

中银理财-（7 个月）最短持有期固收增强理财产品 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	CYQZQ7M
理财产品名称	中银理财-（7个月）最短持有期固收增强理财产品
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000511
产品类型	固定收益类产品
募集方式	公募
产品运作模式	开放式净值型产品
产品币种	人民币
风险级别	02 二级(中低)
理财产品成立日	2022-10-25
理财产品到期日	无固定期限

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
CYQZQ7MA	5,582,556,777.53	1.038910	1.038910	5,799,776,050.09	2.98%
CYQZQ7MB	9,331,933,664.57	1.039837	1.039837	9,703,696,681.65	3.07%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：107.92%

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	35,292.52	2.28%	132,211.91	8.02%
同业存单	-	0.00%	43,227.36	2.62%
拆放同业及买入返售	30,000.00	1.94%	58,030.96	3.52%
债券	102,099.45	6.59%	1,216,167.88	73.78%
非标准化债权类资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	74,278.14	4.51%
境外投资资产	-	0.00%	78,546.40	4.76%
商品类资产	-	0.00%	-	0.00%
另类资产	-	0.00%	-	0.00%
公募基金	-	0.00%	46,006.92	2.79%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	1,382,165.09	89.20%	-	0.00%
合计	1,549,557.06	100%	1,648,469.56	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	CNY：现金及银行存款	77,689.84	4.71%
2	019670：22 国债 05	30,023.46	1.82%
3	TRADE_6758176：交易所逆回购	30,000.00	1.82%
4	2028022：20 民生银行二级	20,369.25	1.24%
5	019694：23 国债 01	20,002.42	1.21%
6	1928013：19 民生银行永续债	15,774.95	0.96%
7	102382196：23 中色 MTN002A	14,992.50	0.91%
8	252204：23 广安 04	14,926.50	0.91%
9	1928002：19 民生银行二级 01	14,474.36	0.88%

10	XS2647834881: BCHINA 4.4772 11/05/26	14,368.74	0.87%
----	---	-----------	-------

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（7个月最短持有期固收增强）
账号	744576271667
开户行	中国银行深圳市分行营业部

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，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，债券市场收益率整体先上后下，市场波动加大。在资产配置上，一方面，抓住市场调整机会，配置性价比较高资产，以期获得后续收益率下行带来的资本利得收益；另一方面，在短端利率较低时，处置部分短久期资产，实现资本利得并降低组合杠杆水平，以应对潜在市场调整。同时，积极拓展低波动资产，并根据市场变化进行配置。在市场预期高开低走、海外流动性趋紧等多重因素叠加下，权益市场震荡下行，产品管理人在前期保持低仓位运行严防回撤，于市场下行阶段结合大类资产性价比及风险预算，将权益仓位分批提高，以提高净值稳定性和捕捉大类资产轮动收益。

（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）
中国银行股份有限公司	1928028	19 中国银行二级 01	23,360	2,426,220.51
中国银行股份有限公司	1928028	19 中国银行二级 01	260	26,998.99
中国银行股份有限公司	1928028	19 中国银行二级 01	260	26,998.73
中国银行股份有限公司	1928028	19 中国银行二级 01	35,040	3,637,375.25
中国银行股份有限公司	1928028	19 中国银行二级 01	780	81,000.87
中国银行股份有限公司	1928033	19 中国银行二级 03	19,440	2,022,150.42
中国银行股份有限公司	XS2731858366	BCHINA 4.18 12/06/25	3,567,500	3,583,946.18
中国银行股份有限公司	XS2739604655	BCHIN 4.18 12/21/2026	238,249	2,401,881.20
中银国际控股有限公司	XS2647495576	BCHINA 3.22667 09/29/26	5	32,782,217.72
中银国际控股有限公司	XS2650032738	BCHINA 5.48135 07/17/26	4	11,982,184.31
中银国际控股有限公司	XS2650037703	BCHINA 10.9972 01/22/26	5	29,428,794.68
中银国际证券股份有限公司	183008	工鑫 10A	685,611	70,498,223.44
中银国际证券股份有限公司	199836	23 电建 2A	1,000,000	100,000,000.00

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	012283152	22 招商局港 SCP005	76,920	7,784,412.32

中国银行股份有限公司	012380527	23 闽冶金 SCP002	57,690	5,799,517.38
中国银行股份有限公司	012381072	23 津城建 SCP013	6,321	632,100.00
中国银行股份有限公司	012381525	23 东方国际 SCP001	115,380	11,550,551.64
中国银行股份有限公司	012381961	23 吴中国太 SCP003	19,230	1,923,000.00
中国银行股份有限公司	012381971	23 津城建 SCP032	100,000	10,000,000.00
中国银行股份有限公司	012381971	23 津城建 SCP032	19,230	1,923,000.00
中国银行股份有限公司	012381971	23 津城建 SCP032	23,340	2,334,000.00
中国银行股份有限公司	012382133	23 江苏核电 SCP001(科创 票据)	57,960	5,796,000.00
中国银行股份有限公司	012382161	23 福建港口 SCP003	500,000	50,003,060.11
中国银行股份有限公司	012382234	23 闽能源 SCP002(碳资 产)	118,400	11,842,193.31
中国银行股份有限公司	012382234	23 闽能源 SCP002(碳资 产)	25,050	2,505,464.04
中国银行股份有限公司	012382241	23 津城建 SCP037	100,000	10,000,000.00
中国银行股份有限公司	012382241	23 津城建 SCP037	22,250	2,225,000.00
中国银行股份有限公司	012383142	23 温州交运 SCP002	59,900	5,977,976.60
中国银行股份有限公司	012383899	23 南通高新 SCP010	200,000	20,001,557.38
中国银行股份有限公司	012383899	23 南通高新 SCP010	60,017	6,002,199.55
中国银行股份有限公司	012383899	23 南通高新 SCP010	66,720	6,672,498.44
中国银行股份有限公司	031900619	19 广州城建 PPN001	236,800	24,288,233.78
中国银行股份有限公司	032100573	21 戴姆勒财 PPN004BC	105,350	10,916,221.39
中国银行股份有限公司	032100573	21 戴姆勒财 PPN004BC	210,700	21,838,917.32

中国银行股份有限公司	032280151	22 昆交投 PPN001	39,480	3,817,689.45
中国银行股份有限公司	032380088	23 凤城河 PPN001	19,740	1,974,227.15
中国银行股份有限公司	032380359	23 吴中经发 PPN002	64,650	6,465,651.80
中国银行股份有限公司	032380567	23 平潭城发 PPN001	19,320	1,932,000.00
中国银行股份有限公司	082100306	21 聚盈建发 ABN001 优先	500,000	50,772,436.99
中国银行股份有限公司	082100306	21 聚盈建发 ABN001 优先	98,700	9,979,299.84
中国银行股份有限公司	082100421	21 中化临港 ABN001 优先	270,960	28,315,292.90
中国银行股份有限公司	082100421	21 中化临港 ABN001 优先	800,000	83,518,614.79
中国银行股份有限公司	082100454	21 京东东裕 1ABN001 优先 B	27,750	2,780,913.52
中国银行股份有限公司	082100556	21 聚盈建发 ABN002 优先	93,765	9,384,453.58
中国银行股份有限公司	082100776	21 聚盈建发 ABN003 优先	135,480	13,429,604.96
中国银行股份有限公司	082100992	21 光穗甬开 ABN002 优先	24,675	2,508,497.51
中国银行股份有限公司	082101309	21 象中象屿 ABN001 优先	98,700	9,949,226.49
中国银行股份有限公司	082380198	23 速利银丰 ABN001 优先	81,690	8,169,000.00
中国银行股份有限公司	082380336	23 同煤漳泽 ABN002 优先	41,750	4,177,682.29
中国银行股份有限公司	082380343	23 晋租 2 号 ABN001 优先	89,000	8,900,000.00
中国银行股份有限公司	082380667	23 华能罗源 ABN001 优先	103,419	10,341,912.50
中国银行股份有限公司	082380675	23 华能安源 ABN001 优先	27,028	2,702,758.80
中国银行股份有限公司	082380820	23 华电山西 ABN001 优先	86,537	8,653,656.00
中国银行股份有限公司	082380908	23 晋租 2 号 ABN002 优先	9,197	919,708.80
中国银行股份有限公司	082380909	23 京东东裕 2ABN001 优先 A	19,083	1,908,278.40

中国银行股份有限公司	082380909	23 京东东裕 2ABN001 优 先 A	4,599	459,854.40
中国银行股份有限公司	092100012	21 长城资本债 01BC	9,870	953,214.35
中国银行股份有限公司	092280003	22 中国信达债 01	138,180	13,931,767.57
中国银行股份有限公司	092280003	22 中国信达债 01	138,180	13,933,987.16
中国银行股份有限公司	092280003	22 中国信达债 01	138,180	13,907,399.24
中国银行股份有限公司	092280003	22 中国信达债 01	153,840	15,563,244.25
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	24,360	2,506,533.01
中国银行股份有限公司	101653045	16 商飞 MTN002	169,950	17,449,750.35
中国银行股份有限公司	101900254	19 华润 MTN003B	9,720	994,013.17
中国银行股份有限公司	101901191	19 紫金矿业 MTN003	19,440	2,034,697.37
中国银行股份有限公司	102001484	20 中建材集 MTN004	33,160	3,422,961.49
中国银行股份有限公司	102001539	20 中煤集团 MTN001	58,030	5,985,503.71
中国银行股份有限公司	102001539	20 中煤集团 MTN001	58,030	5,985,503.71
中国银行股份有限公司	102100207	21 华为 MTN001	93,550	9,565,740.72
中国银行股份有限公司	102101175	21 晋焦煤 MTN003	11,680	1,219,725.92
中国银行股份有限公司	102101282	21 华电股 MTN001	82,900	8,504,764.94
中国银行股份有限公司	102101306	21 栾川铝业 MTN001(绿 色)	9,870	1,003,414.46
中国银行股份有限公司	102101599	21 荣盛 MTN002	49,350	4,997,863.25
中国银行股份有限公司	102101710	21 物产中大 MTN002	78,960	8,085,442.67
中国银行股份有限公司	102101832	21 建发 MTN001	128,310	13,092,944.87
中国银行股份有限公司	102101908	21 云能投 MTN003	10,775	1,125,857.12

中国银行股份有限公司	102102253	21 保定长城 MTN001	22,580	2,311,610.21
中国银行股份有限公司	102180026	21 天津港 MTN004	39,480	4,031,514.21
中国银行股份有限公司	102200088	22 绿城地产 MTN001	19,740	1,877,258.88
中国银行股份有限公司	102280011	22 荣盛 MTN001	69,090	6,821,270.84
中国银行股份有限公司	102280162	22 荣盛 MTN002	49,350	4,869,935.68
中国银行股份有限公司	102280945	22 温州交运 MTN001	29,880	3,030,342.70
中国银行股份有限公司	102281566	22 浙报 MTN001	33,160	3,386,240.92
中国银行股份有限公司	102282317	22 水电八局 MTN003	59,760	6,130,987.56
中国银行股份有限公司	102300375	23 粤珠江 MTN001	19,320	1,932,197.95
中国银行股份有限公司	102300393	23 京津冀 MTN001B	40,940	4,095,275.18
中国银行股份有限公司	102300394	23 晋路桥 MTN001(乡村 振兴)	163,760	16,376,000.00
中国银行股份有限公司	102300425	23 龙城发展 MTN002	40,940	4,094,000.00
中国银行股份有限公司	102300571	23 金辉集团 MTN002	20,000	2,000,233.88
中国银行股份有限公司	102380306	23 甘肃农垦 MTN001(乡村 振兴)	42,140	4,215,554.34
中国银行股份有限公司	102380345	23 联发集 MTN002	21,070	2,107,286.69
中国银行股份有限公司	102380398	23 中船租 MTN001BC(可持续挂钩)	168,560	16,857,519.80
中国银行股份有限公司	102380416	23 中原高速 MTN001	21,070	2,107,000.00
中国银行股份有限公司	102380455	23 成都环境 MTN002	21,070	2,107,000.00
中国银行股份有限公司	102380568	23 云能投 MTN001	105,350	10,535,000.00
中国银行股份有限公司	102380652	23 珠海华发 MTN001	21,070	2,107,000.00

中国银行股份有限公司	102380686	23 宁夏国资 MTN001	21,070	2,107,212.43
中国银行股份有限公司	102380738	23 临沂城投 MTN001	12,642	1,264,343.35
中国银行股份有限公司	102380743	23 象屿 MTN001	600,000	60,006,721.31
中国银行股份有限公司	102380777	23 兴蓉环境 MTN001	100,000	10,000,000.00
中国银行股份有限公司	102380816	23 福瑞能源 MTN001	100,000	10,000,893.44
中国银行股份有限公司	102380843	23 水电八局 MTN001	150,850	15,086,636.27
中国银行股份有限公司	102380846	23 中广核租 MTN002(碳中和债)	170,580	17,059,528.70
中国银行股份有限公司	102380910	23 华为 MTN004	100,000	10,000,000.00
中国银行股份有限公司	102381009	23 锡产业 MTN005	85,320	8,534,237.90
中国银行股份有限公司	102381010	23 锡产业 MTN004	100,000	10,002,606.56
中国银行股份有限公司	102381069	23 厦国贸控 MTN001(科创票据)	500,000	50,000,000.00
中国银行股份有限公司	102381090	23 水电八局 MTN002	119,520	12,235,143.47
中国银行股份有限公司	102381145	23 九龙江 MTN002	73,880	7,388,662.09
中国银行股份有限公司	102381150	23 碧桂园 MTN002	11,538	1,153,924.52
中国银行股份有限公司	102381152	23 碧桂园 MTN001	11,538	1,153,919.79
中国银行股份有限公司	102381189	23 厦港务 MTN001	500,000	50,000,000.00
中国银行股份有限公司	102381236	23 华电 MTN004A(能源保供特别债)	192,300	19,234,665.64
中国银行股份有限公司	102381241	23 新创建 MTN001BC	19,230	1,923,000.00
中国银行股份有限公司	102381242	23 中铁置业 MTN001	57,690	5,769,000.00
中国银行股份有限公司	102381255	23 桂铁投 MTN001	19,230	1,923,194.40

中国银行股份有限公司	102381265	23 福建港口 MTN002	96,150	9,615,906.33
中国银行股份有限公司	102381318	23 豫水利 MTN002	154,560	15,457,528.71
中国银行股份有限公司	102381341	23 首农食品 MTN002	200,000	20,005,229.51
中国银行股份有限公司	102381341	23 首农食品 MTN002	38,640	3,865,010.34
中国银行股份有限公司	102381363	23 中化股 MTN001	115,920	11,592,924.83
中国银行股份有限公司	102381458	23 龙岩汇金 MTN001	19,320	1,932,000.00
中国银行股份有限公司	102381466	23 北部湾 MTN002	19,320	1,932,000.00
中国银行股份有限公司	102381573	23 南昌轨交 MTN003(绿色)	20,470	2,047,000.00
中国银行股份有限公司	102381612	23 华电股 MTN007A	122,820	12,282,000.00
中国银行股份有限公司	102381781	23 长沙水业 MTN003	20,470	2,047,000.00
中国银行股份有限公司	102381892	23 武汉城建 MTN001	20,470	2,047,000.00
中国银行股份有限公司	102381956	23 越秀交通 MTN001	30,600	3,060,000.00
中国银行股份有限公司	102382056	23 厦国贸控 MTN003	30,600	3,060,000.00
中国银行股份有限公司	102382060	23 吉利汽车 MTN001	122,400	12,240,000.00
中国银行股份有限公司	102382060	23 吉利汽车 MTN001	300,000	30,002,663.93
中国银行股份有限公司	102382080	23 陕有色 MTN001	214,200	21,420,000.00
中国银行股份有限公司	102382092	23 大唐集 MTN009	283,900	28,390,000.00
中国银行股份有限公司	102382117	23 成都环境 MTN003	200,000	20,005,245.90
中国银行股份有限公司	102382130	23 南安市贸 MTN002	2,960	295,355.30
中国银行股份有限公司	102382130	23 南安市贸 MTN002	59,760	5,977,729.12
中国银行股份有限公司	102382169	23 中盐 MTN002	600,000	60,004,918.03

中国银行股份有限公司	102382259	23 晋能煤业 MTN004	2,960	295,439.75
中国银行股份有限公司	102382259	23 晋能煤业 MTN004	91,420	9,142,874.24
中国银行股份有限公司	102382322	23 京能国际 MTN001	300,000	30,003,016.39
中国银行股份有限公司	102382323	23 龙湖拓展 MTN001	91,800	9,180,000.00
中国银行股份有限公司	102382355	23 美的置业 MTN004A	94,350	9,435,000.00
中国银行股份有限公司	102382439	23 云能投 MTN002	314,500	31,450,000.00
中国银行股份有限公司	102382481	23 北部湾 MTN003	57,080	5,708,000.00
中国银行股份有限公司	102382482	23 鄂联投 MTN004	1,480	148,049.13
中国银行股份有限公司	102382528	23 中交天航 MTN001(科创 票据)	100,000	10,001,035.52
中国银行股份有限公司	102382568	23 闽冶金 MTN003	100,000	10,002,704.92
中国银行股份有限公司	102382569	23 福瑞能源 MTN002(能源 保供特别债)	100,000	10,002,549.18
中国银行股份有限公司	102382594	23 华侨城 MTN005	100,000	10,001,084.70
中国银行股份有限公司	102382594	23 华侨城 MTN005	157,250	15,726,705.69
中国银行股份有限公司	102382652	23 本钢集团 MTN001(科创 票据)	94,350	9,435,000.00
中国银行股份有限公司	102382920	23 武商贸集 MTN002	100,000	10,000,931.69
中国银行股份有限公司	102382923	23 天津港 MTN001(科创 票据)	30,000	3,000,311.48
中国银行股份有限公司	102382923	23 天津港 MTN001(科创 票据)	8,650	864,995.73
中国银行股份有限公司	102383017	23 新创建 MTN002BC	28,136	2,813,573.60
中国银行股份有限公司	102383134	23 中交天航 MTN003(科创 票据)	24,250	2,436,664.56

中国银行股份有限公司	102383172	23 中铁置业 MTN002	92,500	9,250,020.00
中国银行股份有限公司	102383366	23 龙湖企业 MTN002	10,000	1,000,100.00
中国银行股份有限公司	132100040	21 南京地铁 GN001(碳中和 债)	187,100	19,013,988.73
中国银行股份有限公司	132380009	23 甘肃电投 GN001	98,700	9,871,108.69
中国银行股份有限公司	132380060	23 三峡 GN001	600,000	60,004,721.31
中国银行股份有限公司	1928026	19 兴业银行二 级 02	272,790	28,821,677.90
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	24,870	2,603,588.75
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	41,450	4,332,673.68
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	250,500	26,155,750.92
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	36,050	3,746,658.03
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	24,870	2,634,784.93
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永 续债	29,880	3,222,518.05
中国银行股份有限公司	2120064	21 恒丰银行永 续债	27,750	2,772,707.05
中国银行股份有限公司	2120064	21 恒丰银行永 续债	270,960	26,940,951.12
中国银行股份有限公司	212300002	23 江苏银行债 01	19,320	1,932,000.00
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永 续债 01	168,560	16,691,274.39
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永 续债 01	59,220	5,725,887.94
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永 续债 01	69,090	6,728,126.64
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永 续债 01	69,090	6,739,628.80
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永 续债 01	78,960	7,702,586.94
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永 续债 01	9,870	961,160.95

中国银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永续债	14,420	1,533,739.96
中国银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永续债	14,420	1,533,677.05
中国银行股份有限公司	2128036	21 平安银行二级	21,630	2,233,433.92
中国银行股份有限公司	2128036	21 平安银行二级	36,050	3,722,389.86
中国银行股份有限公司	2320022	23 杭州银行01	19,320	1,932,000.00
中国银行股份有限公司	2320028	23 威海银行绿色债	61,410	6,141,000.00
中国银行股份有限公司	2320031	23 华润银行小微债 01	20,470	2,047,000.00
中国银行股份有限公司	2320036	23 海峡银行小微债 02	100,000	10,000,748.63
中国银行股份有限公司	2320041	23 南京银行01	100,000	10,000,000.00
中国银行股份有限公司	2322010	23 福特汽车债02	100,000	10,000,822.40
中国银行股份有限公司	2322010	23 福特汽车债02	61,200	6,120,000.00
中国银行股份有限公司	2322017	23 招银金租债01	25,523	2,552,287.30
中国银行股份有限公司	232380026	23 厦门国际二级资本债 01	20,470	2,047,000.00
中国银行股份有限公司	232380063	23 创兴银行二级资本债 01BC	100,000	10,000,000.00
中国银行股份有限公司	2389373	23 汇聚融1A1_BC	20,000	2,000,409.32
中国银行股份有限公司	2389373	23 汇聚融1A1_BC	4,001	400,115.48
中国银行股份有限公司	2389373	23 汇聚融1A1_BC	48	4,822.33
中国银行股份有限公司	2389373	23 汇聚融1A1_BC	5,767	576,781.84
中国银行股份有限公司	2389387	23 吉时代4优先_BC	20,791	2,079,118.50
中国银行股份有限公司	242300001	23 宁波银行永续债 01	61,410	6,141,000.00
中国银行股份有限公司	242380014	23 富邦华一永续债 01	8,188	818,800.00

中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	1,000,000	100,009,207.65
中国银行股份有限公司	272380014	23 东方二级资本债 01BC	500,000	50,005,464.48
中国银行股份有限公司	UL457960	23 新创建 MTN001BC	100,000	10,000,000.00
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	170,340	17,462,003.52
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	48,720	4,947,906.63
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	96,420	9,623,462.40
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928010	19 平安银行二级	19,440	1,986,052.17
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928010	19 平安银行二级	19,440	1,986,052.17
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928010	19 平安银行二级	2,080	220,823.69
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928010	19 平安银行二级	35,040	3,720,029.90

中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928010	19 平安银行二级	35,040	3,717,237.41
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928013	19 民生银行永续债	3,948	403,180.49
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	1,300	136,626.32
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	167,000	17,667,620.65
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	72,100	7,594,038.77
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	100,000	10,103,393.93
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	100,000	10,099,663.93
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	200,000	20,199,327.87

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	300,000	30,298,991.80
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	300,000	30,298,991.80
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	72,100	7,338,537.16
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	100,000	10,354,020.14
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	24,870	2,585,236.94
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	29,880	3,047,756.32
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	300,000	31,062,060.41
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	59,760	6,094,938.94

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	600,000	62,124,120.82
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	89,640	9,145,925.61
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	89,850	9,172,631.29
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	149,400	16,115,673.22
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2121039	21 成都农商二级 01	4,935	499,508.96
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2128028	21 邮储银行二级 01	73,080	7,638,943.78
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2228004	22 工商银行二级 01	48,720	4,993,210.62
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	232380008	23 广州农商行二级资本债 01	126,420	12,642,000.00

中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	232380033	23 成都银行二级资本债 01	300,000	30,002,745.90
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	61,400	6,140,000.00
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	100,000	10,000,695.89
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	2,000,000	200,000,000.00
中银国际控股有限公司	XS2647495576	BCHINA 3.22667 09/29/26	5	32,782,217.72
中银国际控股有限公司	XS2650032738	BCHINA 5.48135 07/17/26	4	11,982,184.31
中银国际控股有限公司	XS2650037703	BCHINA 10.9972 01/22/26	5	29,428,794.68
中银国际证券股份有限公司	092200008	22 农行二级资本债 02A	97,440	9,957,257.18
中银国际证券股份有限公司	110053	苏银转债	4,290	537,876.92
中银国际证券股份有限公司	115444	23 华租 Y1	59,760	6,037,177.87
中银国际证券股份有限公司	115629	23 津投 13	20,000	2,000,000.00
中银国际证券股份有限公司	115798	23 津投 17	7,446	772,269.65

中银国际证 券股份有限 公司	137876	22 联发 03	16,620	1,638,155.08
中银国际证 券股份有限 公司	155950	19CHNG1Y	500,000	51,675,219.18
中银国际证 券股份有限 公司	183008	工鑫 10A	685,611	70,498,223.44
中银国际证 券股份有限 公司	185066	21 华电 08	1,480	152,465.63
中银国际证 券股份有限 公司	185137	21 大唐 Y1	43,850	4,478,760.91
中银国际证 券股份有限 公司	1928006	19 工商银行二 级 01	1,300	132,166.29
中银国际证 券股份有限 公司	1928006	19 工商银行二 级 01	19,440	1,988,304.03
中银国际证 券股份有限 公司	1928009	19 农业银行二 级 04	23,360	2,371,943.71
中银国际证 券股份有限 公司	1928009	19 农业银行二 级 04	35,040	3,557,314.68
中银国际证 券股份有限 公司	1928009	19 农业银行二 级 04	38,880	3,974,461.94
中银国际证 券股份有限 公司	1928009	19 农业银行二 级 04	9,720	992,740.76
中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	19,440	1,985,858.23
中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	260	26,404.69
中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	260	26,383.99

中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	520	52,767.99
中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	520	52,815.34
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	200,400	21,409,099.58
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	72,100	7,669,867.63
中银国际证 券股份有限 公司	1928019	19 交通银行二 级 01	11,680	1,219,274.66
中银国际证 券股份有限 公司	1928019	19 交通银行二 级 01	19,440	2,042,549.78
中银国际证 券股份有限 公司	1928019	19 交通银行二 级 01	19,440	2,042,318.44
中银国际证 券股份有限 公司	1928019	19 交通银行二 级 01	23,360	2,439,157.41
中银国际证 券股份有限 公司	1928019	19 交通银行二 级 01	35,040	3,655,681.87
中银国际证 券股份有限 公司	1928019	19 交通银行二 级 01	48,600	5,106,374.44
中银国际证 券股份有限 公司	1928019	19 交通银行二 级 01	520	54,303.09
中银国际证 券股份有限 公司	1928019	19 交通银行二 级 01	780	81,888.28
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	250,500	26,427,517.69
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	520	54,468.65

中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	64,280	6,689,733.98
中银国际证 券股份有限 公司	1928028	19 中国银行二 级 01	23,360	2,426,220.51
中银国际证 券股份有限 公司	1928028	19 中国银行二 级 01	260	26,998.73
中银国际证 券股份有限 公司	1928028	19 中国银行二 级 01	260	26,998.99
中银国际证 券股份有限 公司	1928028	19 中国银行二 级 01	35,040	3,637,375.25
中银国际证 券股份有限 公司	1928028	19 中国银行二 级 01	780	81,000.87
中银国际证 券股份有限 公司	1928033	19 中国银行二 级 03	19,440	2,022,150.42
中银国际证 券股份有限 公司	199836	23 电建 2A	1,000,000	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	2028013	20 农业银行二 级 01	100,000	10,285,019.86
中银国际证 券股份有限 公司	2028013	20 农业银行二 级 01	300,000	30,855,059.59
中银国际证 券股份有限 公司	2028013	20 农业银行二 级 01	500,000	51,430,099.32
中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	36,050	3,747,031.22
中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	500,000	51,568,712.33
中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	500,000	51,568,712.33

中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	72,100	7,492,855.71
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	149,400	15,280,836.66
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	59,760	6,127,918.27
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	59,760	6,114,228.32
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	89,640	9,191,877.41
中银国际证 券股份有限 公司	232380004	23 农行二级资 本债 01A	73,050	7,410,253.39
中银国际证 券股份有限 公司	2389307	23 欣荣 2 优先	20,000	2,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	300760	迈瑞医疗	179	48,537.62
中银国际证 券股份有限 公司	300760	迈瑞医疗	368	99,036.10
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	62,900	6,402,591.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	62,900	6,402,591.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	62,900	6,402,591.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	62,900	6,402,591.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	62,900	6,402,591.00

中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	85,800	8,787,636.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	85,800	8,787,636.00
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	10,905	267,963.82
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	10,905	267,963.82
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	11,109	267,972.50
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	22,072	535,942.38
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	22,435	535,983.42
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	4,513	99,190.46
中银国际证 券股份有限 公司	601808	中海油服	2,818	41,602.64
中银国际证 券股份有限 公司	601808	中海油服	4,650	71,091.74
中银国际证 券股份有限 公司	601808	中海油服	4,721	70,723.95

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	BOCWNA MEMSEC U_A_23	中银证券中国 红-汇中 23 号 集合资产管理 计划	343,946,541	350,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCWNA MEMSEC U_A_23	中银证券中国 红-汇中 23 号 集合资产管理 计划	697,788,698	710,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCWNA MEMSEC U_A_23	中银证券中国 红-汇中 23 号 集合资产管理 计划	98,289,758	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCWNA MEMSEC U_A_23	中银证券中国 红-汇中 23 号 集合资产管理 计划	98,376,783	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCWNA MEMSEC U_A_23	中银证券中国 红-汇中 23 号 集合资产管理 计划	98,454,268	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYGJZGH HZ5820220 815	中银证券中国 红-汇中 58 号 集合资产管理 计划	49,682,035	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202120	中银证券中国 红-汇中 20 号 集合资产管理 计划	183,570,445	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202128	中银证券中国 红-汇中 28 号 集合资产管理 计划	140,304,929	150,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202128	中银证券中国 红-汇中 28 号 集合资产管理 计划	280,478,684	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202128	中银证券中国 红-汇中 28 号 集合资产管理 计划	5,606,953	6,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202128	中银证券中国 红-汇中 28 号 集合资产管理 计划	664,641,094	700,000,000.00

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	185,563,184	200,000,000.00
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	230,457,227	250,000,000.00
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	273,584,906	290,000,000.00
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	93,135,885	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220323	中银证券中国 红-汇中 53 号 集合资产管理 计划	188,529,470	190,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220323	中银证券中国 红-汇中 53 号 集合资产管理 计划	227,587,572	230,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220323	中银证券中国 红-汇中 53 号 集合资产管理 计划	395,882,819	400,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220323	中银证券中国 红-汇中 53 号 集合资产管理 计划	482,160,077	500,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220323	中银证券中国 红-汇中 53 号 集合资产管理 计划	529,253,272	550,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	10,000,000	10,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	118,894,283	120,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	128,015,756	130,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	128,840,436	130,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	14,776,869	15,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	147,217,588	150,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	159,728,462	160,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	167,520,694	170,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	188,230,632	190,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	193,836,978	195,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	197,784,810	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	197,921,821	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	198,275,007	200,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	198,846,689	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	198,945,588	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	228,878,495	230,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	245,531,330	250,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	247,524,752	250,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	268,897,520	270,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	275,780,557	280,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	29,469,548	30,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	29,513,035	30,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	29,647,198	30,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	296,150,049	300,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	296,735,905	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	297,206,261	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	319,520,719	320,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	339,592,489	340,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	39,848,575	40,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	393,972,225	400,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	443,699,468	450,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	445,765,230	450,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	448,251,818	450,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	49,077,346	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	49,106,266	50,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	49,111,089	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	530,503,979	540,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	56,080,283	57,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	58,892,815	60,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	59,796,691	60,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	594,942,985	600,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	639,134,710	650,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	68,796,069	70,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	68,843,430	70,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	709,010,340	720,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	743,752,479	750,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	78,825,500	80,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	78,848,807	80,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	79,192,239	80,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	855,551,134	860,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	9,860,960	10,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	98,145,058	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	98,202,887	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	98,405,826	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	98,619,329	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	98,745,927	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	985,804,416	1,000,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ98Q DII2023061 6	中银证券-中 银理财 98 号 QDII 单一资 产管理计划	10,000,000	10,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ98Q DII2023061 6	中银证券-中 银理财 98 号 QDII 单一资 产管理计划	138,806,266	140,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ98Q DII2023061 6	中银证券-中 银理财 98 号 QDII 单一资 产管理计划	31,984,008	32,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ98Q DII2023061 6	中银证券-中 银理财 98 号 QDII 单一资 产管理计划	39,674,668	40,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ98Q DII2023061 6	中银证券-中 银理财 98 号 QDII 单一资 产管理计划	699,930,007	700,000,000.00
中银基金管 理有限公司	ZYJJCWQ D08	中银基金-财 稳 8 号 QDII 集合资产管理 计划	10,000,000	10,000,000.00
中银基金管 理有限公司	ZYJJCWQ D08	中银基金-财 稳 8 号 QDII 集合资产管理 计划	300,000,000	300,000,000.00
中银基金管 理有限公司	ZYJJCWQ D08	中银基金-财 稳 8 号 QDII 集合资产管理 计划	50,000,000	50,000,000.00
中银基金管 理有限公司	ZYJJZLJC0 120230314	中银基金-战 略基础 1 号集 合资产管理计 划	4,133,940	4,000,000.00

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	41,754,316.05
产品托管费	中国银行股份有限公司	3,548,420.04

1 日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	1,680,000.00
3 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	34,068,000.00
7 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	1,608,454,000.00
现券买入	中国银行股份有限公司	1,600,577,658.32
现券买入	中银国际证券股份有限公司	925,834,594.41
现券买入	中银资产管理有限公司	181,569,440.29
现券买入	中银国际控股有限公司	74,193,196.71
现券买入	中国银行（香港）有限公司	9,996,290.30
现券卖出	中银国际证券股份有限公司	137,829,941.03
现券卖出	中银国际控股有限公司	32,992,805.76
现券卖出	中国银行股份有限公司	16,135,787.09

八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市，在当前基本面复苏动能仍有待加强的背景下，预计债券市场大幅调整的可能性不大。但当前资金面难言宽松，一定程度上制约了利率再度下行空间，且叠加当前信用利差和期限利差均较为拥挤，止盈盘可能为市场带来部分扰动。若后续资金面能进一步缓解，市场或将迎来较大机会。权益市场本轮调整时间及空间已经较为充分，整体估值降至极低水平，沪深 300 股权风险溢价上行至 6.7%，位于近十年 90%分位数，在流动性宽裕和估值调整充分的背景下，权益资产具备较高吸引力，同时有助于防范固收类资产的非线性风险。在投资策略上，精选优质票息资产，控制产品的杠杆与久期，做好风险对冲，动态地对股债仓位进行调整，加强与投资者沟通，提前做好各种情形下的流动性安排。

中银理财-（7个月）最短持有期固收增强理财产品

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-（7个月）最短持有期固收增强理财产品（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》和托管合同等文本的规定，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。

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。

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深圳市分行托管业务部

2024 年 02 月 26 日

