

中银理财-ESG 优享固收（封闭式）2023 年 09 期  
2024 年半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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

### 一、理财产品基本情况

|                   |                              |
|-------------------|------------------------------|
| 理财产品代码            | ESGYXGS202309                |
| 理财产品名称            | 中银理财-ESG 优享固收（封闭式）2023年 09 期 |
| 全国银行业理财信息登记系统登记编码 | Z7001023000567               |
| 产品类型              | 固定收益类产品                      |
| 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              | 02 二级(中低)                    |
| 理财产品成立日           | 2023-11-08                   |
| 理财产品到期日           | 2024-12-25                   |

### 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<br>份额代码  | 理财产品<br>总份额    | 理财产品<br>份额净值 | 理财产品<br>份额累计净值 | 理财产品<br>资产净值   | 较上一报告期<br>份额净值<br>增长率 |
|---------------|----------------|--------------|----------------|----------------|-----------------------|
| ESGYXGS202309 | 154,187,046.44 | 1.021977     | 1.021977       | 157,575,654.40 | 1.69%                 |

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：100.63%

### 三、理财产品持仓情况

| 资产类别    | 穿透前金额<br>(万元) | 占全部产品总资<br>产的比例 | 穿透后金额<br>(万元) | 占全部产品总资<br>产的比例 |
|---------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|
| 现金及银行存款 | 7.93          | 0.05%           | 257.35        | 1.65%           |

|           |           |        |           |        |
|-----------|-----------|--------|-----------|--------|
| 同业存单      | -         | 0.00%  | -         | 0.00%  |
| 拆放同业及买入返售 | -         | 0.00%  | 377.92    | 2.42%  |
| 债券        | -         | 0.00%  | 14,979.19 | 95.93% |
| 非标准化债权类资产 | -         | 0.00%  | -         | 0.00%  |
| 权益类投资     | -         | 0.00%  | -         | 0.00%  |
| 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%  | -         | 0.00%  |
| 私募基金      | -         | 0.00%  | -         | 0.00%  |
| 资产管理产品    | 15,756.80 | 99.95% | -         | 0.00%  |
| 合计        | 15,764.73 | 100%   | 15,614.47 | 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  | 194091：22 港城 01                | 403.27 | 2.58% |
| 2  | 177823：21 绍城 01                | 378.81 | 2.43% |
| 3  | 194925：22 汇成 01                | 374.97 | 2.40% |
| 4  | 166941：20 济轨 02                | 369.47 | 2.37% |
| 5  | 194137：22 泰交 02                | 368.89 | 2.36% |
| 6  | WKXD32W20240628R0011：3 日质押式逆回购 | 366.43 | 2.35% |
| 7  | 112130：沪建 02 优                 | 360.91 | 2.31% |
| 8  | 196710：21 保控 02                | 297.28 | 1.90% |
| 9  | 162645：19 中金 C5                | 262.85 | 1.68% |
| 10 | 114813：23 宿迁 01                | 259.02 | 1.66% |

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-ESG 优享固收（封闭式）2023 年 09 期 |
| 账号  | 350648714715                  |
| 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

报告期内，产品管理人通过合理安排资产配置结构，保持一定比例的高流动性资产，控制资产久期、杠杆融资比例，努力管控产品流动性风险。

## 七、本运作期主要操作回顾

### （一）主要投资策略及操作

报告期内，债券市场方面，资产价格整体震荡上涨，其中，信用债表现较强，利率债受多重因素博弈影响表现有所起伏。在产品投资上，积极参与债券市场的一级投资，提升产品的持仓收益率，同时在二级市场紧盯调整机会进行利率债、高评级信用债的波段交易，力争提升产品的净值表现。

### （二）非标资产投资情况

无

### （三）关联交易情况

本产品于 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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）  |
| 中银国际证券股份有限公司 | 148793 | 24 蜀道 Y4 | 288      | 28,832.10  |
| 中银国际证券股份有限公司 | 253444 | 24 岷交 D1 | 3,192    | 319,228.54 |

本产品于 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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   | 116,846.03 |
| 产品托管费 | 中国银行股份有限公司   | 15,579.47  |
| 分销买入  | 中银国际证券股份有限公司 | 319,228.54 |

## 八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市，考虑到当前经济复苏斜率较缓、政府债发行或将提速，三季度可能进入降准降息政策窗口期，市场或围绕政策预期进行博弈，叠加跨季后资金面较为宽松、机构仍有配置需求，债市收益率下行动力仍在，但节奏上需更加关注央行操作。本产品仍将在控制风险敞口的前提下积极参与债券市场投资，关注利率债、资质较优信用债的交投机会，适当拉长投资期限。

## 中银理财-ESG 优享固收（封闭式）2023 年 09 期

### 理财产品 2024 年半年度托管人报告

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-ESG 优享固收（封闭式）2023 年 09 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 2024 年半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 8 月 6 日

