中银理财-(14天)最短持有期纯债理财产品 2024年一季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3月31日

一、理财产品基本情况

理财产品代码	CYQCZ14D
理财产品名称	中银理财-(14 天)最短持有期纯债理财产品
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000465
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	2022-09-28
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
CYQCZ14DA	23,050,748,122.28	1.042842	1.042842	24,038,299,254.45	0.63%
CYQCZ14DB	17,094,504,891.14	1.044326	1.044326	17,852,243,504.01	0.65%

(二) 截至报告期末,理财产品杠杆水平: 100.76%

三、理财产品持仓情况

冰分米山	穿透前金额	占全部产品总资	穿透后金额	占全部产品总资
资产类别	(万元)	产的比例	(万元)	产的比例

现金及银行存款	93,793.50	2.19%	1,426,633.88	33.91%
同业存单	-	0.00%	254,379.70	6.05%
拆放同业及买入	60 100 00	1.41%	60 272 04	1.65%
返售	60,100.00	1.41%	69,273.04	1.03%
债券	298,486.00	6.98%	2,427,138.43	57.69%
非标准化债权类		0.000/		0.000/
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%	29,458.39	0.70%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	3,822,349.70	89.42%	-	0.00%
合计	4,274,729.20	100%	4,206,883.44	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	23060705: 存放同业	201,050.57	4.78%
2	CNY: 现金及银行存款	173,051.22	4.11%
3	1928018: 19 工商银行永续债	161,362.69	3.84%
4	23060701: 存放同业	160,840.46	3.82%
5	23060704: 存放同业	160,840.46	3.82%
6	23060702: 存放同业	160,840.46	3.82%
7	019703: 23 国债 10	127,372.34	3.03%
8	1928021: 19 农业银行永续债 01	116,894.25	2.78%
9	1928023: 19 农业银行永续债 02	82,898.99	1.97%
10	2028006: 20 邮储银行永续债	81,819.91	1.94%

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(14 天最短持有期纯债)
账号	748476208849
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。产品融资渠道畅通多元,风险总体可控。

七、本运作期主要操作回顾

(一) 主要投资策略及操作

一季度以来,产品管理人维持产品低波资产占比的同时提高产品市值法资产的收益和流动性建设。市值法资产方面通过增加银行永续债和二级资本债以及利率债来捕捉收益下行的资本利得,同时增加2年内的高票息资产提供票息收入。考虑资金利率相对平稳,市值法资产中根据产品申赎情况常年维持较高杠杆,通过赚取息差收益提高产品净值表现。

(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3月31日期间投资于关联方发行的证券

 	证券代码	证券简称	报告期内买入证券	
大联刀石柳	此分八吗	近分則你 	数量(单位:张)	总金额(单位:元)

_	_	_	_	_

本产品于 2024年1月1日至 2024年3月31日期间投资于关联方承销的证券

			报告期内买入证券		
关联方名称	证券代码	证券简称 	数量(单位:张)	总金额(单位:元)	
中国银行股份有限公司	082480054	24 晋租 1 号 ABN001 优先 (绿色)	76,571	7,657,102.40	
中国银行股 份有限公司	082480075	24 同煤漳泽 ABN001 优先	40,719	4,071,866.70	
中国银行股 份有限公司	091900029	19 东方二级资 本债 01BC	24,837	2,528,165.82	
中国银行股 份有限公司	091900029	19 东方二级资 本债 01BC	73,515	7,501,492.93	
中国银行股 份有限公司	102380743	23 象屿 MTN001	26,004	2,733,850.70	
中国银行股 份有限公司	102380743	23 象屿 MTN001	45,264	4,754,019.51	
中国银行股 份有限公司	102400690	24 云能投 MTN007	59,405	5,940,474.00	
中国银行股 份有限公司	102480390	24 象屿 MTN001	21,457	2,160,326.75	
中国银行股 份有限公司	102481237	24 象屿 MTN002A	59,405	5,940,474.00	
中国银行股 份有限公司	1928022	19 兴业银行二 级 01	89,405	9,006,272.62	
中国银行股 份有限公司	1928026	19 兴业银行二 级 02	17,881	1,802,565.80	
中国银行股 份有限公司	1928026	19 兴业银行二 级 02	35,762	3,605,606.02	
中国银行股 份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	1,400,000	143,425,587.13	
中国银行股 份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	246,544	25,428,924.85	
中国银行股 份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	246,544	25,428,924.85	
中国银行股 份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	248,566	25,660,455.49	
中国银行股 份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	821,812	84,772,135.15	

				T
中国银行股 份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	200,000	20,503,796.16
中国银行股		19 中信银行永		
份有限公司	1928036	19 中信報行	1,000,000	102,331,682.19
中国银行股		19 中信银行永		
份有限公司	1928036	(大)	100,000	10,237,201.64
中国银行股		19 中信银行永		
份有限公司	1928036	续债	500,000	51,186,008.22
中国银行股		19 中信银行永		
份有限公司	1928036	対 情	954	97,227.38
中国银行股		19 平安银行永		
份有限公司	1928038	対 女 版 门 水	100,000	10,133,269.59
中国银行股		19 平安银行永		
份有限公司	1928038		248,566	25,403,035.29
中国银行股		19 平安银行永		
份有限公司	1928038	续债 01	400,000	40,533,078.36
中国银行股		20 南京银行二		
份有限公司	2020022	级 01	100,000	10,413,846.72
中国银行股		20 南京银行二		
份有限公司	2020022	级 01	500,000	52,069,233.61
中国银行股		•• = + 1 +	100.001	11.1=1.0=0.01
份有限公司	2023005	20 平安人寿	109,831	11,471,050.04
中国银行股	2022005	20 平点 1 丰	110.526	12 270 555 72
份有限公司	2023005	20 平安人寿	118,536	12,378,555.73
中国银行股	2022005	20 亚克人丰	122.525	12 706 997 26
份有限公司	2023005	20 平安人寿	122,525	12,786,887.36
中国银行股	2023005	20 平安人寿	64,372	6,725,959.46
份有限公司	2023003	20 十女八舟	04,372	0,723,939.40
中国银行股	2028003	20 平安银行永	1,000,000	101,409,983.56
份有限公司	2028003	续债 01	1,000,000	101,409,963.30
中国银行股	2028003	20 平安银行永	1,500,000	156,648,766.44
份有限公司	2020003	续债 01	1,300,000	130,040,700.44
中国银行股	2028003	20 平安银行永	135,985	14,264,839.51
份有限公司	2020003	续债 01	133,703	1 1,20 1,037.31
中国银行股	2028003	20 平安银行永	246,544	25,030,414.29
份有限公司	2020003	续债 01	210,511	20,000,111.27
中国银行股	2028003	20 平安银行永	331,422	33,649,979.89
份有限公司	202000	续债 01	221,122	22,0.2,272.02
中国银行股	2028003	20 平安银行永	795	83,337.74
份有限公司		续债 01	,,,,	35,55,77
中国银行股	2028003	20 平安银行永	80,449	8,154,300.73
份有限公司		续债 01	,	-,,,
中国银行股	2028003	20 平安银行永	82,181	8,334,223.12
份有限公司		续债 01	- , - -	,, , , , , , , , , , , , , , , , , ,

	I			
中国银行股	2028003	20 平安银行永	828,555	84,124,910.00
份有限公司		续债 01		
中国银行股	2028024	20 中信银行二	100,000	10,407,002.60
份有限公司		级		
中国银行股	2028024	20 中信银行二	200,000	20,814,005.21
份有限公司		级		
中国银行股 份有限公司	2028024	20 中信银行二 级	900,000	93,663,023.42
中国银行股		20 恒丰银行永		
份有限公司	2028052	20 巨十城 17 水 续债	133,196	13,963,675.51
中国银行股		20 恒丰银行永		
份有限公司	2028052	续债	410,906	43,149,833.60
中国银行股		21 民生银行永		
份有限公司	2128016	续债 01	22,034	2,353,522.93
中国银行股		21 民生银行永		
份有限公司	2128016	续债 01	44,068	4,706,129.26
中国银行股		21 建设银行二		
份有限公司	2128025	级 01	200,000	20,725,032.33
中国银行股		21 建设银行二		
份有限公司	2128025	级 01	300,000	31,087,548.49
中国银行股	2202050	22 北江唐 62	1 000 000	102 010 212 66
份有限公司	2292059	22 浙江债 62	1,000,000	103,810,313.66
中国银行股	2205250	22 广大佳 22	1 000 000	104 040 ((2.20
份有限公司	2305350	23 广东债 23	1,000,000	104,040,662.30
中国银行股	2371263	23 重庆债 58	500,000	51,840,186.07
份有限公司	23/1203	23 里八顷 36	300,000	31,040,100.07
中国银行股	2371363	23 山西债 63	100,000	10,234,327.98
份有限公司	23/1303	23 田酉顷 03	100,000	10,234,327.76
中国银行股	2405005	24 山东债 01	1,000,000	100,322,984.70
份有限公司	2103003	21 出入版 01	1,000,000	100,322,701.70
中国银行股	2405005	24 山东债 01	200,000	20,067,756.94
份有限公司				
中国银行股	2405005	24 山东债 01	300,000	30,101,635.41
份有限公司			<u> </u>	, ,
中国银行股	2405005	24 山东债 01	500,000	50,165,913.11
份有限公司			, , , , , , , , , , , , , , , , , , ,	
中国银行股	2405005	24 山东债 01	500,000	50,161,492.35
份有限公司				
中国银行股	2405005	24 山东债 01	500,000	50,173,813.11
份有限公司				

中国银行股				
份有限公司;				
中银国际证	190311	19 进出 11	33,587	3,429,048.82
券股份有限				
公司				
中国银行股				
份有限公司;		10 亚克坦尔一		
中银国际证	1928010	19 平安银行二	293,564	30,526,618.36
券股份有限		级		
公司				
中国银行股				
份有限公司;				
中银国际证	1928010	19 平安银行二	500,000	52,114,786.89
券股份有限		级		
公司				
中国银行股				
份有限公司;				
中银国际证	1928013	19 民生银行永	108,788	11,303,307.77
券股份有限	1720013	续债	100,700	11,303,307.77
公司				
中国银行股				
份有限公司;				
中银国际证	1928013	19 民生银行永	165,711	17,292,098.10
→ 下版国 M M M M M M M M M M M M M M M M M M M	1928013	续债	103,711	17,292,096.10
公司 公司				
中国银行股				
份有限公司;	1020012	19 民生银行永	240.566	25 020 147 14
中银国际证	1928013	续债	248,566	25,938,147.14
券股份有限				
公司				
中国银行股				
份有限公司;	1020012	19 民生银行永	222.526	22.724.262.22
中银国际证	1928013	续债	323,586	33,724,060.02
券股份有限				
公司				
中国银行股				
份有限公司;		19 民生银行永		
中银国际证	1928013	续债	82,855	8,646,049.05
券股份有限				
公司				

中国银行股份有限公司; 中银国际证					
中国電子形			19 丁商银行永		
### (200,000	中银国际证	1928018		1,975	203,562.49
中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国国际证券股份有限公司; 中国国行股份有限公司; 中国国行股份有限公司; 中国国行股份有限公司; 中国国行股份有限公司; 中国国行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国国行股份有限公司; 中国国行股份有限公司; 中国国行股份有限公司; 中国国行股份有限公司; 中国国行股份有限公司; 中国国行股份有限公司; 中国国行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国国行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国国际证券股份有限公司; 中国国际证券股份有限公司; 中国国际证券股份有限公司; 中国国际证券股份有限公司; 中国国际证券股份有限公司; 中国国际证券股份有限公司;	券股份有限				
	公司				
中银国际证券股份有限公司 1928018 19工商银行水	中国银行股				
中国银行股 分育限公司; 中国银行股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 参股份有限公司; 中银国际证 参股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 全域债 331,422 33,559,315.55	份有限公司;		10 工商组行业		
#	中银国际证	1928018		200,000	20,696,280.00
中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司 中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国国际证券股份有限公司; 中国银行及份有限公司; 中国银行及份有限公司; 中国银行及份有限公司; 中国银行及份有限公司; 中国银行及份有限公司; 中国银行及份有限公司; 中国银行及份有限公司; 中国银行及份有限公司; 中国银行及份有限公司; 中国银行及份有限公司; 中国银行及份有限公司; 中国银行及份有限公司; 中国银行及份有限公司; 中国银行及份子。 分子。 分子。 分子。 分子。 分子。 分子。 分子。 分子。 分子。 分	券股份有限		发		
	公司				
中银国际证券股份有限公司 1928018 19 工商银行水 集债 400,000 41,442,087.67 中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限 20 邮储银行水 集债 246,544 24,943,004.14	中国银行股				
中報国际证券股份有限 公司	份有限公司;		10 工商組伝表		
寿股份有限公司;中银国际证券股份有限 20 邮储银行水 (集债) 24,943,004.14	中银国际证	1928018		400,000	41,442,087.67
中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司;中国证债权公司证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债	券股份有限		头 饭		
份有限公司; 中银国际证券股份有限公司 中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 20 邮储银行永 续债 331,422 33,559,315.55	公司				
中银国际证券股份有限公司;中国际证券股份有限公司;中国际证券股份有限公司;中国际证券股份有限公司;中国际证券股份有限公司;中国际证券股份有限公司;中国际证券股份有限公司。20 邮储银行承费公司 20 邮储银行承费公司 331,422 33,559,315.55	中国银行股				
中報国标证 券股份有限 公司 1928018 续债 4 800,000 82,785,120.00 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 100,000 10,503,274.52 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 81,591 8,531,534.44 少有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司 2028006 20 邮储银行永 续债 246,544 24,943,004.14 少有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限 20 邮储银行永 续债 331,422 33,559,315.55 券股份有限 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 2028006 20 邮储银行永 续债 331,422 33,559,315.55	份有限公司;		10 工商組伝表		
寿股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 券股份有限公司; 中银国际证 务股份有限公司; 中银国际证 务股份有限公司; 中银国际证 务股份有限公司; 中银国际证 务股份有限公司; 中银国际证 务股份有限公司; 中国国际正 务股份有限公司; 中国国际在 务股份有限公司; 中国国际在 务股份有限公司; 中国国际在 务股份有限公司; 中国国际在 务民会 身际公司。 每日本 每日本 每日本 每日本 每日本 每日本 每日本 每日本 每日本 每日本	中银国际证	1928018		800,000	82,785,120.00
中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限	券股份有限		兴 恒		
份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司 中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限 20 邮储银行永 续债 246,544 24,943,004.14	公司				
中银国际证券股份有限公司 2020016 20 江苏银行永 续债 100,000 10,503,274.52 中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限 20 邮储银行永 续债 246,544 24,943,004.14 分司 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限 20 邮储银行永 续债 331,422 33,559,315.55	中国银行股				
中報国际证券股份有限公司;中国银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司;中银国际证券股份有限公司;中国银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司;中银国际证券股份有限 20 邮储银行永续债 24,943,004.14	份有限公司;		20次世紀行		
寿股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司;中银国际证券股份有限公司;中国银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司;中银国际证券股份有限公司;中银国际证券股份有限 20 邮储银行永续债 246,544 24,943,004.14	中银国际证	2020016		100,000	10,503,274.52
中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司 中国银行股份有限公司 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司;	券股份有限		兴 恒		
份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 20 邮储银行永 续债 246,544 24,943,004.14	公司				
中银国际证券股份有限公司;中银国际证券股份有限公司;中银国际证券股份有限公司;中银国际证券股份有限公司;中国银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司;中银国际证券股份有限 20 邮储银行永续债 246,544 24,943,004.14	中国银行股				
中银国际证券股份有限公司;中银国际证券股份有限公司;中银国际证券股份有限公司;中国银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司;中银国际证券股份有限 20 邮储银行永续债 24,943,004.14	份有限公司;		20次世紀行		
	中银国际证	2020016		81,591	8,531,534.44
中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司 中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司; 中银国际证券股份有限	券股份有限				
份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司 20 邮储银行永 续债 246,544 24,943,004.14 中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 20 邮储银行永 续债 331,422 33,559,315.55	公司				
中银国际证	中国银行股				
中银国际证券股份有限公司 2028006 中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限 2028006 20 邮储银行永续债 331,422 33,559,315.55	份有限公司;		20 hp/h/hp/= 3.		
寿股份有限 公司 中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 20 邮储银行永 续债 331,422 33,559,315.55	中银国际证	2028006		246,544	24,943,004.14
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 2028006	券股份有限		()		
份有限公司; 中银国际证 券股份有限 2028006	公司				
中银国际证 2028006	中国银行股				
中银国际证 2028006	份有限公司;		20 hg/h/hg/= 3.		
寿股份有限	中银国际证	2028006		331,422	33,559,315.55
公司	券股份有限				
	公司				

中国银行股 份有限公司;				
中银国际证	2028006	20 邮储银行永	410,906	41,590,661.36
券股份有限		续债		,,
公司				
中国银行股				
份有限公司;		20 hp/h/fp/= 3.		
中银国际证	2028006	20 邮储银行永	497,133	50,338,973.34
券股份有限		续债		
公司				
中国银行股				
份有限公司;		20 加州共和		
中银国际证	2028006	20 邮储银行永	575,268	58,206,038.15
券股份有限		续债		
公司				
中国银行股				
份有限公司;		20 邮储银行永		
中银国际证	2028006	20 m 個 報 行 水	700,000	70,881,003.70
券股份有限		少 似		
公司				
中国银行股				
份有限公司;		20 邮储银行永		
中银国际证	2028006	续债	745,699	75,513,463.34
券股份有限		安		
公司				
中国银行股				
份有限公司;		20 邮储银行永		
中银国际证	2028006	续债	80,449	8,145,861.63
券股份有限		一		
公司				
中国银行股				
份有限公司;		20 邮储银行永		
中银国际证	2028006	续债	82,855	8,390,384.82
券股份有限				
公司				
中国银行股				
份有限公司;		20 农业银行永		
中银国际证	2028017	续债 01	164,362	17,108,352.81
券股份有限				
公司				

中国银行股				
份有限公司;		20 农业银行永		
中银国际证	2028017	续债 01	200,000	20,832,591.78
券股份有限		次		
公司				
中国银行股				
份有限公司;		20 农业银行永		
中银国际证	2028017	建债 01	246,544	25,652,412.49
券股份有限		──		
公司				
中国银行股				
份有限公司;		20 中川畑石 社		
中银国际证	2028017	20 农业银行永	400,000	41,458,043.84
券股份有限		续债 01		
公司				
中国银行股				
份有限公司;		20 4 11 12 12 12		
中银国际证	2028017	20 农业银行永	500,000	51,568,908.22
券股份有限		续债 01		
公司				
中国银行股				
份有限公司;				
中银国际证	2028017	20 农业银行永	700,000	72,914,071.23
券股份有限		续债 01		
公司				
中国银行股				
份有限公司;				
中银国际证	2028017	20 农业银行永	800,000	83,349,194.52
券股份有限		续债 01	, , , , , ,	
公司				
中银国际证				
券股份有限	1928006	19 工商银行二	47,019	4,957,942.13
公司		级 01	- ,	,
中银国际证				
券股份有限	1928014	19 华夏银行永	500,000	52,116,604.79
公司		续债	- 00,000	,,
中银国际证				
券股份有限	1928014	19 华夏银行永	821,812	85,617,582.38
公司	1,20011	续债	021,012	00,017,002.00
中银国际证				
券股份有限	1928021	19 农业银行永	1,643,623	169,818,271.32
公司	1720021	续债 01	1,013,023	107,010,271.32
AH				

中银国际证 券股份有限	1928021	19 农业银行永 续债 01	1,975	203,145.62
公司		次顶 U1		
中银国际证				
券股份有限	1928021	19 农业银行永	200,000	20,658,535.90
公司		续债 01	,	, ,
中银国际证				
券股份有限	1928021	19 农业银行永	237,936	24,505,269.72
公司	1,20021	续债 01	237,330	21,503,203.72
中银国际证				
- K	1928021	19 农业银行永	410,906	42,445,154.15
公司	1720021	续债 01	410,500	72,773,137.13
中银国际证				
	1020021	19 农业银行永	500,000	51 (46 220 72
券股份有限	1928021	续债 01	500,000	51,646,339.73
公司				
中银国际证	1000001	19 农业银行永	500	01.400.25
券股份有限	1928021	续债 01	792	81,489.27
公司				
中银国际证		19 农业银行永		
券股份有限	1928023	续债 02	1,400,000	144,186,914.79
公司		2000		
中银国际证		19 农业银行永		
券股份有限	1928023	续债 02	1,975	202,548.36
公司		关顶 02		
中银国际证		19 农业银行永		
券股份有限	1928023		100,000	10,231,902.88
公司		续债 02		
中银国际证		10 th 11 to 4 3.		
券股份有限	1928023	19 农业银行永	200,000	20,463,805.75
公司		续债 02		
中银国际证				
券股份有限	1928023	19 农业银行永	328,725	33,858,642.49
公司		续债 02	,	,,
中银国际证				
券股份有限	1928023	19 农业银行永	410,906	42,337,205.80
公司	1,20023	续债 02	110,200	12,557,205.00
中银国际证				
券股份有限	1928023	19 农业银行永	414,277	42,709,967.81
	1740043	续债 02	414,4//	42,/02,70/.01
公司				
中银国际证	1020022	19 农业银行永	500.000	51 100 004 30
券股份有限 (A) =1	1928023	续债 02	500,000	51,162,864.38
公司				

中银国际证	1020022	19 农业银行永	702	01.240.60
券股份有限 公司	1928023	续债 02	792	81,249.68
中银国际证				
一	1928023	19 农业银行永	82,855	8,541,993.57
公司		续债 02	- ,	, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,
中银国际证		10		
券股份有限	1928025	19 交通银行永	100,000	10,221,049.34
公司		续债		
中银国际证		19 交通银行永		
券股份有限	1928025	(本)	100,000	10,221,049.34
公司				
中银国际证		19 交通银行永		
券股份有限	1928025	续债	2,000,000	205,785,888.52
公司				
中银国际证券股份有限	1928025	19 交通银行永	2 276	242 496 99
分成衍有限公司	1928023	续债	2,376	243,486.88
中银国际证				
一	1928025	19 交通银行永	316,222	32,447,169.07
公司	1,20020	续债	010,===	2,,,
中银国际证		10		
券股份有限	1928025	19 交通银行永	331,422	34,137,937.11
公司		续债		
中银国际证		19 交通银行永		
券股份有限	1928025	女债	79,055	8,111,792.27
公司				
中银国际证		20 农业银行二		
券股份有限	2028013	级 01	100,000	10,320,935.41
公司				
中银国际证券股份有限	2028018	20 交通银行二	100,000	10,343,034.93
分 放 份 有 限 公 司	2020018	级	100,000	10,343,034.93
中银国际证				
券股份有限	2028018	20 交通银行二	200,000	20,677,354.52
公司		级	,	,,
中银国际证		20日出出公一		
券股份有限	2028022	20 民生银行二	118,536	12,334,971.58
公司		级		
中银国际证		20 民生银行二		
券股份有限	2028022	级 经	164,362	17,115,700.48
公司		7.		

中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二级	23,707	2,466,824.24
中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二级	23,707	2,466,824.24
中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二级	71,121	7,400,472.73
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	100,000	10,462,664.25
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	414,277	43,344,159.04
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	600,000	62,725,610.96
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	900,000	94,088,416.44
中银国际证 券股份有限 公司	254165	24 厦国 K1	2,455	245,538.00

本产品于 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日期间投资于关联方发行的资产管理产品

学 联子 复 45	资产管理	资产管理产品	报告期内买入资产管理产品	
关联方名称	产品代码	简称	数量(单位:份)	总金额(单位:元)
-	-	-	-	-

本产品于 2024年1月1日至 2024年3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	28,607,984.44
产品托管费	中国银行股份有限公司	2,258,947.54
分销买入	中国银行股份有限公司	11,880,948.00

八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市,高质量发展转型阶段,稳增长对冲和托底作用可能大于刺激,债券仍处于 牛市环境;对流动性的博弈依旧为行情变化的重要来源,利空有限的时间段以配置的思路 进行操作和应对更为合适;资产荒仍将持续,曲线平坦的状态可能维持较长时间,信用、 期限利差维持低位。产品管理人将维持票息为主,维持产品杠杆,同时严控组合久期,积 极捕捉交易机会,努力维持产品稳健特征,力争提高产品净值表现。