

中银理财-专精特新启航打新策略混合类（封闭式）2023
年 12 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	ZJTXQH2023012
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 12 期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001023000442
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	2023-09-19
理财产品到期日	2025-10-17

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
ZJTXQH2023012	12,582,565.14	1.034594	1.034594	13,017,852.86	2.20%

(二) 截至报告期末, 理财产品杠杆水平: 112.73%

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	57.00	4.38%	97.69	6.73%

同业存单	-	0.00%	40.42	2.79%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	31.86	2.20%
债券	-	0.00%	1,076.77	74.22%
非标准化债权类 资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	76.56	5.28%
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%	127.52	8.79%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	1,245.84	95.62%	-	0.00%
合计	1,302.85	100%	1,450.83	100%

注：报告期末本理财产品持仓金融衍生品 0.02 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	CNY：现金及银行存款	97.69	6.73%
2	ZQZYLCZ20240628GC001-1：交易所逆回购	27.98	1.93%
3	242400011：24 广发银行永续债 01	25.50	1.76%
4	312400001：24 工行 TLAC 非资本债 01A	21.60	1.49%
5	242480004：24 华夏银行永续债 01	21.26	1.47%
6	112408187：24 中信银行 CD187	21.11	1.45%
7	232480014：24 交行二级资本债 01A	17.40	1.20%
8	002881：中加丰润纯债债券 A	13.15	0.91%
9	102383079：23 首旅 MTN006	12.90	0.89%

10	240335: 23 招证 11	10.95	0.75%
----	------------------	-------	-------

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 12 期
账号	350647105704
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	092280083	22 建行永续债 01	1,145	117,469.16
中国银行股份有限公司	102381660	23 南山开发 MTN002	565	56,983.96
中国银行股份有限公司	102383250	23 闽建工 MTN003	124	12,518.46
中国银行股份有限公司	102480188	24 鲁高速 MTN001	275	27,597.69
中国银行股份有限公司	102480369	24 闽建工 MTN001	275	27,528.40
中国银行股份有限公司	102481215	24 保利发展 MTN003	170	17,032.95
中国银行股份有限公司	212480001	24 建行债 01A	733	73,359.93
中国银行股份有限公司	212480009	24 上海银行债 01	113	11,326.70
中国银行股份有限公司	232480014	24 交行二级资本债 01A	1,164	116,500.49
中国银行股份有限公司	232480014	24 交行二级资本债 01A	734	73,236.47
中国银行股份有限公司	232480020	24 兴业银行二级资本债 01	184	18,380.26
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	601	61,125.29
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	494	49,312.87
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	830	83,018.32

中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	1,161	116,188.59
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	293	29,338.55
中国银行股份有限公司	282380005	23 太平人寿永续债 01	613	61,781.91
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	1,234	124,901.79
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	1,727	174,567.45
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2028049	20 工商银行二级 02	918	96,370.64
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2028049	20 工商银行二级 02	918	96,370.64
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	232480010	24 浙商银行二级资本债 01	95	9,641.19
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	597	61,609.42
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	885	89,551.46

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242480003	24 广州农商行 永续债 01	95	9,663.73
中银国际亚洲有限公司	00788	中国铁塔	229	200.00
中银国际亚洲有限公司	01024	快手-W	19	821.02
中银国际亚洲有限公司	01024	快手-W	35	1,521.54
中银国际亚洲有限公司	01209	华润万象生活	1	37.37
中银国际亚洲有限公司	01209	华润万象生活	1	37.37
中银国际亚洲有限公司	01209	华润万象生活	1	34.78
中银国际亚洲有限公司	01209	华润万象生活	1	37.37
中银国际亚洲有限公司	01209	华润万象生活	19	486.04
中银国际亚洲有限公司	01209	华润万象生活	19	486.04
中银国际亚洲有限公司	01816	中广核电力	11	34.29
中银国际亚洲有限公司	01816	中广核电力	11	36.71
中银国际亚洲有限公司	01816	中广核电力	11	29.70
中银国际亚洲有限公司	01816	中广核电力	11	31.95
中银国际亚洲有限公司	01816	中广核电力	21	62.56
中银国际亚洲有限公司	01816	中广核电力	21	62.56
中银国际亚洲有限公司	01816	中广核电力	21	58.21
中银国际亚洲有限公司	01816	中广核电力	21	62.56
中银国际亚洲有限公司	01816	中广核电力	8	20.01
中银国际亚洲有限公司	01816	中广核电力	8	21.57

中银国际亚洲有限公司	01816	中广核电力	9	25.55
中银国际亚洲有限公司	01816	中广核电力	9	25.55
中银国际亚洲有限公司	01958	北京汽车	19	38.47
中银国际亚洲有限公司	01958	北京汽车	19	35.70
中银国际亚洲有限公司	01958	北京汽车	23	46.24
中银国际亚洲有限公司	01958	北京汽车	23	46.24
中银国际亚洲有限公司	01958	北京汽车	28	52.74
中银国际亚洲有限公司	01958	北京汽车	28	56.73
中银国际亚洲有限公司	01958	北京汽车	29	57.05
中银国际亚洲有限公司	01958	北京汽车	29	53.29
中银国际亚洲有限公司	01958	北京汽车	52	103.95
中银国际亚洲有限公司	01958	北京汽车	52	103.95
中银国际亚洲有限公司	01958	北京汽车	52	103.95
中银国际亚洲有限公司	01958	北京汽车	52	96.72
中银国际证券股份有限公司	092200008	22 农行二级资本债 02A	1,222	124,504.94
中银国际证券股份有限公司	2228041	22 农业银行二级 01	244	25,188.79
中银国际证券股份有限公司	232480004	24 农行二级资本债 01A	615	61,470.92
中银国际证券股份有限公司	232480011	24 农行二级资本债 02A	687	68,423.75
中银国际证券股份有限公司	242400011	24 广发银行永续债 01	2,216	221,617.00

中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	382	38,190.30
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	95	9,508.83
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	96	9,559.95
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	96	9,561.83
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	1,161	116,061.50
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	235	23,501.02
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	286	28,696.54
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	469	47,012.45
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	95	9,578.56
中银国际证 券股份有限 公司	312400001	24 工行 TLAC 非资本债 01A	2,394	239,291.56
中银国际证 券股份有限 公司	312400002	24 工行 TLAC 非资本债 01B	1,168	116,862.33
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	1	38.96
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	1	38.96
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	2	65.91

中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	2	65.91
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	234	6,009.67
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	3	85.51
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	3	85.51
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	55	1,396.68
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	609	15,551.17
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	66	1,853.15
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	32	562.96
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	38	690.70
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	40	722.94
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	43	790.32
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	62	1,110.90
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	12	119.00
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	218	2,085.62

中银国际证 券股份有限 公司	601991	大唐发电	424	1,331.62
----------------------	--------	------	-----	----------

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	28,943.71
产品托管费	中国银行股份有限公司	1,286.39
现券买入	中国银行股份有限公司	28,359.65

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-专精特新启航打新策略混合类（封闭式）

2023 年 12 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-专精特新启航打新策略混合类（封闭式）2023 年 12 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

托管业务专用章
0000139242