

中银理财-专精特新启航打新策略混合类（封闭式）2022
年 16 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	ZJTXQH2022016
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 16 期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000311
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	2022-07-27
理财产品到期日	2025-08-27

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
ZJTXQH2022016	95,282,686.00	1.023607	1.023607	97,532,079.60	5.04%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：111.32%

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	27.54	0.28%	99.00	0.92%

同业存单	-	0.00%	62.25	0.58%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	-	0.00%
债券	-	0.00%	5,168.79	48.07%
非标准化债权类 资产	-	0.00%	4,000.00	37.20%
权益类投资	-	0.00%	1,263.72	11.75%
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%	159.61	1.48%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	9,735.77	99.72%	-	0.00%
合计	9,763.31	100%	10,753.37	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	ZJTXQH2022016-20230729-1: 京东 白条非标理财项目	4,000.00	37.20%
2	230017: 23 付息国债 17	130.07	1.21%
3	360028: 招银优 1	115.54	1.07%
4	102383079: 23 首旅 MTN006	101.40	0.94%
5	CNY: 现金及银行存款	99.00	0.92%
6	232280014: 22 东莞农商行二级资本 债 01	96.47	0.90%
7	360021: 交行优 1	95.68	0.89%
8	133602: 23 岳建 03	94.95	0.88%
9	282380002: 23 太保寿险永续债 01	94.31	0.88%
10	032000921: 20 衡阳城投 PPN004	94.28	0.88%

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	中银理财有限责任公司（专精特新启航打新混合封闭式 2 2 1 6）
账号	325972483557
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
云瀚信息科 技有限公司	云瀚信息科技有限公司 其他债权类资产非标理 财项目	571	4.65	其他债权类 资产	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	1,455	146,050.04
中国银行股份有限公司	102002203	20 广州城投 MTN001	9,347	974,473.06
中国银行股份有限公司	102280427	22 江宁经开 MTN001	2,420	246,800.63
中国银行股份有限公司	102281903	22 宿迁城投 MTN003	7,222	719,186.26
中国银行股份有限公司	102380023	23 南安市贸 MTN001	1,700	172,229.79
中国银行股份有限公司	102380372	23 中交三航 MTN001	2,760	276,083.70
中国银行股份有限公司	102380652	23 珠海华发 MTN001	5,520	552,058.82
中国银行股份有限公司	102381118	23 西安高新 MTN002	808	80,857.49

中国银行股份有限公司	102382927	23 中建投资 MTN001	5,403	541,166.63
中国银行股份有限公司	102383020	23 晋能煤业 MTN009	5,608	559,809.84
中国银行股份有限公司	102383229	23 温州交通 MTN003	5,403	540,588.47
中国银行股份有限公司	102383255	23 上海宝冶 MTN001	3,602	360,223.04
中国银行股份有限公司	102383321	23 东南国资 MTN004	5,403	540,331.32
中国银行股份有限公司	1920091	19 南京银行二 级	660	67,341.05
中国银行股份有限公司	1923001	19 中国人寿	2,640	278,422.06
中国银行股份有限公司	2023002	20 中邮人寿	660	68,953.83
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	1,067	114,111.09
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	1,320	138,429.98
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	1,320	137,717.18
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	660	69,214.99
中国银行股份有限公司	2120118	21 广州银行永 续债	2,910	299,071.46
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永 续债 01	1,940	203,455.67
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永 续债 01	1,275	129,581.53
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永 续债 01	1,940	194,384.89
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永 续债 01	2,910	291,757.87
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永 续债 01	4,850	485,840.57
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永 续债	1,130	118,587.06
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永 续债	660	69,602.28
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永 续债	660	66,161.63
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永 续债	660	66,161.63

中国银行股份有限公司	2228001	22 邮储银行永续债 01	660	65,409.50
中国银行股份有限公司	2228038	22 民生银行永续债 01	15,700	1,506,794.94
中国银行股份有限公司	2371340	23 河北债 62	3,823	382,384.14
中国银行股份有限公司	2371340	23 河北债 62	5,735	573,346.82
中国银行股份有限公司	2371358	23 云南债 38	1,853	185,375.34
中国银行股份有限公司	282380001	23 泰康人寿永续债 01	2,551	258,784.28
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	9,005	905,827.76
中国银行股份有限公司	282380005	23 太平人寿永续债 01	1,275	128,119.73
中国银行股份有限公司	282380005	23 太平人寿永续债 01	1,275	128,148.68
中国银行股份有限公司	282380005	23 太平人寿永续债 01	1,275	128,142.05
中国银行股份有限公司	809112	23 湖南 140	1,801	180,008.88
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2020016	20 江苏银行永续债	2,260	232,855.71
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	2,640	272,655.50
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	2,910	299,261.74
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	3,200	327,026.88

中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2128038	21 农业银行永续债 01	660	66,592.09
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2228011	22 农业银行永续债 01	6,790	693,158.80
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	2,450	245,017.85
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	6,030	603,041.96
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	1,537	156,644.79
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	4,920	502,391.20
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	2,571	259,154.77
中银国际证券股份有限公司	002739	万达电影	3,384	42,399.82
中银国际证券股份有限公司	136450	16 油服 02	2,450	254,142.56
中银国际证券股份有限公司	2028022	20 民生银行二级	5,972	600,227.91

中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	1,320	137,281.06
中银国际证 券股份有限 公司	2120110	21 北京银行永 续债 02	660	66,513.41
中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	3,602	360,324.41
中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	5,403	540,486.61
中银国际证 券股份有限 公司	300365	恒华科技	6,464	46,355.65
中银国际证 券股份有限 公司	600015	华夏银行	3,540	18,900.07
中银国际证 券股份有限 公司	600015	华夏银行	4,982	25,902.25
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	353	7,857.17
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	5,226	118,166.26
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	1,036	7,577.76
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	1,409	10,533.77
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	1,522	10,672.39
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	1,564	11,354.37
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	1,776	12,635.38

中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	10,159	77,927.44
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	14,878	115,395.19
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	175	1,274.63
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	2,452	17,976.53
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	2,824	20,442.51
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	2,842	20,639.36
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	3,014	22,183.92
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	4,332	32,731.22
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	530	3,877.20
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	6,286	44,419.47
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	704	4,973.74
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	738	5,231.93
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	9,276	67,146.32
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	1,372	138,421.75

中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	241	24,131.80
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	444	41,846.52
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	82	8,084.70
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	1,074	12,605.71
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	1,331	15,535.36
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	575	6,489.37
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	663	7,601.60
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	792	8,923.74
中银国际证 券股份有限 公司	601019	山东出版	3,657	31,602.83
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	1,668	49,977.37
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	159	4,746.26
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	2,187	64,181.07
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	2,686	76,302.91
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	251	7,688.92

中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	255	7,287.66
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	314	9,463.17
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	334	9,336.97
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	430	12,231.88
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	469	13,794.52
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	614	18,845.16
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	811	22,453.68
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	927	26,579.03
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	1,233	20,041.70
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	2,376	41,476.64
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	2,563	41,640.06
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	321	4,610.49
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	385	6,247.13
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	4,773	81,644.53

中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	762	11,372.62
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	980	15,780.99
中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	1,844	33,766.33
中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	2,200	35,765.91
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,083	6,670.52
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,207	5,707.37
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,333	7,533.82
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,499	8,830.43
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,638	9,521.77
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,847	11,341.75
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	10,745	65,603.51
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	2,970	15,493.31
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	4,533	27,818.44
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	4,882	25,298.05

中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	559	3,223.83
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	792	4,474.90
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	980	5,650.85
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	269	1,605.79
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	4,518	26,906.68
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	5,228	31,036.85
中银国际证 券股份有限 公司	601811	新华文轩	1,430	17,846.01
中银国际证 券股份有限 公司	601811	新华文轩	935	11,317.19
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	1,073	12,442.33
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	1,909	21,447.87
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	191	2,101.51
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	2,100	22,649.01
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	294	3,202.93
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	566	6,306.57

中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	1,514	8,932.84
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	3,259	22,331.44
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	8,798	53,831.62
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	9,122	45,140.60

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	ZYLCZYZ Q202132	中银证券中国 红-汇中 32 号 集合资产管理 计划	8,334,877	9,000,000.00

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	430,709.53
产品托管费	中国银行股份有限公司	19,142.65
7 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	483,000.00
现券买入	中国银行股份有限公司	411,000.00
非标资产服务费	中国银行股份有限公司	17,315.07

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 16 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 16 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

