

中银理财稳富固收双月开 2 号 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	GH12204
理财产品名称	中银理财稳富固收双月开 2 号
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000184
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	2022-07-27
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
GH12204	389,283,307.94	1.041135	1.041135	405,296,628.40	2.84%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：111.70%

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	4,554.47	11.23%	14,409.63	32.28%
同业存单	-	0.00%	602.32	1.35%

拆放同业及买入返售	-	0.00%	43.56	0.10%
债券	-	0.00%	29,150.95	65.31%
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%	427.53	0.96%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	35,995.67	88.77%	-	0.00%
合计	40,550.14	100%	44,633.99	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	7,420.58	16.63%
2	D002008840：存放同业	1,234.96	2.77%
3	D002008753：存放同业	1,234.89	2.77%
4	D002008821：存放同业	1,173.14	2.63%
5	D002008695：存放同业	555.70	1.25%
6	D002008685：存放同业	555.70	1.25%
7	D002008645：存放同业	555.70	1.25%
8	D002008740：存放同业	518.65	1.16%
9	032281012：22 郴投集团 PPN001	511.29	1.15%
10	102381358：23 华能新能 MTN002	510.47	1.14%

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—中银理财稳富固收双月开 2 号
账号	1001252429200290275
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	5,800	569,263.04

中国工商银行股份有限公司	112302009	23 工商银行 CD009	59,900	5,963,184.79
中国工商银行股份有限公司	112302041	23 工商银行 CD041	5,277	521,098.50
中国工商银行股份有限公司	112302053	23 工商银行 CD053	367	35,727.41
中国工商银行股份有限公司	1928011	19 工商银行二级 03	23,260	2,369,713.47
中国工商银行股份有限公司	1928011	19 工商银行二级 03	3,583	361,063.16
中国工商银行股份有限公司	2028041	20 工商银行二级 01	602	61,937.51
中国工商银行股份有限公司	2128002	21 工商银行二级 01	1,166	123,467.00
中国工商银行股份有限公司	2128051	21 工商银行二级 02	18,100	1,847,087.89

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	11,370	1,137,000.00
中国工商银行股份有限公司	082300391	23 徐工机械 ABN003 优先 A1	5,056	505,598.70
中国工商银行股份有限公司	102382102	23 南京安居 MTN001(绿色)	35,940	3,594,000.00

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	1,807	185,357.29
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	23,960	2,396,565.61
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	11,980	1,198,000.00
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	59,900	5,990,000.00
中国银行股份有限公司	012384563	23 东泰投资 SCP001	3,371	337,065.80
中国银行股份有限公司	012384567	23 常德经建 SCP003	3,371	337,065.80
中国银行股份有限公司	032380965	23 上饶城投 PPN003	300	30,003.25
中国银行股份有限公司	082380820	23 华电山西 ABN001 优先	488	48,750.80
中国银行股份有限公司	082380909	23 京东东裕 2ABN001 优先 A	3,193	319,335.30
中国银行股份有限公司	102300441	23 华能 MTN013	35,940	3,594,270.04
中国银行股份有限公司	102381237	23 华电 MTN004B(能源保供特别债)	11,630	1,163,300.28
中国银行股份有限公司	102381363	23 中化股 MTN001	22,740	2,274,181.42

中国银行股份有限公司	102382056	23 厦国贸控 MTN003	11,980	1,198,119.47
中国银行股份有限公司	102382128	23 中铁十一 MTN002(科创 票据)	23,960	2,396,618.64
中国银行股份有限公司	102382703	23 湘建工 MTN002(科创 票据)	302	30,234.90
中国银行股份有限公司	2389373	23 汇聚融 1A1_BC	334	33,423.40
中国银行股份有限公司	UL510018	23 中联重科 ABN002 优先 A1(科创票据)	13,396	1,339,649.00
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	18,100	1,847,087.89
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	602	61,937.51
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	1,166	123,467.00
中银国际证 券股份有限 公司	1928009	19 农业银行二 级 04	5,374	541,023.46
中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	23,260	2,369,713.47
中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	3,583	361,063.16
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	1,236	125,251.29
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	1,236	125,193.08

中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	1,236	125,278.11
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	2,472	250,538.91
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	488	50,187.11
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	6,179	626,132.24
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	23,260	2,457,506.56

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	24,314,336	25,000,000.00
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	38,944,601	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	59,200,789	60,000,000.00
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	79,211,747	82,000,000.00

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	412,800.00
7 日质押式正回购	工银瑞信基金管理有限公司	27,856,318.00
现券买入	中国银行股份有限公司	34,854,437.79
现券买入	中银国际证券股份有限公司	789,973.68
现券卖出	中银国际证券股份有限公司	1,999,347.52

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。

中银理财稳富固收双月开2号

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《中银理财稳富固收双月开2号 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)