

中银理财-专精特新启航打新策略混合类（封闭式）2023  
年 01 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	ZJTXQH2023001
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) 2023 年 01 期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000659
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	2023-02-01
理财产品到期日	2026-03-04

### 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
ZJTXQH2023001	129,037,135.00	1.021167	1.021167	131,768,524.86	2.12%

(二) 截至报告期末, 理财产品杠杆水平: 114.19%

### 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	113.25	0.86%	192.75	1.29%

同业存单	-	0.00%	-	0.00%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	9.07	0.06%
债券	-	0.00%	6,834.56	45.80%
非标准化债权类 资产	-	0.00%	6,000.00	40.21%
权益类投资	-	0.00%	1,695.74	11.36%
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%	189.06	1.27%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	13,075.10	99.14%	-	0.00%
合计	13,188.35	100%	14,921.18	100%

注：报告期末本理财产品持仓金融衍生品 0.07 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	ZJTXQH2023001-20230228-1：抖音 月付非标理财项目	6,000.00	40.21%
2	CNY：现金及银行存款	192.75	1.29%
3	00981：中芯国际	179.34	1.20%
4	102381619：23 水利十四 MTN002	102.22	0.69%
5	511990：华宝添益	90.52	0.61%
6	102380791：23 南投集团 MTN001	90.05	0.60%
7	102103240：21 水利十四 MTN002	90.02	0.60%
8	102280872：22 招商局 MTN001	89.39	0.60%
9	132100133：21 福瑞能源 GN004(碳 中和债)	77.10	0.52%

10	032100981：21 怀柔科学 PPN001	77.01	0.52%
----	--------------------------	-------	-------

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-专精特新启航打新混合类（封闭式）2023 年 01 期
账号	318173082715
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
深圳智领星辰科技有限公司	深圳智领星辰科技有限公司其他债权类资产非标理财项目	59	4.45	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	102000518	20 河钢集 MTN004	2,053	210,363.86
中国银行股份有限公司	102102121	21 华电股 MTN005	3,500	359,928.22
中国银行股份有限公司	102103103	21 蜀道投资 MTN006	2,800	286,201.41
中国银行股份有限公司	102103240	21 水利十四 MTN002	1,186	119,332.30
中国银行股份有限公司	102300475	23 华能 MTN014	920	92,023.00
中国银行股份有限公司	102381189	23 厦港务 MTN001	2,100	210,057.66
中国银行股份有限公司	102381581	23 中核汇能 MTN001A(碳中和债)	3,750	375,031.66

中国银行股份有限公司	102381619	23 水利十四 MTN002	2,760	277,166.17
中国银行股份有限公司	102381619	23 水利十四 MTN002	3,750	375,099.90
中国银行股份有限公司	102381997	23 中煤集团 MTN002	710	71,005.37
中国银行股份有限公司	102382772	23 陕有色 MTN002	2,009	201,004.87
中国银行股份有限公司	102382810	23 大唐山西 MTN002	3,047	304,695.12
中国银行股份有限公司	102382904	23 北控集 MTN001	1,020	102,040.46
中国银行股份有限公司	102383109	23 中电路桥 MTN001	1,124	112,373.76
中国银行股份有限公司	102383228	23 福建港口 MTN003	2,291	229,179.46
中国银行股份有限公司	132100133	21 福瑞能源 GN004(碳中和 债)	3,000	311,217.78
中国银行股份有限公司	132380067	23 晋能电力 GN011(碳中和 债)	920	91,631.13
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	2,147	226,497.48
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	2,149	226,858.40
中国银行股份有限公司	2023002	20 中邮人寿	1,400	142,707.79
中国银行股份有限公司	2120118	21 广州银行永 续债	1,400	143,018.84
中国银行股份有限公司	2123006	21 交银康联人 寿 01	1,400	144,864.96
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	6,440	644,059.30
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永 续债 01	2,324	232,402.82
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	2,100	213,891.34

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	3,550	358,429.11
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	1,360	140,987.67
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	2,100	212,031.21
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	3,550	367,469.44
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	1,400	147,880.53
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	9,200	920,322.75
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	3,437	343,774.26
中银国际亚洲有限公司	00390	港股通	15,176	55,959.04
中银国际亚洲有限公司	00390	港股通	15,992	70,325.66
中银国际亚洲有限公司	00390	港股通	16,952	70,379.02
中银国际亚洲有限公司	00836	港股通	8,160	125,704.05

中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	10,382	191,738.68
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	18,216	280,685.26
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	2,880	41,978.74
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	26,460	421,940.53
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	3,774	64,349.74
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	4,766	102,501.00
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	6,888	131,378.60
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	9,282	205,824.75
中银国际亚洲有限公司	01339	港股通	15,288	35,045.90
中银国际亚洲有限公司	01800	港股通	17,608	70,372.97
中银国际亚洲有限公司	01800	港股通	9,920	34,976.45
中银国际亚洲有限公司	01816	港股通	35,032	55,975.41
中银国际亚洲有限公司	01816	港股通	42,312	70,391.76
中银国际亚洲有限公司	03958	港股通	6,595	26,102.92
中银国际亚洲有限公司	03958	港股通	6,653	24,107.02
中银国际亚洲有限公司	06030	港股通	8,984	116,167.41
中银国际证券股份有限公司	110053	苏银转债	174	21,369.98
中银国际证券股份有限公司	110053	苏银转债	24	2,881.63
中银国际证券股份有限公司	1928023	19 农业银行永续债 02	2,149	218,956.40
中银国际证券股份有限公司	1928025	19 交通银行永续债	5,405	550,093.38

中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	3,500	368,977.70
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	2,360	57,992.17
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	2,360	57,992.17
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	2,404	57,994.05
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	4,777	115,987.53
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	4,855	115,996.41
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	3,820	79,989.17
中银国际证 券股份有限 公司	601669	中国电建	10,447	79,998.13
中银国际证 券股份有限 公司	601669	中国电建	34	233.18
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	1,221	9,018.84
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	1,230	9,483.98
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	1,257	9,136.17
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	1,289	8,789.35
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	1,370	10,546.21

中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	1,416	13,462.48
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	2,049	19,772.24
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	276	2,070.00
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	3,178	30,922.19
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	5,860	54,569.03
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	531	4,804.28
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	6,197	44,627.40
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	624	4,754.47
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	624	4,693.17
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	690	5,125.68
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	8,431	80,189.33
中银国际证 券股份有限 公司	688009	中国通号	13,079	77,998.81

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	542,031.24
产品托管费	中国银行股份有限公司	24,090.27
现券买入	中国银行股份有限公司	163,028.37

## 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）

### 2023 年 01 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）2023 年 01 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

