

中银理财-专精特新启航打新策略混合类（封闭式）2023
年 05 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	ZJTXQH2023005
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 05 期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001023000246
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	2023-04-19
理财产品到期日	2025-05-21

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
ZJTXQH2023005	79,055,812.00	1.013353	1.013353	80,111,477.23	1.34%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：122.71%

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	76.15	0.95%	179.68	1.85%

同业存单	-	0.00%	-	0.00%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	1.15	0.01%
债券	-	0.00%	8,082.11	83.41%
非标准化债权类 资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	1,240.21	12.80%
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%	186.38	1.92%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	7,942.76	99.05%	-	0.00%
合计	8,018.91	100%	9,689.54	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	082280909：22 周大福 ABN001(绿色)优先	202.16	2.09%
2	CNY：现金及银行存款	179.68	1.85%
3	360028：招银优 1	140.35	1.45%
4	188542：21 首农 Y2	121.93	1.26%
5	102101346：21 厦钨 MTN001	121.70	1.26%
6	360021：交行优 1	116.22	1.20%
7	360018：北银优 1	110.36	1.14%
8	360030：建行优 1	108.04	1.12%
9	2020002：20 杭州银行永续债	104.20	1.08%
10	102103111：21 重庆临空 MTN002	101.69	1.05%

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05期
账号	328573421273
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	042380292	23 广西金控 CP001	750	75,011.07
中国银行股份有限公司	082380191	23 新能源 4ABN002 优先(碳中和债)	750	75,005.14
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	1,620	167,625.94
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	2,360	240,699.23
中国银行股份有限公司	102000518	20 河钢集 MTN004	506	51,829.70
中国银行股份有限公司	102002001	20 中建三局 MTN002	2,240	232,677.54
中国银行股份有限公司	102101617	21 陕延油 MTN003	2,100	219,437.82
中国银行股份有限公司	102103240	21 水利十四 MTN002	292	29,401.24
中国银行股份有限公司	102281110	22 福瑞能源 MTN001	1,120	113,281.73
中国银行股份有限公司	102300441	23 华能 MTN013	1,120	111,973.68
中国银行股份有限公司	102300475	23 华能 MTN014	230	23,005.75
中国银行股份有限公司	102300486	23 华能 MTN015	610	61,005.12
中国银行股份有限公司	102300571	23 金辉集团 MTN002	202	20,220.46
中国银行股份有限公司	102380277	23 华能 MTN004(能源保供特别债)	700	71,877.61

中国银行股份有限公司	102380454	23 华能 MTN007(能源 保供特别债)	1,400	143,457.72
中国银行股份有限公司	102380488	23 中冶 MTN006	1,120	114,569.84
中国银行股份有限公司	102380596	23 华电股 MTN003(能源 保供特别债)	560	57,129.07
中国银行股份有限公司	102381150	23 碧桂园 MTN002	75	7,500.81
中国银行股份有限公司	102381152	23 碧桂园 MTN001	75	7,500.78
中国银行股份有限公司	102381341	23 首农食品 MTN002	1,480	148,038.70
中国银行股份有限公司	102381619	23 水利十四 MTN002	690	69,291.54
中国银行股份有限公司	102381997	23 中煤集团 MTN002	170	17,001.29
中国银行股份有限公司	102382772	23 陕有色 MTN002	495	49,523.81
中国银行股份有限公司	102382810	23 大唐山西 MTN002	751	75,070.87
中国银行股份有限公司	102382904	23 北控集 MTN001	251	25,140.79
中国银行股份有限公司	102383109	23 中电路桥 MTN001	277	27,686.71
中国银行股份有限公司	102383228	23 福建港口 MTN003	565	56,465.35
中国银行股份有限公司	102383376	23 本钢集团 MTN002(科创 票据)	2,022	202,200.33
中国银行股份有限公司	132380060	23 三峡 GN001	560	56,004.42
中国银行股份有限公司	132380065	23 华能水电 GN015	610	61,005.67
中国银行股份有限公司	132380067	23 晋能电力 GN011(碳中和 债)	230	22,907.78
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	1,680	178,062.70
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	529	55,804.67
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	530	55,893.62

中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	2,800	293,438.04
中国银行股份有限公司	198234	23 四川债 34	2,410	241,085.31
中国银行股份有限公司	2023001	20 人民财险	700	71,597.12
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	1,220	124,957.28
中国银行股份有限公司	2023021	20 中邮人寿 02	1,680	177,923.93
中国银行股份有限公司	2028024	20 中信银行二级	1,770	180,777.71
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永续债	3,540	369,083.59
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永续债	756	79,547.81
中国银行股份有限公司	2128025	21 建设银行二级 01	1,770	179,781.02
中国银行股份有限公司	2128025	21 建设银行二级 01	1,770	179,781.02
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	1,180	121,677.59
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	3,024	307,707.16
中国银行股份有限公司	2228001	22 邮储银行永续债 01	2,360	240,804.25
中国银行股份有限公司	2305401	23 浙江债 28	1,205	120,500.00
中国银行股份有限公司	2305424	23 河北债 24	2,410	241,150.62
中国银行股份有限公司	2305554	23 安徽债 62	2,360	235,892.15
中国银行股份有限公司	2320031	23 华润银行小微债 01	820	82,006.07
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	1,610	161,014.82
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	4,270	427,039.28
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	5,040	504,046.41
中国银行股份有限公司	272380014	23 东方二级资本债 01BC	6,300	630,068.85
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	573	57,259.68

中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	732	73,188.13
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	092280065	22 工行二级资本债 03A	1,770	176,373.07
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	092280065	22 工行二级资本债 03A	1,770	176,299.26
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	2,360	240,170.12
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	092280134	22 工行二级资本债 04A	1,770	180,112.19
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2020016	20 江苏银行永续债	1,220	125,630.60
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2020016	20 江苏银行永续债	1,220	125,427.35
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2020016	20 江苏银行永续债	1,680	172,942.39
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2020016	20 江苏银行永续债	2,135	219,519.21

中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2020016	20 江苏银行永续债	610	62,797.98
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	3,050	313,366.46
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	2,240	241,616.03
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	1,220	125,947.43
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	610	63,000.50
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2128042	21 兴业银行二级 02	2,440	254,534.46
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2128044	21 工商银行永续债 02	2,360	244,024.24
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	2,360	240,345.47

中国银行股份有限公司, 中银国际证 券股份有限 公司	2228017	22 邮储银行二 级 01	3,540	361,644.98
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	2,300	230,080.69
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	5,600	560,049.28
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	1,288	133,226.20
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	1,288	133,064.33
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2128051	21 工商银行二 级 02	3,219	332,999.83
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	1,758	175,865.23
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	847	84,699.27
中银国际证 券股份有限 公司	115072	23 联发 01	1,400	142,958.99

中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	530	53,946.71
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	1,332	135,532.15
中银国际证 券股份有限 公司	2228014	22 交通银行二 级 01	1,288	132,239.16
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	494	8,477.04
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	155	1,146.20
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	18	135.00
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	41	310.07
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	41	306.08
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	45	334.28
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	78	563.62
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	788	5,671.67
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	80	618.52
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	80	542.23
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	80	615.84

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	ZYLCZYZ Q202132	中银证券中国红-汇中 32 号集合资产管理计划	10,124,252	11,000,000.00
中银国际证券股份有限公司	ZYLCZYZ QHZ55202 20302	中银证券中国红-汇中 55 号集合资产管理计划	19,374,213	20,000,000.00

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	252,002.56
产品托管费	中国银行股份有限公司	11,200.12
14 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	924,600.00
1 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	369,966.89
28 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	530,700.00
4 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	1,036,619.43
7 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	2,227,606.86
现券买入	中国银行股份有限公司	1,130,548.04

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 05 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 05 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

