

中银理财-专精特新启航打新策略混合类（封闭式）2022
年 24 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	ZJTXQH2022024
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 24 期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000586
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	2023-01-05
理财产品到期日	2026-02-06

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
ZJTXQH2022024	36,303,902.00	1.014223	1.014223	36,820,266.66	1.42%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：131.17%

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	83.99	2.28%	118.27	2.48%

同业存单	-	0.00%	-	0.00%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	3.12	0.07%
债券	-	0.00%	4,300.18	90.27%
非标准化债权类 资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	283.08	5.94%
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%	59.09	1.24%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	3,601.49	97.72%	-	0.00%
合计	3,685.48	100%	4,763.74	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	118.27	2.48%
2	102381619：23 水利十四 MTN002	47.38	0.99%
3	102380791：23 南投集团 MTN001	41.74	0.88%
4	102103240：21 水利十四 MTN002	41.73	0.88%
5	102280872：22 招商局 MTN001	41.43	0.87%
6	132100133：21 福瑞能源 GN004(碳 中和债)	35.74	0.75%
7	032100981：21 怀柔科学 PPN001	35.69	0.75%
8	102281428：22 中电路桥 MTN001	35.65	0.75%
9	102381657：23 新乡投资 MTN004	35.65	0.75%
10	251870：23 晋信 03	32.16	0.68%

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224）
账号	350649712773
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）
中国银行股份有限公司	1928001	19 中国银行永续债 01	2,600	274,806.18
中国银行股份有限公司	1928001	19 中国银行永续债 01	520	54,958.64

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	032381012	23 常德城发 PPN001	646	64,538.26
中国银行股份有限公司	032381012	23 常德城发 PPN001	969	96,936.60
中国银行股份有限公司	102000518	20 河钢集 MTN004	997	102,167.01
中国银行股份有限公司	102002203	20 广州城投 MTN001	1,062	110,737.21
中国银行股份有限公司	102102121	21 华电股 MTN005	1,700	174,822.28
中国银行股份有限公司	102103103	21 蜀道投资 MTN006	1,360	139,012.11
中国银行股份有限公司	102103240	21 水利十四 MTN002	576	57,955.90
中国银行股份有限公司	102280239	22 鲁能源 MTN001	719	72,443.68
中国银行股份有限公司	102281518	22 水电八局 MTN002(绿色)	323	32,241.31
中国银行股份有限公司	102281518	22 水电八局 MTN002(绿色)	323	32,241.31
中国银行股份有限公司	102281518	22 水电八局 MTN002(绿色)	323	32,241.37
中国银行股份有限公司	102281518	22 水电八局 MTN002(绿色)	760	75,784.92

中国银行股份有限公司	102281663	22 联发集 MTN002	600	59,352.24
中国银行股份有限公司	102300475	23 华能 MTN014	450	45,011.25
中国银行股份有限公司	102380118	23 华电股 MTN001(能源 保供特别债)	2,600	260,026.85
中国银行股份有限公司	102380843	23 水电八局 MTN001	620	62,311.98
中国银行股份有限公司	102381069	23 厦国贸控 MTN001(科创 票据)	1,550	156,702.67
中国银行股份有限公司	102381090	23 水电八局 MTN002	480	48,000.00
中国银行股份有限公司	102381189	23 厦港务 MTN001	1,020	102,028.01
中国银行股份有限公司	102381217	23 湘建工 MTN001(科创 票据)	1,758	176,063.60
中国银行股份有限公司	102381581	23 中核汇能 MTN001A(碳 中和债)	1,800	180,015.20
中国银行股份有限公司	102381619	23 水利十四 MTN002	1,350	135,570.41
中国银行股份有限公司	102381619	23 水利十四 MTN002	1,800	180,047.95
中国银行股份有限公司	102381997	23 中煤集团 MTN002	340	34,002.57
中国银行股份有限公司	102382772	23 陕有色 MTN002	976	97,621.80
中国银行股份有限公司	102382810	23 大唐山西 MTN002	1,480	147,980.62
中国银行股份有限公司	102382904	23 北控集 MTN001	495	49,557.80
中国银行股份有限公司	102382927	23 中建投资 MTN001	614	61,496.93
中国银行股份有限公司	102383020	23 晋能煤业 MTN009	637	63,615.69
中国银行股份有限公司	102383109	23 中电路桥 MTN001	546	54,576.34
中国银行股份有限公司	102383228	23 福建港口 MTN003	1,113	111,305.26
中国银行股份有限公司	102383229	23 温州交通 MTN003	614	61,431.22

中国银行股份有限公司	102383255	23 上海宝冶 MTN001	409	40,934.91
中国银行股份有限公司	102383321	23 东南国资 MTN004	614	61,402.00
中国银行股份有限公司	132100133	21 福瑞能源 GN004(碳中和债)	1,440	149,384.53
中国银行股份有限公司	132380067	23 晋能电力 GN011(碳中和债)	450	44,819.58
中国银行股份有限公司	1920076	19 徽商银行永续债	2,600	265,130.94
中国银行股份有限公司	1920076	19 徽商银行永续债	2,600	265,272.38
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	1,043	110,002.74
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	1,044	110,177.88
中国银行股份有限公司	2020082	20 华润银行永续债	1,900	194,284.31
中国银行股份有限公司	2023002	20 中邮人寿	680	69,315.21
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	110	11,813.15
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	550	59,164.07
中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永续债	1,218	122,631.38
中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永续债	260	26,515.51
中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永续债	600	60,448.22
中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永续债	851	86,777.45
中国银行股份有限公司	2120064	21 恒丰银行永续债	609	60,789.70
中国银行股份有限公司	2120115	21 厦门国际银行永续债 01	310	30,855.54
中国银行股份有限公司	2120118	21 广州银行永续债	600	59,404.38
中国银行股份有限公司	2120118	21 广州银行永续债	680	69,466.29
中国银行股份有限公司	2121026	21 杭州联合农商永续债 01	650	65,374.92

中国银行股份有限公司	2123006	21 交银康联人 寿 01	680	70,362.98
中国银行股份有限公司	2220007	22 厦门国际银 行永续债 01	1,550	151,514.98
中国银行股份有限公司	2220007	22 厦门国际银 行永续债 01	620	60,600.72
中国银行股份有限公司	2371340	23 河北债 62	434	43,453.37
中国银行股份有限公司	2371340	23 河北债 62	652	65,153.98
中国银行股份有限公司	2371358	23 云南债 38	211	21,065.64
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	1,800	180,000.00
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	3,150	315,029.00
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永 续债 01	1,023	102,936.17
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永 续债 01	1,129	112,870.79
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永 续债 01	567	56,742.60
中国银行股份有限公司	809112	23 湖南 140	205	20,455.79
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	1,020	103,890.08
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	2,000	201,931.89
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	1,020	102,986.59
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	1,430	146,400.90

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	2,000	207,025.04
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	330	33,669.74
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	440	44,875.72
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	550	56,148.12
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	550	56,268.06
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	760	78,787.23
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	330	35,505.35
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	550	59,328.11

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	680	71,827.69
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	650	65,261.43
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	600	60,000.00
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	960	96,411.84
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	1,100	110,019.30
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	3,100	310,000.00
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	4,500	450,157.87
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	1,669	166,960.35

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	575	57,534.00
中银国际证 券股份有限 公司	002739	万达电影	385	4,818.24
中银国际证 券股份有限 公司	110053	苏银转债	130	15,966.08
中银国际证 券股份有限 公司	110053	苏银转债	18	2,152.94
中银国际证 券股份有限 公司	185991	22 新汶 Y1	1,900	191,153.30
中银国际证 券股份有限 公司	185991	22 新汶 Y1	390	39,254.67
中银国际证 券股份有限 公司	185991	22 新汶 Y1	465	46,803.64
中银国际证 券股份有限 公司	1928001	19 中国银行永 续债 01	2,600	274,806.18
中银国际证 券股份有限 公司	1928001	19 中国银行永 续债 01	520	54,958.64
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	1,044	106,340.13
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	2,625	267,162.56
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	1,700	179,217.74
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	220	22,497.77
中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	409	40,946.43

中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	614	61,419.65
中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	769	77,062.85
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	40	892.87
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	594	13,428.18
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	202	1,440.30
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	717	5,063.36
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	190	5,696.90
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	249	7,315.98
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	28	873.75
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	53	1,572.43
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	70	2,141.53
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	112	1,798.87
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	141	2,284.55
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	292	4,746.54

中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	36	523.93
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	44	709.91
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	87	1,292.36
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	137	648.57
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	338	1,760.63
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	555	2,874.82
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	1,058	10,058.18
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	1,547	14,930.06
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	2,130	15,335.68
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	2,358	22,942.27
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	212	1,619.28
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	212	1,598.40
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	235	1,745.70
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	4,378	40,769.97

中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	401	3,627.72
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	419	3,230.05
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	419	3,099.22
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	432	3,139.54
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	443	3,020.36
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	470	3,618.04
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	6,366	60,551.13
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	94	705.00

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	164,945.73
产品托管费	中国银行股份有限公司	7,330.91
现券买入	中国银行股份有限公司	114,732.62

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 24 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 24 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

