

中银理财-专精特新启航打新策略混合类（封闭式）2022
年 22 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	ZJTXQH2022022
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 22 期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000471
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	2022-10-25
理财产品到期日	2025-12-03

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
ZJTXQH2022022	13,227,840.00	1.035241	1.035241	13,694,012.98	3.01%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：120.14%

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	25.36	1.85%	44.92	2.77%

同业存单	-	0.00%	-	0.00%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	-	0.00%
债券	-	0.00%	1,479.39	91.15%
非标准化债权类 资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	69.10	4.26%
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%	29.64	1.83%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	1,345.38	98.15%	-	0.00%
合计	1,370.74	100%	1,623.05	100%

注：报告期末本理财产品持仓金融衍生品 0.22 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	CNY：现金及银行存款	44.92	2.77%
2	2128016：21 民生银行永续债 01	28.96	1.78%
3	2021044：20 无锡农商永续债	26.20	1.61%
4	102300502：23 晋能电力 MTN013	23.07	1.42%
5	102281495：22 中交二航 MTN001	22.88	1.41%
6	175960：21 首农 Y1	22.85	1.41%
7	133602：23 岳建 03	21.48	1.32%
8	230017：23 付息国债 17	21.47	1.32%
9	282380002：23 太保寿险永续债 01	21.33	1.31%
10	175772：PR 银桥 01	20.54	1.27%

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 2）
账号	324672822001
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

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）
-	-	-	-	-

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	032100573	21 戴姆勒财 PPN004BC	868	88,570.47
中国银行股份有限公司	032380472	23 常德城投 PPN007	240	24,705.53
中国银行股份有限公司	032380472	23 常德城投 PPN007	240	24,710.95
中国银行股份有限公司	032380472	23 常德城投 PPN007	330	33,124.75
中国银行股份有限公司	101901234	19 华电 MTN002B	1,150	121,206.40
中国银行股份有限公司	102002203	20 广州城投 MTN001	1,543	160,890.76
中国银行股份有限公司	102101189	21 豫水利 MTN001(乡村 振兴)	1,150	116,313.66
中国银行股份有限公司	102280427	22 江宁经开 MTN001	400	40,793.49
中国银行股份有限公司	102381118	23 西安高新 MTN002	184	18,413.09
中国银行股份有限公司	102382436	23 大唐集 MTN014	240	24,002.18
中国银行股份有限公司	102382520	23 河钢集 MTN013	720	72,007.95
中国银行股份有限公司	102382927	23 中建投资 MTN001	892	89,349.41
中国银行股份有限公司	102383020	23 晋能煤业 MTN009	926	92,427.63
中国银行股份有限公司	102383229	23 温州交通 MTN003	892	89,253.95

中国银行股份有限公司	102383255	23 上海宝冶 MTN001	595	59,474.69
中国银行股份有限公司	102383321	23 东南国资 MTN004	892	89,211.49
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	2,160	232,561.73
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	210	22,552.38
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	240	25,830.31
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	242	25,880.87
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	1,050	112,949.59
中国银行股份有限公司	2120118	21 广州银行永续债	660	67,830.64
中国银行股份有限公司	2121026	21 杭州联合农商永续债 01	1,150	118,479.17
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永续债 01	440	46,144.58
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	1,100	110,190.65
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	440	44,087.29
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	660	66,171.89
中国银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永续债	1,200	124,497.47
中国银行股份有限公司	2371340	23 河北债 62	631	63,133.63
中国银行股份有限公司	2371340	23 河北债 62	947	94,662.57
中国银行股份有限公司	2371358	23 云南债 38	306	30,606.41
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	1,487	149,556.85
中国银行股份有限公司	600751	海航科技	134	339.45
中国银行股份有限公司	809112	23 湖南 140	297	29,720.40

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	1,050	107,420.84
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	1,050	107,191.86
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	2,730	279,492.64
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	630	64,278.59
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	85,671.83
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	1,050	113,262.76
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	630	67,782.94
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	240	24,890.55

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	660	67,873.80
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	1,540	157,211.27
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	410	41,002.99
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	990	99,006.89
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	2,100	210,036.84
中银国际证券股份有限公司	002739	万达电影	559	7,000.42
中银国际证券股份有限公司	003816	中国广核	28	87.29
中银国际证券股份有限公司	110053	苏银转债	10	1,244.81
中银国际证券股份有限公司	110053	苏银转债	13	1,721.53
中银国际证券股份有限公司	110053	苏银转债	18	2,306.09
中银国际证券股份有限公司	110053	苏银转债	4	575.07

中银国际证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	11	1,125.74
中银国际证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	16	1,593.12
中银国际证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	18	1,808.01
中银国际证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	18	1,816.59
中银国际证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	27	2,711.29
中银国际证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	9	918.34
中银国际证 券股份有限 公司	113055	成银转债	10	1,193.92
中银国际证 券股份有限 公司	113055	成银转债	13	1,619.03
中银国际证 券股份有限 公司	113055	成银转债	13	1,614.50
中银国际证 券股份有限 公司	113055	成银转债	14	1,778.03
中银国际证 券股份有限 公司	113055	成银转债	18	2,124.12
中银国际证 券股份有限 公司	113055	成银转债	22	2,753.43
中银国际证 券股份有限 公司	136450	16 油服 02	410	42,529.98
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	420	42,950.28

中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	595	59,491.42
中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	892	89,237.13
中银国际证 券股份有限 公司	300232	洲明科技	21	177.77
中银国际证 券股份有限 公司	300232	洲明科技	37	311.61
中银国际证 券股份有限 公司	300365	恒华科技	1,073	7,694.66
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	15	300.10
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	28	614.85
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	58	1,297.26
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	863	19,509.87
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	1,042	7,364.89
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	1,523	11,024.02
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	101	727.29
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	116	816.59
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	121	858.97

中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	2,491	19,321.98
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	20	138.43
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	236	1,762.80
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	252	1,764.03
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	257	1,864.15
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	294	2,094.99
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	410	3,008.32
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	467	3,378.93
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	476	3,453.93
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	504	3,712.41
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	60	427.55
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	725	5,477.47
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	88	640.86
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	14	1,327.34

中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	40	3,961.94
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	109	1,248.02
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	130	1,465.09
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	178	2,083.59
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	220	2,567.83
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	94	1,065.42
中银国际证 券股份有限 公司	601019	山东出版	612	5,291.64
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	101	3,111.43
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	13	397.90
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	134	3,711.35
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	152	4,363.72
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	27	794.27
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	276	8,286.40
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	363	10,641.42

中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	41	1,269.48
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	42	1,196.48
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	444	12,612.05
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	52	1,583.63
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	55	1,543.30
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	71	2,008.22
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	78	2,287.17
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	9	272.32
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	126	1,877.68
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	163	2,616.54
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	204	3,322.98
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	398	6,944.93
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	425	6,904.05
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	53	761.22

中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	64	1,031.43
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	799	13,670.71
中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	305	5,581.21
中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	364	5,911.72
中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	4	84.40
中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	6	117.19
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,776	10,843.56
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	130	734.69
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	164	945.65
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	181	1,116.29
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	199	942.32
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	220	1,245.26
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	246	1,449.77
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	269	1,563.28

中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	303	1,862.08
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	490	2,558.03
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	744	4,567.21
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	806	4,176.84
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	93	539.50
中银国际证 券股份有限 公司	601669	中国电建	116	594.14
中银国际证 券股份有限 公司	601669	中国电建	125	744.16
中银国际证 券股份有限 公司	601669	中国电建	19	110.36
中银国际证 券股份有限 公司	601669	中国电建	22	127.38
中银国际证 券股份有限 公司	601669	中国电建	61	317.64
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	16	91.10
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	44	263.64
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	742	4,417.52
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	858	5,095.60

中银国际证 券股份有限 公司	601811	新华文轩	157	1,894.97
中银国际证 券股份有限 公司	601811	新华文轩	239	2,988.17
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	317	3,560.17
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	32	351.68
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	49	536.00
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	95	1,055.39
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	20	116.11

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）
中银基金管 理有限公司	002262	中银宝利 C	92,661	97,850.00

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	60,665.85
产品托管费	中国银行股份有限公司	2,696.27
现券买入	中国银行股份有限公司	48,006.31

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 22 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 22 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