

中银理财-专精特新启航打新策略混合类（封闭式）2022
年 12 期
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	ZJTXQH2022012
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) 2022 年 12 期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000205
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	2022-06-01
理财产品到期日	2025-07-02

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
ZJTXQH2022012	61,127,012.00	1.020526	1.020526	62,381,752.04	3.46%

(二) 截至报告期末, 理财产品杠杆水平: 115.58%

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	112.45	1.80%	165.23	2.32%

同业存单	-	0.00%	83.84	1.18%
拆放同业及买入返售	-	0.00%	-	0.00%
债券	-	0.00%	5,556.64	77.90%
非标准化债权类资产	-	0.00%	950.00	13.32%
权益类投资	-	0.00%	255.22	3.58%
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%	122.21	1.71%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	6,131.91	98.20%	-	0.00%
合计	6,244.36	100%	7,133.14	100%

注：报告期末本理财产品持仓金融衍生品 0.31 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	ZJTXQH2022012-20221031-1：宁海县城投集团有限公司	950.00	13.32%
2	CNY：现金及银行存款	165.23	2.32%
3	102383079：23 首旅 MTN006	111.48	1.56%
4	230017：23 付息国债 17	87.90	1.23%
5	2028022：20 民生银行二级	86.67	1.22%
6	240216：23 住总 Y1	86.16	1.21%
7	012382662：23 津城建 SCP042	85.97	1.21%
8	002733：上银慧盈利货币 B	85.90	1.20%
9	012383080：23 青岛财富 SCP002	85.84	1.20%

10	112317255: 23 光大银行 CD255	83.84	1.18%
----	--------------------------	-------	-------

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（专精特新启航打新混合封闭式 2 1 2）
账号	346772350016
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

（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

本产品于 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日期间投资于非标准化债权类资产。根

据产品说明书约定，现将产品投资于非标准化债权类资产的具体信息进行披露，详见附表。

融资客户	项目名称	剩余融资 期限 (天)	到期收益 预计(%)	投资模式/ 交易结构	风险状 况
宁海县城投集团有限公司	宁海县城投集团有限公司信托贷款非标理财项目	432	4.40	信托贷款	正常

注：报告期内到期收益预计是管理人根据底层资产在报告期内的资产情况、收益分配情况及费用进行预估的收益。最终以实际到期收益为准。

(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）
-	-	-	-	-

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	032380472	23 常德城投 PPN007	310	31,918.31
中国银行股份有限公司	032380472	23 常德城投 PPN007	310	31,911.31
中国银行股份有限公司	102002203	20 广州城投 MTN001	6,316	658,518.82
中国银行股份有限公司	102280427	22 江宁经开 MTN001	1,640	167,253.32
中国银行股份有限公司	102281903	22 宿迁城投 MTN003	9,729	968,840.09
中国银行股份有限公司	102382436	23 大唐集 MTN014	310	31,002.81
中国银行股份有限公司	102382520	23 河钢集 MTN013	930	93,010.27

中国银行股份有限公司	102382927	23 中建投资 MTN001	3,651	365,703.80
中国银行股份有限公司	102383020	23 晋能煤业 MTN009	3,790	378,302.21
中国银行股份有限公司	102383229	23 温州交通 MTN003	3,651	365,313.09
中国银行股份有限公司	102383255	23 上海宝冶 MTN001	2,434	243,427.68
中国银行股份有限公司	102383321	23 东南国资 MTN004	3,651	365,139.32
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	2,790	300,392.23
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	280	30,069.84
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	310	33,364.15
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永 续债	1,400	150,599.45
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永 续债 01	1,718	174,534.53
中国银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永 续债	1,550	160,809.23
中国银行股份有限公司	2228038	22 民生银行永 续债 01	21,150	2,029,854.33
中国银行股份有限公司	2371340	23 河北债 62	2,584	258,403.44
中国银行股份有限公司	2371340	23 河北债 62	3,875	387,450.14
中国银行股份有限公司	2371358	23 云南债 38	1,253	125,270.87
中国银行股份有限公司	282380001	23 泰康人寿永 续债 01	3,436	348,558.88
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永 续债 01	6,085	612,130.60
中国银行股份有限公司	282380005	23 太平人寿永 续债 01	1,718	172,565.62
中国银行股份有限公司	282380005	23 太平人寿永 续债 01	1,718	172,604.61
中国银行股份有限公司	282380005	23 太平人寿永 续债 01	1,718	172,595.75
中国银行股份有限公司	809112	23 湖南 140	1,217	121,644.47

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	1,120	114,229.11
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	1,400	143,227.78
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	1,400	142,922.48
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	3,640	372,656.85
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	840	85,704.79
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2028032	20 农业银行永续债 02	1,400	151,017.02
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2028032	20 农业银行永续债 02	840	90,377.25
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2128021	21 工商银行永续债 01	310	32,150.29

中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2128021	21 工商银行永续债 01	4,320	441,486.29
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	1,660	166,012.10
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	4,080	408,028.39
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	2,800	280,049.11
中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司	2128021	21 工商银行永续债 01	2,070	210,986.21
中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司	2128021	21 工商银行永续债 01	6,627	676,675.45
中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司	232380078	23 交行二级资本债 01A	3,463	349,057.81
中银国际亚洲有限公司	00390	港股通	2,264	12,211.40
中银国际亚洲有限公司	00836	港股通	1,098	16,519.68
中银国际亚洲有限公司	00836	港股通	1,509	23,190.24
中银国际亚洲有限公司	00836	港股通	1,861	28,916.86

中银国际亚洲有限公司	01658	港股通	10,650	50,692.49
中银国际亚洲有限公司	01658	港股通	21,145	103,156.45
中银国际亚洲有限公司	01658	港股通	9,823	45,272.00
中银国际证券股份有限公司	002739	万达电影	2,287	28,652.49
中银国际证券股份有限公司	136450	16 油服 02	1,660	172,194.55
中银国际证券股份有限公司	2028022	20 民生银行二级	8,044	808,452.78
中银国际证券股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	560	57,267.04
中银国际证券股份有限公司	282380004	23 农银人寿永续债	2,434	243,496.18
中银国际证券股份有限公司	282380004	23 农银人寿永续债	3,651	365,244.26
中银国际证券股份有限公司	300365	恒华科技	4,370	31,341.67
中银国际证券股份有限公司	600015	华夏银行	2,395	12,788.11
中银国际证券股份有限公司	600015	华夏银行	3,370	17,517.71
中银国际证券股份有限公司	600900	长江电力	239	5,309.63
中银国际证券股份有限公司	600900	长江电力	3,532	79,853.12
中银国际证券股份有限公司	600919	江苏银行	1,032	7,232.53

中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	1,058	7,682.56
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	1,205	8,576.35
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	1,662	12,180.02
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	1,914	13,853.60
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	1,926	13,984.22
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	10,034	77,824.66
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	118	862.03
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	2,042	15,030.74
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	2,935	22,177.07
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	359	2,627.53
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	4,267	30,150.00
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	4,893	36,760.44
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	476	3,365.32
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	499	3,540.01

中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	6,276	45,432.34
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	701	5,124.85
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	954	7,137.17
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	163	16,327.98
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	56	5,470.25
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	389	4,390.81
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	449	5,143.37
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	536	6,037.95
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	728	8,542.71
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	902	10,528.09
中银国际证 券股份有限 公司	601019	山东出版	2,466	21,313.54
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	1,132	33,922.46
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	1,484	43,563.32
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	1,820	51,709.41

中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	108	3,215.84
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	169	5,195.93
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	173	4,930.95
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	212	6,411.78
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	226	6,327.53
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	291	8,276.29
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	318	9,363.12
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	415	12,734.96
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	549	15,216.54
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	627	17,983.82
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	1,602	27,972.62
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	1,740	28,263.46
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	217	3,115.63
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	260	4,221.61

中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	3,219	55,062.59
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	4,047	73,532.63
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	515	7,685.26
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	665	10,711.45
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	837	13,603.43
中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	1,250	22,882.97
中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	1,491	24,238.05
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,015	5,974.82
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,108	6,442.59
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,250	7,674.02
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	2,007	10,469.90
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	3,067	18,822.43
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	3,299	17,095.64
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	378	2,184.31

中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	5,063	32,501.82
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	5,378	31,642.47
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	536	3,027.80
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	6,581	36,761.30
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	664	3,828.74
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	7,282	44,458.58
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	7,957	51,246.07
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	734	4,519.62
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	815	3,856.86
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	904	5,105.57
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	182	1,086.50
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	3,057	18,205.52
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	3,537	21,000.06
中银国际证 券股份有限 公司	601811	新华文轩	631	7,632.52

中银国际证 券股份有限 公司	601811	新华文轩	964	12,035.68
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	1,291	14,501.19
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	129	1,423.88
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	199	2,170.15
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	383	4,273.02
中银国际证 券股份有限 公司	601965	中国汽研	165	3,295.69
中银国际证 券股份有限 公司	601965	中国汽研	233	4,711.85
中银国际证 券股份有限 公司	601965	中国汽研	503	10,358.09
中银国际证 券股份有限 公司	601965	中国汽研	506	10,891.18
中银国际证 券股份有限 公司	601965	中国汽研	540	12,149.46
中银国际证 券股份有限 公司	601965	中国汽研	586	11,990.99
中银国际证 券股份有限 公司	601965	中国汽研	822	18,665.62

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）

-	-	-	-	-
---	---	---	---	---

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	276,601.53
产品托管费	中国银行股份有限公司	12,293.41
现券买入	中国银行股份有限公司	617,008.15

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。

中银理财-专精特新启航打新策略混合类（封闭式）

2022 年 12 期理财产品 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”）在对中银理财-专精特新启航打新策略混合类（封闭式）2022 年 12 期理财产品（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》和托管协议等文本的规定，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。

1、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。

2、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

北京市分行托管业务部

2024 年 2 月 24 日

