

中银理财-专精特新启航打新策略混合类（封闭式）2023
年 04 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	ZJTXQH2023004
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 04 期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001023000152
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	2023-04-07
理财产品到期日	2026-05-08

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
ZJTXQH2023004	120,623,584.00	1.020697	1.020697	123,120,205.15	2.07%

(二) 截至报告期末, 理财产品杠杆水平: 115.19%

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	7.23	0.06%	210.80	1.51%

同业存单	-	0.00%	-	0.00%
拆放同业及买入返售	-	0.00%	280.19	2.00%
债券	-	0.00%	12,721.73	91.03%
非标准化债权类资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	533.76	3.82%
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%	228.14	1.63%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	12,317.01	99.94%	-	0.00%
合计	12,324.24	100%	13,974.62	100%

注：报告期末本理财产品持仓金融衍生品 1.36 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	082100802：21 光穗华电 ABN002 优先(碳中和债)	627.88	4.49%
2	2128016：21 民生银行永续债 01	424.22	3.04%
3	189323：生物 R1 优	266.46	1.91%
4	102101443：21 国药租赁 MTN001	261.88	1.87%
5	193256：明远 03A3	260.76	1.87%
6	092100012：21 长城资本债 01BC	258.70	1.85%
7	032100158：21 首开 PPN001	230.09	1.65%
8	2228038：22 民生银行永续债 01	211.27	1.51%
9	CNY：现金及银行存款	210.80	1.51%

10	102101896: 21 锡产业 MTN003	209.92	1.50%
----	--------------------------	--------	-------

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04期
账号	320773369324
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	012283965	22 韵达股份 SCP004	5,390	552,215.27
中国银行股份有限公司	012383098	23 金风科技 SCP001(科创票据)	2,695	269,550.59
中国银行股份有限公司	032100270	21 常德城投 PPN003	4,239	440,493.42
中国银行股份有限公司	032380472	23 常德城投 PPN007	1,905	191,220.15
中国银行股份有限公司	101901234	19 华电 MTN002B	6,650	700,889.19
中国银行股份有限公司	102002203	20 广州城投 MTN001	3,086	321,689.78
中国银行股份有限公司	102101189	21 豫水利 MTN001(乡村振兴)	6,650	672,596.41
中国银行股份有限公司	102280427	22 江宁经开 MTN001	800	81,586.99
中国银行股份有限公司	102300441	23 华能 MTN013	10,780	1,078,081.00
中国银行股份有限公司	102381118	23 西安高新 MTN002	1,064	106,475.70
中国银行股份有限公司	102382927	23 中建投资 MTN001	1,784	178,648.03
中国银行股份有限公司	102383020	23 晋能煤业 MTN009	1,851	184,802.55
中国银行股份有限公司	102383229	23 温州交通 MTN003	1,784	178,457.17

中国银行股份有限公司	102383255	23 上海宝冶 MTN001	1,189	118,915.57
中国银行股份有限公司	102383321	23 东南国资 MTN004	1,784	178,372.28
中国银行股份有限公司	198227	23 四川债 27	4,785	478,669.56
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	1,230	132,092.50
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	1,397	149,403.18
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	6,150	661,561.86
中国银行股份有限公司	2120118	21 广州银行永续债	3,810	391,567.78
中国银行股份有限公司	2121026	21 杭州联合农商永续债 01	6,650	685,118.65
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永续债 01	2,540	266,380.10
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	2,540	254,503.92
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	3,810	381,992.26
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	6,350	636,100.54
中国银行股份有限公司	2228032	22 建设银行绿色金融债 01	6,360	640,249.23
中国银行股份有限公司	2228061	22 交通银行小微债 02	13,040	1,342,440.96
中国银行股份有限公司	2305390	23 江西债 35	1,560	156,027.80
中国银行股份有限公司	2328006	23 交通银行小微债 01	12,720	1,288,994.97
中国银行股份有限公司	2328006	23 交通银行小微债 01	15,600	1,560,574.15
中国银行股份有限公司	2328007	23 浦发银行绿色金融债 01	15,600	1,559,978.24
中国银行股份有限公司	2328007	23 浦发银行绿色金融债 01	15,950	1,601,538.30
中国银行股份有限公司	2328007	23 浦发银行绿色金融债 01	6,240	624,274.50
中国银行股份有限公司	2371340	23 河北债 62	1,262	126,231.46
中国银行股份有限公司	2371340	23 河北债 62	1,893	189,271.46

中国银行股份有限公司	2371358	23 云南债 38	612	61,195.53
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	2,973	299,028.69
中国银行股份有限公司	809112	23 湖南 140	595	59,423.90
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	15,990	1,637,028.29
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	3,690	376,488.91
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	4,920	501,792.16
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	6,150	627,838.02
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	6,150	629,179.19
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	3,690	397,014.36
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	6,150	663,396.19

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	3,810	391,816.92
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	8,890	907,537.81
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	810	81,005.90
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	1,980	198,013.78
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	12,300	1,230,215.75
中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	4,239	433,914.52
中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	8,477	867,829.04
中银国际亚洲有限公司	00728	港股通	5,803	21,839.84
中银国际亚洲有限公司	00728	港股通	893	3,137.18
中银国际亚洲有限公司	01024	港股通	27	1,465.60
中银国际亚洲有限公司	01024	港股通	293	17,971.42

中银国际亚洲有限公司	01024	港股通	293	17,971.42
中银国际亚洲有限公司	01024	港股通	33	1,824.11
中银国际亚洲有限公司	01024	港股通	34	1,593.02
中银国际亚洲有限公司	01024	港股通	44	2,358.86
中银国际亚洲有限公司	01658	港股通	1,723	8,333.68
中银国际亚洲有限公司	01658	港股通	319	1,409.93
中银国际亚洲有限公司	01658	港股通	383	1,767.40
中银国际亚洲有限公司	01658	港股通	861	3,865.17
中银国际亚洲有限公司	01810	港股通	7	6,888.07
中银国际亚洲有限公司	01898	港股通	1,373	8,159.94
中银国际亚洲有限公司	01898	港股通	406	2,336.81
中银国际亚洲有限公司	01898	港股通	798	4,270.19
中银国际亚洲有限公司	01898	港股通	893	5,258.61
中银国际亚洲有限公司	02099	港股通	51	1,445.70
中银国际亚洲有限公司	02099	港股通	654	18,113.84
中银国际亚洲有限公司	02357	港股通	1,180	4,247.02
中银国际亚洲有限公司	02357	港股通	766	2,831.49
中银国际亚洲有限公司	02869	港股通	3,325	12,035.43
中银国际证券股份有限公司	002739	万达电影	1,117	13,996.89
中银国际证券股份有限公司	136450	16 油服 02	810	84,022.64

中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	4,239	432,852.82
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	2,460	251,565.92
中银国际证 券股份有限 公司	212380003	23 华夏银行债 01	15,950	1,601,244.64
中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	1,189	118,949.03
中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	1,784	178,423.55
中银国际证 券股份有限 公司	300232	洲明科技	1,356	12,745.05
中银国际证 券股份有限 公司	300232	洲明科技	201	1,869.17
中银国际证 券股份有限 公司	300232	洲明科技	233	2,133.26
中银国际证 券股份有限 公司	300365	恒华科技	2,146	15,389.33
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	131	2,854.06
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	202	4,827.01
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	407	9,740.02
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	437	9,519.26
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	463	10,192.88

中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	577	12,703.58
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	92	1,996.91
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	1,725	39,008.67
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	117	2,593.78
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	134	3,004.87
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	147	3,221.79
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	72	1,564.31
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	747	16,290.75
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	75	1,652.60
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	92	2,054.75
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	1,432	10,821.34
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	175	1,281.72
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	2,084	14,729.77
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	2,084	15,590.74

中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	231	1,633.17
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	242	1,717.95
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	3,046	22,048.05
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	4,913	38,107.25
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	466	3,482.59
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	503	3,528.06
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	513	3,728.30
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	589	4,189.97
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	811	5,943.26
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	934	6,757.86
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	940	6,823.63
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	996	7,334.27
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	27	2,654.68
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	30	2,884.62

中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	79	7,923.87
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	189	2,130.84
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	218	2,496.05
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	260	2,930.18
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	355	4,167.18
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	440	5,135.66
中银国际证 券股份有限 公司	601019	山东出版	1,208	10,436.28
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	104	3,128.64
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	110	3,086.60
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	141	4,016.44
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	156	4,574.35
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	203	6,221.10
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	268	7,422.70
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	304	8,727.44

中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	53	1,569.17
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	553	16,572.81
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	725	21,282.84
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	83	2,538.24
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	84	2,392.96
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	888	25,224.10
中银国际证 券股份有限 公司	601098	中南传媒	1,151	13,016.15
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	1,576	26,961.68
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	106	1,522.00
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	127	2,062.28
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	251	3,754.29
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	325	5,233.08
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	409	6,645.95
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	785	13,696.94

中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	850	13,808.10
中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	610	11,162.42
中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	727	11,823.44
中银国际证 券股份有限 公司	601390	中国中铁	1,279	9,351.69
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,488	9,134.41
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,501	9,350.22
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,612	8,351.31
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,713	10,916.87
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	185	1,065.84
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	207	1,258.71
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	246	1,589.35
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	256	1,608.99
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	260	1,469.37
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	3,552	21,687.11

中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	324	1,868.24
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	358	2,205.35
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	398	1,884.10
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	441	2,490.52
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	492	2,899.55
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	538	3,126.55
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	607	3,724.16
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	980	5,114.60
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	1,484	8,835.03
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	1,717	10,191.21
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	88	527.27
中银国际证 券股份有限 公司	601800	中国交建	168	2,054.74
中银国际证 券股份有限 公司	601800	中国交建	842	9,341.82
中银国际证 券股份有限 公司	601811	新华文轩	309	3,737.31

中银国际证 券股份有限 公司	601811	新华文轩	472	5,893.33
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	187	2,085.03
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	63	694.79
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	634	7,120.35
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	97	1,058.93
中银国际证 券股份有限 公司	601991	大唐发电	3,959	12,472.72
中银国际证 券股份有限 公司	601991	大唐发电	525	1,742.14
中银国际证 券股份有限 公司	601991	大唐发电	970	3,181.06
中银国际证 券股份有限 公司	601995	中金公司	297	12,757.38
中银国际证 券股份有限 公司	601995	中金公司	88	3,503.99

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	404,478.10
产品托管费	中国银行股份有限公司	17,976.80

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 04 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 04 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

