

(ESG 优享) 中银理财- (6 个月) 最短持有期混合类理财产品
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	CYQESGHH6M
理财产品名称	(ESG 优享) 中银理财- (6 个月) 最短持有期混合类理财产品
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000607
产品类型	混合类产品
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	03 三级(中)
理财产品成立日	2022-12-20
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
CYQESGHH6MA	295,412,845.21	1.029278	1.029278	304,061,990.31	2.90%
CYQESGHH6MB	419,137,735.41	1.030297	1.030297	431,836,367.72	3.00%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：122.28%

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	12,239.33	16.62%	13,032.65	14.63%
同业存单	-	0.00%	222.04	0.25%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	-	0.00%
债券	-	0.00%	65,389.15	73.40%
非标准化债权类 资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	1,902.57	2.14%
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%	8,537.97	9.58%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	61,408.16	83.38%	-	0.00%
合计	73,647.49	100%	89,084.38	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	13,032.65	14.63%
2	000191：富国信用债债券 A	749.06	0.84%
3	000205：易方达投资信用 A	707.66	0.79%
4	251870：23 晋信 03	656.06	0.74%
5	230017：23 付息国债 17	645.64	0.72%
6	000390：华商优势行业混合	623.22	0.70%
7	102381619：23 水利十四 MTN002	571.53	0.64%
8	082280909：22 周大福 ABN001(绿色)优先	560.42	0.63%
9	102380791：23 南投集团 MTN001	503.49	0.57%

10	102103240: 21 水利十四 MTN002	503.34	0.57%
----	---------------------------	--------	-------

注：本表列示穿透后投资规模占比较高的前十名资产

五、投资账户信息

户名	中银理财有限责任公司（ESG 优享 6 个月最短持有期混合类）
账号	775776444342
开户行	中国银行深圳市分行营业部

六、产品组合流动性风险分析

本产品为开放式产品，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

（1） 固收部分：

运作期内，积极把握利率下行以及地方债务风险化解机会，合理控制久期风险，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和部分债券型基金，动态控制组合久期。

（2） 权益部分：

运作期内，根据产品情况严格控制权益敞口，适度把握市场的结构性机会，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；另一方面，持续优化权益资产结构，紧扣国家战略，挖掘市场主线，适度参与市场热点机会。

（二） 非标资产投资情况

无

(三) 关联交易情况

本产品于 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）
中国银行股份有限公司	1928001	19 中国银行永续债 01	4,550	480,910.81
中国银行股份有限公司	1928001	19 中国银行永续债 01	910	96,177.61

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）
中国银行股份有限公司	042380292	23 广西金控 CP001	2,730	273,040.28
中国银行股份有限公司	082380110	23 新能源 3ABN001 优先(碳中和债)	2,060	206,042.33
中国银行股份有限公司	082380191	23 新能源 4ABN002 优先(碳中和债)	2,730	273,018.70
中国银行股份有限公司	102000518	20 河钢集 MTN004	11,477	1,176,210.15
中国银行股份有限公司	102002203	20 广州城投 MTN001	37,333	3,892,089.44
中国银行股份有限公司	102102121	21 华电股 MTN005	18,200	1,871,626.72
中国银行股份有限公司	102103103	21 蜀道投资 MTN006	14,560	1,488,247.33
中国银行股份有限公司	102103240	21 水利十四 MTN002	6,630	667,224.23
中国银行股份有限公司	102300475	23 华能 MTN014	5,150	515,128.75
中国银行股份有限公司	102300571	23 金辉集团 MTN002	560	56,053.94
中国银行股份有限公司	102380118	23 华电股 MTN001(能源保供特别债)	4,550	455,047.00

中国银行股份有限公司	102380686	23 宁夏国资 MTN001	2,060	206,020.77
中国银行股份有限公司	102381150	23 碧桂园 MTN002	273	27,302.95
中国银行股份有限公司	102381152	23 碧桂园 MTN001	273	27,302.83
中国银行股份有限公司	102381189	23 厦港务 MTN001	10,920	1,092,299.85
中国银行股份有限公司	102381341	23 首农食品 MTN002	6,040	604,157.93
中国银行股份有限公司	102381581	23 中核汇能 MTN001A(碳 中和债)	20,950	2,095,176.87
中国银行股份有限公司	102381619	23 水利十四 MTN002	15,450	1,551,528.01
中国银行股份有限公司	102381619	23 水利十四 MTN002	20,950	2,095,558.09
中国银行股份有限公司	102381997	23 中煤集团 MTN002	3,960	396,029.97
中国银行股份有限公司	102382772	23 陕有色 MTN002	11,236	1,123,881.34
中国银行股份有限公司	102382810	23 大唐山西 MTN002	17,035	1,703,645.24
中国银行股份有限公司	102382904	23 北控集 MTN001	5,704	570,540.11
中国银行股份有限公司	102382927	23 中建投资 MTN001	26,819	2,686,282.63
中国银行股份有限公司	102383020	23 晋能煤业 MTN009	22,400	2,235,905.80
中国银行股份有限公司	102383109	23 中电路桥 MTN001	6,283	628,316.99
中国银行股份有限公司	102383228	23 福建港口 MTN003	12,811	1,281,414.37
中国银行股份有限公司	102383229	23 温州交通 MTN003	26,819	2,683,412.71
中国银行股份有限公司	102383255	23 上海宝冶 MTN001	17,879	1,788,101.58
中国银行股份有限公司	102383321	23 东南国资 MTN004	26,819	2,682,136.24
中国银行股份有限公司	102383376	23 本钢集团 MTN002(科创 票据)	5,605	560,527.50

中国银行股份有限公司	132100133	21 福瑞能源 GN004(碳中和 债)	16,760	1,738,669.98
中国银行股份有限公司	132380067	23 晋能电力 GN011(碳中和 债)	5,150	512,935.14
中国银行股份有限公司	1920076	19 徽商银行永 续债	4,550	463,979.14
中国银行股份有限公司	1920076	19 徽商银行永 续债	4,550	464,226.66
中国银行股份有限公司	1928002	19 民生银行二 级 01	1,140	117,453.96
中国银行股份有限公司	1928002	19 民生银行二 级 01	1,140	117,435.44
中国银行股份有限公司	1928022	19 兴业银行二 级 01	6,038	615,069.11
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	12,002	1,266,418.50
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	12,016	1,268,435.54
中国银行股份有限公司	2023002	20 中邮人寿	7,280	742,080.53
中国银行股份有限公司	2120118	21 广州银行永 续债	7,280	743,697.95
中国银行股份有限公司	2123006	21 交银康联人 寿 01	7,280	753,297.80
中国银行股份有限公司	2126003	21 华侨永亨中 国 01	1,230	124,705.55
中国银行股份有限公司	2226006	22 汇丰银行 02	2,050	210,614.10
中国银行股份有限公司	2320005	23 厦门国际银 行三农债 01	2,060	206,017.17
中国银行股份有限公司	2320031	23 华润银行小 微债 01	3,550	355,026.26
中国银行股份有限公司	2371340	23 河北债 62	15,270	1,527,259.61
中国银行股份有限公司	2371340	23 河北债 62	22,905	2,289,973.21
中国银行股份有限公司	2371358	23 云南债 38	7,403	740,397.30
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	13,920	1,392,128.17
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	36,050	3,605,331.94

中国银行股份有限公司	272380014	23 东方二级资本债 01BC	17,400	1,740,190.16
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	12,993	1,299,437.05
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	44,698	4,496,414.30
中国银行股份有限公司	809112	23 湖南 140	8,940	893,541.28
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1920049	19 成都银行二级	820	87,294.47
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1920049	19 成都银行二级	820	87,278.92
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2028006	20 邮储银行永续债	10,920	1,112,234.96
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2028006	20 邮储银行永续债	12,800	1,292,364.11
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	10,920	1,102,562.29
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	12,800	1,324,960.25
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	6,020	624,077.77

中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2120089	21 北京银行永续债 01	7,280	768,978.78
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	232380008	23 广州农商行二级资本债 01	5,500	550,282.51
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2328021	23 兴业银行小微债 01	5,460	546,038.00
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	51,500	5,151,806.72
中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司	190311	19 进出 11	3,959	414,617.35
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	19,216	1,922,149.91
中银国际证券股份有限公司	002739	万达电影	16,796	210,467.26
中银国际证券股份有限公司	003816	中国广核	2	7.37
中银国际证券股份有限公司	003816	中国广核	2	7.48
中银国际证券股份有限公司	003816	中国广核	3	9.89

中银国际证 券股份有限 公司	113021	中信转债	149	17,508.53
中银国际证 券股份有限 公司	1928001	19 中国银行永 续债 01	4,550	480,910.81
中银国际证 券股份有限 公司	1928001	19 中国银行永 续债 01	910	96,177.61
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	12,016	1,224,252.99
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	30,220	3,075,742.22
中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二 级	1,140	114,679.11
中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二 级	570	57,298.73
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	18,200	1,918,684.06
中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	17,879	1,788,604.74
中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	26,819	2,682,907.11
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	1,411	31,381.88
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	20,874	471,961.39
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	1,415	10,177.16
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	1,416	10,281.07

中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	2,769	19,705.96
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	637	4,503.59
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	668	4,737.37
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	8,399	60,799.16
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	9,804	69,275.96
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	218	21,850.68
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	75	7,320.48
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	521	5,875.94
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	601	6,883.04
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	717	8,080.20
中银国际证 券股份有限 公司	601018	宁波港	2	5.62
中银国际证 券股份有限 公司	601018	宁波港	2	5.62
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	1,001	30,709.88
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	2,451	75,268.37

中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	2,601	77,943.98
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	231	6,598.77
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	3,410	100,095.86
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	389	11,075.63
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	731	21,513.73
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	839	24,066.59
中银国际证 券股份有限 公司	601106	*ST 一重	118	399.66
中银国际证 券股份有限 公司	601106	中国一重	3	10.15
中银国际证 券股份有限 公司	601106	中国一重	8	26.20
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	1,529	24,611.81
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	1,591	22,885.87
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	1,923	31,256.74
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	3,043	45,422.74
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	3,997	64,941.23

中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	599	9,721.10
中银国际证 券股份有限 公司	601298	青岛港	2	10.34
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,358	7,995.72
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,483	8,621.70
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,673	10,269.64
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	11,862	61,880.98
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	19,498	101,041.54
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	4,104	25,188.84
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	5,990	28,330.65
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	717	4,051.90
中银国际证 券股份有限 公司	601669	中国电建	28	166.27
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	244	1,454.00
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	4,091	24,363.27
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	4,734	28,103.02

中银国际证 券股份有限 公司	601858	中国科传	7	232.89
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	2	25.82
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	36	433.54
中银国际证 券股份有限 公司	601991	大唐发电	114	365.42
中银国际证 券股份有限 公司	601991	大唐发电	2	4.96
中银国际证 券股份有限 公司	601991	大唐发电	29	94.21
中银国际证 券股份有限 公司	601991	大唐发电	9	27.18
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	27	245.28
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	2	9.54
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	2	10.00
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	2	9.59
中银国际证 券股份有限 公司	688009	中国通号	2	12.58

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	ZYGJZGH HZ5720220 719	中银证券中国 红-汇中 57 号 集合资产管理 计划	12,788,982	13,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ QHZ55202 20302	中银证券中国 红-汇中 55 号 集合资产管理 计划	14,667,058	15,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ QHZ55202 20302	中银证券中国 红-汇中 55 号 集合资产管理 计划	16,583,748	17,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ QHZ55202 20302	中银证券中国 红-汇中 55 号 集合资产管理 计划	3,850,597	4,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ QHZ55202 20302	中银证券中国 红-汇中 55 号 集合资产管理 计划	4,804,920	5,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ QHZ55202 20302	中银证券中国 红-汇中 55 号 集合资产管理 计划	4,813,709	5,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ QHZ55202 20302	中银证券中国 红-汇中 55 号 集合资产管理 计划	4,856,255	5,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ QHZ55202 20302	中银证券中国 红-汇中 55 号 集合资产管理 计划	4,878,525	5,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ QHZ55202 20302	中银证券中国 红-汇中 55 号 集合资产管理 计划	9,731,413	10,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ QHZ55202 20302	中银证券中国 红-汇中 55 号 集合资产管理 计划	9,741,841	10,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ QHZ55202 20302	中银证券中国 红-汇中 55 号 集合资产管理 计划	9,779,951	10,000,000.00

中银基金管理有限公司	163822	中银主题策略混合 A	201,454	776,000.00
中银基金管理有限公司	163822	中银主题策略混合 A	310,483	1,164,000.00
中银基金管理有限公司	163822	中银主题策略混合 A	570,006	2,046,890.40
中银基金管理有限公司	ZFZYJJ20210706	中银基金-中银理财固收增强 1 号集合资产管理计划	972,006	1,000,000.00
中银基金管理有限公司	ZYJXIHE120221128	中银基金-羲和 1 号集合资产管理计划	4,936,321	5,000,000.00
中银基金管理有限公司	ZYJXIHE120221128	中银基金-羲和 1 号集合资产管理计划	9,753,243	10,000,000.00
中银基金管理有限公司	ZYJXIHE120221128	中银基金-羲和 1 号集合资产管理计划	9,755,146	10,000,000.00
中银基金管理有限公司	ZYJXIHE120221128	中银基金-羲和 1 号集合资产管理计划	9,756,098	10,000,000.00
中银基金管理有限公司	ZYJXIHE120221128	中银基金-羲和 1 号集合资产管理计划	9,760,859	10,000,000.00
中银基金管理有限公司	ZYJXIHE120221128	中银基金-羲和 1 号集合资产管理计划	9,767,533	10,000,000.00
中银基金管理有限公司	ZYJXIHE120221128	中银基金-羲和 1 号集合资产管理计划	9,812,580	10,000,000.00
中银基金管理有限公司	ZYJXIHE120221128	中银基金-羲和 1 号集合资产管理计划	9,817,396	10,000,000.00

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）
销售服务费	中国银行股份有限公司	1,657,436.38
产品托管费	中国银行股份有限公司	85,397.78
现券买入	中国银行股份有限公司	5,162,054.76

八、后市展望及下阶段投资策略

从基本面看，经济正沿着高质量发展的主线运行，短期存在有效需求不足、社会预期偏弱等问题，相应的政策措施陆续推出，财政政策适度加力，地方债务风险有序化解，随着经济增速企稳和增长质量提升，社会预期将逐步改善，股票市场存在估值提升空间。流动性的合理充裕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重点布局扩内需、安全可控和技术变革等相关领域，挖掘市场预期差，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、增强净值稳定性。同时，持续优化固收类资产配置，控制组合久期。

(ESG 优享) 中银理财- (6 个月) 最短持有期混合类理财产品
2023 年年度托管人报告

中银理财有限责任公司：

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对（ESG 优享）中银理财-（6 个月）最短持有期混合类理财产品（以下称“本理财产品”）的托管过程中，严格遵守《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《商业银行理财业务监督管理办法》和托管合同等文本的规定，认真履行了应尽的义务，不存在损害理财产品份额持有人利益的行为。

根据《商业银行理财业务监督管理办法》，本托管人对报告期内本理财产品的 2023 年年度投资运作情况报告进行了复核，复核意见如下：

经复核，净值数据核对无误。

报告期内，本托管人依据理财相关法律法规规定及托管合同对本理财产品的投资运作进行必要监督，报告期内尽职履行理财产品发行人通知及监管报告义务。

中国银行股份有限公司深圳市分行托管业务部

2024 年 02 月 26 日

