰银行永续债	470	50,242.45
中国银行股份有限公司	2121026	21 杭州联合农商永续债 01	441	47,698.96
中国银行股份有限公司	212380032	24 浦发银行债 01	157	15,671.92
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	470	48,559.15
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	157	16,192.18
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	313	32,384.04
中银国际证券股份有限公司	2120110	21 北京银行永续债 02	470	48,773.76
中银国际证券股份有限公司	600015	华夏银行	1,469	9,339.18
中银国际证券股份有限公司	600015	华夏银行	146	918.31
中银国际证券股份有限公司	600015	华夏银行	75	477.62
中银国际证券股份有限公司	600900	长江电力	162	3,815.96
中银国际证券股份有限公司	600900	长江电力	51	1,237.31

中银国际证券股份有限公司	603993	洛阳钼业	903	7,135.78
--------------	--------	------	-----	----------

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	7,200.76
产品托管费	中国银行股份有限公司	320.03
14 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	25,014.00
1 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	109,132.53
1 日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	39,960.00
3 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	6,450.35
7 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	55,669.10
7 日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	39,266.42

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。