

中银理财-稳富（双月开）007  
2023 年年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：中国工商银行股份有限公司

报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

### 一、理财产品基本情况

理财产品代码	GH12202
理财产品名称	中银理财-稳富（双月开）007
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000120
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	2022-04-07
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
GH12202	514,882,317.73	1.050117	1.050117	540,687,110.54	2.69%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：109.21%

### 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	7,039.27	13.01%	24,408.89	41.92%
同业存单	-	0.00%	-	0.00%

拆放同业及买入返售	-	0.00%	875.32	1.50%
债券	-	0.00%	31,797.48	54.61%
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%	1,141.57	1.96%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	47,058.63	86.99%	-	0.00%
合计	54,097.90	100%	58,223.26	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	100201030110022102703：存放同业	11,422.27	19.62%
2	CNY：现金及银行存款	10,218.33	17.55%
3	100201030110022092903：存放同业	1,842.40	3.16%
4	YMYJ1912023120720402801：28日 质押式逆回购	875.32	1.50%
5	230024：23 付息国债 24	553.97	0.95%
6	230016：23 付息国债 16	551.71	0.95%
7	220013：22 付息国债 13	479.30	0.82%
8	092000016：20 东方资本债 01	479.25	0.82%
9	102282383：22 九龙江 MTN002	418.94	0.72%
10	100201030110023083101：存放同业	411.51	0.71%

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	工商银行托管专户-中银理财稳富双月开 007
账号	1001252429200289684
开户行	中国工商银行股份有限公司上海市虹口支行

## 六、产品组合流动性风险分析

报告期内，产品管理人严格遵守流动性新规等监管要求，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，控制流动性受限资产、杠杆融资比例，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

2023 年全年资金面偏宽松和债市利率中枢持续下行的背景下，本产品为满足流动性备付的基础上，积极配置具有安全边际的固收类资产获取底仓票息收益，并根据市场走势调整组合久期和杠杆，博弈中短线交易的资本利得。

### （二）非标资产投资情况

无

### （三）关联交易情况

本产品于 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 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）
中国工商银行股份有限公司	112302004	23 工商银行 CD004	9,050	888,246.64

中国工商银行股份有限公司	112302009	23 工商银行 CD009	4,300	422,368.26
中国工商银行股份有限公司	112302009	23 工商银行 CD009	87,350	8,695,896.35
中国工商银行股份有限公司	112302041	23 工商银行 CD041	19,370	1,912,810.74
中国工商银行股份有限公司	112302053	23 工商银行 CD053	9,704	945,546.98
中国工商银行股份有限公司	1928006	19 工商银行二级 01	8,190	832,587.21
中国工商银行股份有限公司	1928011	19 工商银行二级 03	34,120	3,476,123.12
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	11,115	1,131,730.41
中国工商银行股份有限公司	2028041	20 工商银行二级 01	3,277	336,942.28
中国工商银行股份有限公司	2128002	21 工商银行二级 01	6,345	671,665.75
中国工商银行股份有限公司	2128051	21 工商银行二级 02	26,540	2,708,381.91

本产品于 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 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）
中国工商银行股份有限公司	012382134	23 华为 SCP002	16,670	1,667,000.00
中国工商银行股份有限公司	082300391	23 徐工机械 ABN003 优先 A1	13,500	1,350,016.20

中国工商银行股份有限公司	102001222	20 华能 MTN002	4,680	469,275.77
中国工商银行股份有限公司	102001816	20 中交集 MTN001	2,925	295,764.89
中国工商银行股份有限公司	102001816	20 中交集 MTN001	4,680	473,257.51
中国工商银行股份有限公司	102382102	23 南京安居 MTN001(绿色)	52,410	5,241,000.00
中国工商银行股份有限公司;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	9,831	1,008,350.40
中国工商银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	132380061	23 三峡 GN002	34,940	3,494,824.81
中国工商银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	2320041	23 南京银行 01	17,470	1,747,000.00
中国工商银行股份有限公司, 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	87,350	8,735,000.00
中国银行股份有限公司	012384563	23 东泰投资 SCP001	9,000	900,010.80
中国银行股份有限公司	012384567	23 常德经建 SCP003	9,000	900,010.80
中国银行股份有限公司	032380965	23 上饶城投 PPN003	4,840	484,052.50
中国银行股份有限公司	082380820	23 华电山西 ABN001 优先	17,434	1,743,404.20

中国银行股份有限公司	082380909	23 京东东裕 2ABN001 优先 A	8,527	852,668.10
中国银行股份有限公司	102102329	21 中建四局 MTN002	78,900	8,040,425.88
中国银行股份有限公司	102300441	23 华能 MTN013	52,410	5,241,393.79
中国银行股份有限公司	102381237	23 华电 MTN004B(能源保供特别 债)	17,060	1,706,440.48
中国银行股份有限公司	102381363	23 中化股 MTN001	33,340	3,334,265.99
中国银行股份有限公司	102382056	23 厦国贸控 MTN003	17,470	1,747,174.22
中国银行股份有限公司	102382128	23 中铁十一 MTN002(科创 票据)	34,940	3,494,902.14
中国银行股份有限公司	102382703	23 湘建工 MTN002(科创 票据)	4,846	484,605.25
中国银行股份有限公司	1828012	18 中信银行二 级 02	2,340	237,633.79
中国银行股份有限公司	1920076	19 徽商银行永 续债	78,900	8,115,235.18
中国银行股份有限公司	2389373	23 汇聚融 1A1_BC	166	16,632.20
中国银行股份有限公司	UL510018	23 中联重科 ABN002 优先 A1(科创票据)	2,182	218,153.20
中国银行股份有限公司, 中银国际证 券股份有限 公司	1928018	19 工商银行永 续债	11,115	1,131,730.41
中国银行股份有限公司, 中银国际证 券股份有限 公司	2128051	21 工商银行二 级 02	26,540	2,708,381.91

中国银行股份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2028041	20 工商银行二 级 01	3,277	336,942.28
中国银行股份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2128002	21 工商银行二 级 01	6,345	671,665.75
中银国际证 券股份有限 公司	1828010	18 建设银行二 级 01	22,230	2,256,233.85
中银国际证 券股份有限 公司	1928004	19 农业银行二 级 02	7,605	773,117.46
中银国际证 券股份有限 公司	1928006	19 工商银行二 级 01	8,190	832,587.21
中银国际证 券股份有限 公司	1928009	19 农业银行二 级 04	1,170	119,054.40
中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	34,120	3,476,123.12
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	17,434	1,794,768.80
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	34,120	3,604,906.44

本产品于 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 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）
中银国际证 券股份有限 公司	BOCIZGH HZ37	中银证券中国 红-汇中 37 号 集合资产管理 计划	10,336,167	10,700,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	BOCIZGH HZ37	中银证券中国 红-汇中 37 号 集合资产管理 计划	19,451,469	20,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCIZGH HZ37	中银证券中国 红-汇中 37 号 集合资产管理 计划	34,193,044	35,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCIZGH HZ37	中银证券中国 红-汇中 37 号 集合资产管理 计划	38,952,186	40,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCIZGH HZ37	中银证券中国 红-汇中 37 号 集合资产管理 计划	48,538,977	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCIZGH HZ37	中银证券中国 红-汇中 37 号 集合资产管理 计划	86,827,824	88,000,000.00

本产品于 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 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）
3 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公 司	1,388,800.00
7 日质押式正回购	工银瑞信基金管理有限公 司	45,026,556.00
现券买入	中国银行股份有限公司	54,655,129.55
现券买入	中银国际证券股份有限公 司	2,109,335.46
现券卖出	中银国际证券股份有限公 司	4,543,349.21

## 八、后市展望及下阶段投资策略

流动性整体宽松基调不变及经济温和修复的新周期下，预计 2024 债券市场表现仍有韧性。本产品作为主要投向固收资产的产品，下阶段将继续根据市场变化灵活调整持仓结构，择机增配适当久期票息资产，优化资产配置。

## 中银理财-稳富（双月开）007

### 2023年年度托管报告

（报告期间：2023年01月01日-2023年12月31日）

本托管人依据中银理财有限责任公司与我行签署的《中银理财理财产品托管协议》履行托管人责任，现将本报告期间托管情况报告如下：

一、本托管人在报告期间，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在损害资产委托人利益的行为。

（一）本托管人以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责，安全保管托管专户内委托资产；非依法律规定、行政法规或托管协议约定，不得擅自动用或处分托管资产；

（二）根据托管协议约定，执行管理人划款指令，办理托管专户项下资金往来；

（三）根据《托管协议》约定，对资产管理人运用投资组合资产进行投资的行为进行了监督；

（四）为投资组合单独设立托管专户，与自有账户以及所托管的其他非本投资组合的托管专户分别保管，实行了严格的分账管理，维护投资组合资产的独立性。

二、本计划托管人复核了管理人编制的《中银理财-稳富（双月开）007 2023年年度投资运作情况报告》中最后一个交易日的产品总份额、份额净值，核对无误。

中国银行股份有限公司  
上海市分行资产托管与养老金业务部  
2024年2月22日  
资产托管业务专用章  
(2)