

中银理财-专精特新启航打新策略混合类（封闭式）2022
年 17 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	ZJTXQH2022017
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 17 期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000308
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	2022-07-12
理财产品到期日	2025-08-13

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
ZJTXQH2022017	89,608,806.00	1.006087	1.006087	90,154,305.14	1.80%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：111.71%

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	127.43	1.41%	216.51	2.17%

同业存单	-	0.00%	-	0.00%
拆放同业及买入返售	-	0.00%	33.77	0.34%
债券	-	0.00%	5,269.39	52.84%
非标准化债权类资产	-	0.00%	3,680.00	36.90%
权益类投资	-	0.00%	701.29	7.03%
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%	71.59	0.72%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	8,895.98	98.59%	-	0.00%
合计	9,023.42	100%	9,972.56	100%

注：报告期末本理财产品持仓金融衍生品 0.29 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	ZJTXQH2022017-20220727-1：珠海华发集团有限公司	3,680.00	36.90%
2	CNY：现金及银行存款	216.51	2.17%
3	177711：21 启国 01	159.16	1.60%
4	032000519：20 衡阳城投 PPN003	88.44	0.89%
5	032380382：23 常德城投 PPN006	82.17	0.82%
6	032380991：23 岳阳城建 PPN002	80.60	0.81%
7	178761：21 乌开 01	80.03	0.80%
8	196569：21 临开 01	79.98	0.80%
9	178669：21 兴铜 01	79.87	0.80%

10	114915: 21 吉控 01	79.58	0.80%
----	------------------	-------	-------

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 2 1 7）
账号	341572457951
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
珠海华发集团有限公司	珠海华发集团有限公司 信托贷款非标理财项目	191	4.90	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	032380382	23 常德城投 PPN006	4,270	427,446.13
中国银行股份有限公司	032380472	23 常德城投 PPN007	280	28,823.12
中国银行股份有限公司	032380472	23 常德城投 PPN007	280	28,829.44
中国银行股份有限公司	032381012	23 常德城发 PPN001	1,055	105,364.76
中国银行股份有限公司	032381012	23 常德城发 PPN001	1,583	158,258.10
中国银行股份有限公司	102002203	20 广州城投 MTN001	2,676	278,995.61
中国银行股份有限公司	102280239	22 鲁能源 MTN001	1,174	118,271.30
中国银行股份有限公司	102280427	22 江宁经开 MTN001	690	70,368.77

中国银行股份有限公司	102281518	22 水电八局 MTN002(绿色)	1,140	113,677.38
中国银行股份有限公司	102281518	22 水电八局 MTN002(绿色)	528	52,636.96
中国银行股份有限公司	102281518	22 水电八局 MTN002(绿色)	528	52,636.96
中国银行股份有限公司	102281518	22 水电八局 MTN002(绿色)	528	52,637.07
中国银行股份有限公司	102281663	22 联发集 MTN002	2,250	222,570.90
中国银行股份有限公司	102380100	23 华能 MTN001(能源 保供特别债)	940	94,010.12
中国银行股份有限公司	102380843	23 水电八局 MTN001	1,020	102,513.26
中国银行股份有限公司	102381069	23 厦国贸控 MTN001(科创 票据)	2,550	257,801.18
中国银行股份有限公司	102381090	23 水电八局 MTN002	1,800	180,000.00
中国银行股份有限公司	102381217	23 湘建工 MTN001(科创 票据)	2,870	287,440.67
中国银行股份有限公司	102382436	23 大唐集 MTN014	280	28,002.54
中国银行股份有限公司	102382520	23 河钢集 MTN013	840	84,009.27
中国银行股份有限公司	102382927	23 中建投资 MTN001	1,547	154,938.42
中国银行股份有限公司	102383020	23 晋能煤业 MTN009	1,606	160,275.84
中国银行股份有限公司	102383229	23 温州交通 MTN003	1,547	154,772.89
中国银行股份有限公司	102383255	23 上海宝冶 MTN001	1,031	103,133.46
中国银行股份有限公司	102383321	23 东南国资 MTN004	1,547	154,699.26
中国银行股份有限公司	2020082	20 华润银行永 续债	2,850	291,426.47

中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	2,520	271,322.02
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	260	27,921.99
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	280	30,135.36
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	1,300	139,842.34
中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永续债	1,390	141,672.61
中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永续债	1,989	200,207.61
中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永续债	425	43,289.17
中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永续债	980	98,687.44
中国银行股份有限公司	2120064	21 恒丰银行永续债	994	99,245.08
中国银行股份有限公司	2120115	21 厦门国际银行永续债 01	510	50,762.34
中国银行股份有限公司	2120118	21 广州银行永续债	2,250	222,766.42
中国银行股份有限公司	2121026	21 杭州联合农商永续债 01	2,400	241,384.32
中国银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永续债	1,400	145,247.04
中国银行股份有限公司	2220007	22 厦门国际银行永续债 01	1,020	99,697.96
中国银行股份有限公司	2220007	22 厦门国际银行永续债 01	2,550	249,266.58
中国银行股份有限公司	2371340	23 河北债 62	1,095	109,478.25
中国银行股份有限公司	2371340	23 河北债 62	1,642	164,151.69
中国银行股份有限公司	2371358	23 云南债 38	531	53,073.76
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	2,950	295,000.00
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	2,578	259,342.52
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	926	92,637.80
中国银行股份有限公司	809112	23 湖南 140	516	51,537.34

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	1,040	106,069.89
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	1,300	132,713.73
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	1,300	132,997.23
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	3,380	346,038.50
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	780	79,583.02
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	1,300	140,230.09
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	780	83,921.74
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	280	29,038.98

中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2128032	21 兴业银行二级 01	6,260	646,335.47
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2128032	21 兴业银行二级 01	9,390	969,503.21
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	232280003	22 成都银行二级资本债 01	2,400	240,965.28
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	2,250	225,000.00
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	3,600	361,544.40
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	1,710	171,011.90
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	2,600	260,045.61
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	5,100	510,000.00

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	939	93,930.00
中银国际亚 洲有限公司	00390	港股通	1,723	9,292.05
中银国际亚 洲有限公司	00836	港股通	1,148	17,646.22
中银国际亚 洲有限公司	00836	港股通	1,418	22,037.22
中银国际亚 洲有限公司	00836	港股通	835	12,570.37
中银国际亚 洲有限公司	01658	港股通	16,115	78,614.39
中银国际亚 洲有限公司	01658	港股通	7,486	34,501.29
中银国际亚 洲有限公司	01658	港股通	8,116	38,632.19
中银国际证 券股份有限 公司	002739	万达电影	969	12,139.26
中银国际证 券股份有限 公司	110053	苏银转债	30	3,761.38
中银国际证 券股份有限 公司	110053	苏银转债	52	6,386.43
中银国际证 券股份有限 公司	110053	苏银转债	7	861.18
中银国际证 券股份有限 公司	132015	18 中油 EB	3,666	388,993.47
中银国际证 券股份有限 公司	185991	22 新汶 Y1	2,850	286,729.95
中银国际证 券股份有限 公司	185991	22 新汶 Y1	765	76,999.55
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	520	53,176.54

中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	1,031	103,162.48
中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	1,256	125,812.50
中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	1,547	154,743.72
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	600	61,452.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	600	61,452.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	700	71,253.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	700	71,253.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	700	71,253.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	700	71,253.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	700	71,253.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	700	71,253.00
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	1,496	33,831.51
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	101	2,249.54
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	1,791	12,658.40
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	10,209	78,310.37

中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	151	1,105.48
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	2,631	19,041.49
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	200	1,410.47
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	209	1,483.68
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	3,730	28,020.19
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	434	3,042.96
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	443	3,219.90
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	506	3,600.76
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	805	5,828.65
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	1,379	139,152.21
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	23	2,292.68
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	446	42,052.15
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	68	6,843.35
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	163	1,840.27

中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	188	2,155.68
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	225	2,530.61
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	306	3,594.19
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	380	4,429.50
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	122	3,468.74
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	134	3,931.08
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	176	5,395.45
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	231	6,402.08
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	263	7,537.34
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	475	14,242.26
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	623	18,289.94
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	72	2,201.37
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	72	2,066.65
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	766	21,755.79

中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	95	2,662.19
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	110	1,788.58
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	218	3,256.03
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	279	4,497.17
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	3,085	56,049.35
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	351	5,711.36
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	730	11,866.34
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	92	1,320.00
中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	526	9,627.59
中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	627	10,197.72
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,285	7,888.81
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,398	7,242.95
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	225	1,269.00
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	3,064	18,705.13

中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	3,852	24,731.71
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	345	1,634.05
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	380	2,148.07
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	4,092	24,077.80
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	425	2,504.15
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	465	2,700.20
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	5,016	28,020.85
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	524	3,216.32
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	6,064	39,054.07
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	850	4,435.81
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	1,281	7,630.25
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	1,483	8,801.50
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	26,401	173,117.76
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	76	455.37

中银国际证 券股份有限 公司	601800	中国交建	4,407	54,504.84
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	1,078	12,506.63
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	2,111	22,768.53
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	1,004	9,684.36
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	1,346	9,694.82
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	1,751	16,307.99
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	136	1,033.58
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	136	1,020.25
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	150	1,114.28
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	260	2,353.12
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	265	1,959.24
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	267	2,061.74
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	273	1,984.73
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	280	1,909.38

中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	300	2,309.39
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	4,129	39,276.41
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	423	4,023.27
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	60	450.00
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	957	9,309.91
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	1,521	8,976.73
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	3,277	22,449.28
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	8,855	54,175.59
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	9,164	45,348.15

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 HZ5820220 815	中银证券中国 红-汇中 58 号 集合资产管理 计划	3,992,414	4,000,000.00
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	4,101,035	4,400,000.00

中银基金管理有限公司	163807	中银优选混合A	39,669	43,200.00
中银基金管理有限公司	ZYJXIHE 120221128	中银基金-羲和1号集合资产管理计划	12,607,928	12,850,000.00

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	403,542.71
产品托管费	中国银行股份有限公司	17,935.22
现券买入	中银资产管理有限公司	1,113,162.43
现券买入	中国银行股份有限公司	114,321.86
非标资产服务费	中国银行股份有限公司	19,571.12

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 17 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 17 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

