

中银理财-稳富·君鑫（周周开）私银尊享 01
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	GH22201
理财产品名称	中银理财-稳富·君鑫（周周开）私银尊享01
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000118
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	2022-04-26
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
GH22201	1,053,915,021.55	1.045755	1.045755	1,102,137,021.46	2.74%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：101.43%

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	11,379.35	10.32%	18,866.25	16.99%

同业存单	-	0.00%	-	0.00%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	6,435.56	5.80%
债券	-	0.00%	85,716.89	77.21%
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	98,894.21	89.68%	-	0.00%
合计	110,273.56	100%	111,018.70	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	18,866.25	16.99%
2	011120231212204028：28 日质押式 逆回购	2,957.10	2.66%
3	253109：23 发投 04	2,176.61	1.96%
4	180802：铁建 37A1	1,513.07	1.36%
5	112060：二发 A	1,433.91	1.29%
6	196837：21 郑地 05	1,326.45	1.19%
7	253110：23 沪地 02	1,245.94	1.12%
8	261383：23 中公 3A	1,182.84	1.07%
9	253163：23 华泰 F2	1,182.84	1.07%
10	253503：23 中电 01	1,182.84	1.07%

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—中银理财稳富君鑫周周开私银尊享 01
账号	1001252429200289835
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

截至本报告期末，产品杠杆率不超过 120%，所持仓资产流动性较好，报告期内未出现流动性风险。

七、本运作期主要操作回顾

（一）主要投资策略及操作

2023 年，疫情对经济活动的制约显著减小，经济运行整体回升向好，但依然面临需求不足的问题，宏观经济增速从二季度开始边际放缓，债市收益率震荡下行。8 月份央行降息后，市场资金面波动，叠加地方政府化债、房地产行业政策的出台，债券收益率反弹。12 月份，随着利率债供给高峰结束，资金面边际宽松，收益率再度下行。全年来看，债券市场收益率处于下行趋势。本产品以票息策略为主，辅之以交易性策略，2023 年资产配置以具有票息价值的城投债为主，在存款具有比价优势时适当进行增配，并通过利率债交易来提升产品收益率。

（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	1928018	19 工商银行永续债	3,040	308,092.14
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	4,560	462,098.54
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	7,600	771,096.00
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	7,600	770,222.76

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	042280480	22 电网 CP012	35,280	3,572,772.30
中国工商银行股份有限公司	082380302	23 中铁四局 1ABN001 优先(科创票据)	3,480	348,000.00
中国工商银行股份有限公司	102001153	20 光大绿环 MTN001	2,300	237,946.66
中国工商银行股份有限公司	102380136	23 雅居乐 MTN001	45	4,500.00
中国工商银行股份有限公司	102380139	23 广州合景 MTN001	27	2,700.00
中国工商银行股份有限公司	102380394	23 华为 MTN003	2,470	247,000.00
中国工商银行股份有限公司	102381339	23 湘高速 MTN003	2,880	288,000.00

中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	1,509	152,891.32
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	3,019	305,845.73
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	4,528	459,138.96
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	3,019	305,333.78
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	5,282	534,480.97
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	755	76,390.57
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928023	19 农业银行永续债 02	1,509	152,639.42
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928023	19 农业银行永续债 02	2,264	228,862.91

中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928023	19 农业银行永续债 02	3,019	305,117.95
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928023	19 农业银行永续债 02	5,282	534,237.97
中国工商银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	2389271	23 屹隆 1 优先	6,120	612,112.68
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	2328018	23 兴业银行绿色金融债 02	480	48,000.00
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	24,480	2,448,000.00
中国工商银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	7,600	770,437.84
中国工商银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	7,600	771,279.16
中国工商银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	7,600	770,437.84

中国银行股份有限公司	012381008	23 宁波建工 SCP002	2,470	247,000.00
中国银行股份有限公司	012381971	23 津城建 SCP032	1,150	115,000.00
中国银行股份有限公司	012382234	23 闽能源 SCP002(碳资产)	480	48,000.00
中国银行股份有限公司	042380208	23 云能投 CP003	1,680	168,062.66
中国银行股份有限公司	101900393	19 华能集 MTN001B	11,016	1,143,916.77
中国银行股份有限公司	102001290	20 鲁高速 MTN002	2,140	221,816.04
中国银行股份有限公司	102001733	20 豫交投 MTN004	2,400	248,906.28
中国银行股份有限公司	102281556	22 川水电 MTN001	11,296	1,145,805.23
中国银行股份有限公司	102380686	23 宁夏国资 MTN001	2,470	247,000.00
中国银行股份有限公司	102380777	23 兴蓉环境 MTN001	1,680	168,000.00
中国银行股份有限公司	102381236	23 华电 MTN004A(能源保供特别 债)	2,300	230,000.00
中国银行股份有限公司	102381363	23 中化股 MTN001	1,920	192,000.00
中国银行股份有限公司	102381612	23 华电股 MTN007A	1,320	132,000.00
中国银行股份有限公司	102381635	23 粤交投 MTN002A	440	44,000.00
中国银行股份有限公司	102381777	23 京城建 MTN002	880	88,000.00
中国银行股份有限公司	2320033	23 厦门银行小微债 01	440	44,000.00
中国银行股份有限公司	2389387	23 吉时代 4 优先_BC	512	51,219.60
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	3,040	308,092.14

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	4,560	462,098.54
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	7,600	770,222.76
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	7,600	771,096.00
中银国际证券股份有限公司	1928004	19 农业银行二级 02	4,600	468,833.81
中银国际证券股份有限公司	252674	23 嵊交 D2	2,422	242,241.29
中银国际证券股份有限公司	252674	23 嵊交 D2	4,703	470,270.40

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）
工银瑞信基金管理有限公司	003753	工银如意货币 B	211,239	211,238.85
中银国际证券股份有限公司	BOCI-ZGH-HZ-038	中银证券中国红-汇中 38 号集合资产管理计划	24,457,053	25,000,000.00
中银国际证券股份有限公司	BOCI-ZGH-HZ-038	中银证券中国红-汇中 38 号集合资产管理计划	26,491,366	27,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 038	中银证券中国 红-汇中 38 号 集合资产管理 计划	29,191,398	30,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 038	中银证券中国 红-汇中 38 号 集合资产管理 计划	43,646,945	45,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 038	中银证券中国 红-汇中 38 号 集合资产管理 计划	64,684,408	67,330,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 038	中银证券中国 红-汇中 38 号 集合资产管理 计划	98,531,875	100,000,000.00

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）
10 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	3,556,800.00
16 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	178,200.00
1 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	13,728,000.00
1 日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	5,203,016.00
3 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	94,484,000.00
现券买入	中国银行股份有限公司	4,686,332.28
现券买入	中银国际证券股份有限公司	4,057,014.72
现券卖出	工银理财有限责任公司	837,899.84
现券卖出	中银国际证券股份有限公司	642,315.09

八、后市展望及下阶段投资策略

2024 年，国内经济复苏力度与节奏仍有待观察，预计货币政策将保持灵活适度以支持经济回升，债券市场利率维持低位的概率较大，具有票息价值的固收类资产仍具有性价比。下一步，产品将加大对票息资产的投资力度，并利用利率债波段交易力争提升产品收

益。

中银理财-稳富·君鑫（周周开）私银尊享 01

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；

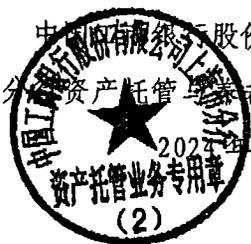
（二）根据托管协议约定，执行管理人划款指令，办理托管专户项下资金往来；

（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·君鑫（周周开）私银尊享 01 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。

中银理财股份有限公司
上海市分行资产托管与养老金业务部



2024年2月22日