

中银理财-新能源优享混合类（封闭式）2021 年 02 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	XNYYX202102
理财产品名称	中银理财-新能源优享混合类（封闭式） 2021年02期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001021000579
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	2021-10-22
理财产品到期日	2024-11-22

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
XNYYX202102	250,477,947.00	1.022570	1.022570	256,131,399.41	0.27%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：106.34%

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	23.14	0.09%	467.76	1.74%

同业存单	-	0.00%	113.46	0.42%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	-	0.00%
债券	-	0.00%	18,888.70	70.11%
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%	7,471.34	27.73%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	25,605.16	99.91%	-	0.00%
合计	25,628.30	100%	26,941.26	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	188965：21 浙金控	1,067.62	3.96%
2	210203：21 国开 03	778.70	2.89%
3	115346：23 华泰 G8	766.46	2.84%
4	2226006：22 汇丰银行 02	766.00	2.84%
5	240632：24 中金 G1	764.26	2.84%
6	149709：21 国信 12	763.42	2.83%
7	188961：21 国药 03	763.19	2.83%
8	188495：21 紫金 03	760.91	2.82%
9	000191：富国信用债债券 A/B	737.32	2.74%
10	000390：华商优势行业混合	720.06	2.67%

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（新能源优享混合类封闭式202102）
账号	335071797528
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，合理安排固收类资产期限结构，严格控制信用风险，将票息收入和资本利得作为组合重要的基础收益来源。操作上，主要持有高等级信用债，动态调整组合久期。

（2）权益部分：

运作期内，在控制权益敞口的基础上，积极把握市场的趋势性机会和结构性机会，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，在做好风险控制的基础上把握市场的趋势性机会；另一方面，持续优化权益资产结构，挖掘市场主线，积极把握市场热点机会。

（二）非标资产投资情况

无

（三）关联交易情况

本产品于 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）
中国银行股份有限公司	032380924	23 常德城投 PPN008	2,052	216,183.34
中国银行股份有限公司	032380991	23 岳阳城建 PPN002	1,018	105,640.06
中国银行股份有限公司	032381012	23 常德城发 PPN001	2,010	209,504.55
中国银行股份有限公司	032381012	23 常德城发 PPN001	2,012	209,849.69
中国银行股份有限公司	032381012	23 常德城发 PPN001	2,170	228,529.34
中国银行股份有限公司	032480420	24 郑州发展 PPN003	1,125	114,264.38
中国银行股份有限公司	102381241	23 新创建 MTN001BC	13,231	1,330,327.83
中国银行股份有限公司	102480996	24 苏国资 MTN004	1,006	100,651.01
中国银行股份有限公司	102481167	24 鲁高速 MTN003	3,015	301,565.76
中国银行股份有限公司	102481194	24 温州交通 MTN001	3,018	301,783.78
中国银行股份有限公司	102481215	24 保利发展 MTN003	1,012	101,230.16
中国银行股份有限公司	102481759	24 云建投 MTN009	15,526	1,552,948.97
中国银行股份有限公司	102482140	24 宁河西 MTN002	2,222	222,859.21
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永续债 01	662	71,074.96
中国银行股份有限公司	242300001	23 宁波银行永续债 01	1,988	208,893.41
中国银行股份有限公司	242300001	23 宁波银行永续债 01	2,059	215,993.32

中国银行股份有限公司	242300001	23 宁波银行永续债 01	3,976	418,142.42
中国银行股份有限公司	242300001	23 宁波银行永续债 01	994	104,577.16
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	4,538	453,801.96
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	1,026	106,672.08
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	1,053	110,099.99
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	2,052	213,346.21
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	3,018	312,981.53
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	190311	19 进出 11	64,059	6,569,324.57
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	1,322	137,982.45
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	1,983	205,344.02
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	661	68,417.19
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	2,010	212,999.71
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242400008	24 江苏银行永续债 01	1,115	111,895.26

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242400008	24 江苏银行永续债 01	1,115	111,876.09
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242400008	24 江苏银行永续债 01	2,269	228,123.40
中银国际证券股份有限公司	113052	兴业转债	1,281	137,848.61
中银国际证券股份有限公司	113052	兴业转债	105	10,863.93
中银国际证券股份有限公司	113052	兴业转债	105	10,831.82
中银国际证券股份有限公司	113052	兴业转债	156	16,496.34
中银国际证券股份有限公司	113052	兴业转债	209	21,671.10
中银国际证券股份有限公司	113052	兴业转债	209	21,673.27
中银国际证券股份有限公司	113052	兴业转债	418	43,456.43
中银国际证券股份有限公司	113052	兴业转债	468	49,612.14
中银国际证券股份有限公司	113052	兴业转债	624	66,035.28
中银国际证券股份有限公司	113052	兴业转债	780	82,626.97
中银国际证券股份有限公司	113052	兴业转债	780	82,698.94

中银国际证 券股份有限 公司	113055	成银转债	118	13,444.81
中银国际证 券股份有限 公司	113055	成银转债	62	7,128.65
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	1,322	137,541.17
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	1,322	137,454.87
中银国际证 券股份有限 公司	240112	23BEHL02	684	69,380.49
中银国际证 券股份有限 公司	240112	23BEHL02	688	69,828.33
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	1,134	113,465.28
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	2,269	227,554.90
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	2,297	230,842.84
中银国际证 券股份有限 公司	272380004	23 农银人寿资 本补充债 01	2,059	219,957.47
中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	1,006	103,762.22
中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	1,044	108,596.99
中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	3,019	311,283.63

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	资产管理产品	报告期内买入资产管理产品
-------	------	--------	--------------

	产品代码	简称	数量（单位：份）	总金额（单位：元）
中银基金管理有限公司	ZYJXIH 120221128	中银基金-羲和1号集合资产管理计划	10,637,269	11,000,000.00
中银基金管理有限公司	ZYJXIH 120221128	中银基金-羲和1号集合资产管理计划	2,429,543	2,500,000.00
中银基金管理有限公司	ZYJXIH 120221128	中银基金-羲和1号集合资产管理计划	22,338,772	23,000,000.00
中银基金管理有限公司	ZYJXIH 120221128	中银基金-羲和1号集合资产管理计划	26,662,788	27,500,000.00

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	572,328.71
产品托管费	中国银行股份有限公司	25,436.83

八、后市展望及下阶段投资策略

经济维持平稳运行，政策重在培育新质生产力、推动经济高质量发展。资本市场制度性建设立足长远，持续推进，长期健康发展可期。体现在当前股票市场上，呈现明显的结构性特征，行业表现差异较大。通胀持续低位运行，有利于债券市场的稳健表现。市场格局的改变取决于宏观政策的方向、力度以及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，并沿着国家政策引导的方向布局权益资产，重点配置符合理财资金特点的稳健类资产，适度加大新质生产力相关领域的投资力度，深入研究行业动向，寻求阶段性投资机会。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，根据产品情况调整组合久期。

中银理财-新能源优享混合类（封闭式）2021年02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-新能源优享混合类（封闭式）2021年02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

