

中银理财-（3 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	CYQZQ3M
理财产品名称	中银理财-（3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	Z7001021000526
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	2021-09-23
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
CYQZQ3MA	4,439,453,661.54	1.051033	1.051033	4,666,013,410.65	2.14%
CYQZQ3MB	1,653,313,470.01	1.053579	1.053579	1,741,897,312.68	2.24%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：105.40%

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	32,780.59	5.11%	131,810.74	19.88%
同业存单	-	0.00%	15,023.62	2.27%
拆放同业及买入 返售	30,000.00	4.68%	30,675.84	4.63%
债券	12,000.94	1.87%	474,033.00	71.49%
非标准化债权类 资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	769.96	0.12%
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%	10,781.88	1.63%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	566,249.68	88.33%	-	0.00%
合计	641,031.21	100%	663,095.05	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	37,724.61	5.69%
2	1928018：19 工商银行永续债	12,075.21	1.82%
3	019703：23 国债 10	12,000.94	1.81%
4	TRADE_6759278：交易所逆回购	10,000.00	1.51%
5	TRADE_6751489：交易所逆回购	10,000.00	1.51%
6	TRADE_6753908：交易所逆回购	10,000.00	1.51%
7	229ND002X：存放同业	8,984.23	1.35%
8	229TD003X：存放同业	8,984.23	1.35%
9	DQ033386：存放同业	7,100.95	1.07%
10	TD20220331：存放同业	6,892.16	1.04%

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（3个月最短持有期固收增强）
账号	745875169384
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

产品在报告期内，产品所持有资产结构合理，其中有较高比例的高流动性资产，尽力满足客户赎回需求，同时产品杠杆在报告期内杠杆也较低，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

2023年债券市场年初由于受2022年年末流动性影响叠加疫情消退经济强复苏预期影响，整体偏谨慎，但之后随着各项经济数据不及预期，经济复苏缓和，加上货币政策不断宽松，债券收益率一路下行，走出了一个牛市。该产品在报告期内，通过调整产品的久期和杠杆获得收益，在短久期债券收益率下行时，进行了短券加杠杆操作，在长久期债券收益率下行时，适当增配了长久期债券资产比例，获得一定收益。

（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）

中银国际证 券股份有 限公 司	180389	G 电建 2A	10,179	1,035,156.47
中银国际证 券股份有 限公 司	183965	22 电 2A	11,310	1,155,863.10

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	012383442	23 云建投 SCP019	19,640	1,964,000.00
中国银行股份有限公司	012384302	23 凤城河 SCP004	29,112	2,911,226.50
中国银行股份有限公司	012384563	23 东泰投资 SCP001	14,444	1,444,421.90
中国银行股份有限公司	032100916	21 洛阳城乡 PPN004	4,147	426,060.55
中国银行股份有限公司	032100916	21 洛阳城乡 PPN004	8,991	932,957.62
中国银行股份有限公司	032191214	21 青岛城投 PPN002	9,820	1,016,902.62
中国银行股份有限公司	032191214	21 青岛城投 PPN002	9,820	1,016,902.62
中国银行股份有限公司	032380089	23 晋江建投 PPN001	377	38,785.06
中国银行股份有限公司	032380089	23 晋江建投 PPN001	8,991	937,444.67
中国银行股份有限公司	032380198	23 吴中国裕 PPN001	14,150	1,415,000.00
中国银行股份有限公司	032380359	23 吴中经发 PPN002	11,310	1,131,000.00
中国银行股份有限公司	032380965	23 上饶城投 PPN003	2,749	277,835.54
中国银行股份有限公司	042380569	23 云能投 CP012	19,640	1,964,000.00
中国银行股份有限公司	082280714	22 丰田租赁 ABN001 优先	100,530	3,775,776.11
中国银行股份有限公司	082380820	23 华电山西 ABN001 优先	30,892	3,089,237.40
中国银行股份有限公司	082380908	23 晋租 2 号 ABN002 优先	67,486	6,748,624.80

中国银行股份有限公司	092280003	22 中国信达债 01	7,540	752,001.17
中国银行股份有限公司	102101334	21 鲁高速 MTN004	19,200	1,933,455.95
中国银行股份有限公司	102101617	21 陕延油 MTN003	754	77,864.25
中国银行股份有限公司	102101832	21 建发 MTN001	5,267	535,672.59
中国银行股份有限公司	102101899	21 京住总集 MTN003B	12,857	1,300,593.82
中国银行股份有限公司	102102148	21 中建四局 MTN001	15,080	1,551,811.37
中国银行股份有限公司	102102329	21 中建四局 MTN002	30,160	3,089,752.19
中国银行股份有限公司	102300544	23 晋能煤业 MTN010	14,693	1,469,276.10
中国银行股份有限公司	102300571	23 金辉集团 MTN002	8,644	864,355.20
中国银行股份有限公司	102380816	23 福瑞能源 MTN001	3,770	377,000.00
中国银行股份有限公司	102380843	23 水电八局 MTN001	3,770	377,040.89
中国银行股份有限公司	102380846	23 中广核租 MTN002(碳中和 和债)	5,655	565,500.00
中国银行股份有限公司	102381241	23 新创建 MTN001BC	33,510	3,351,000.00
中国银行股份有限公司	102381255	23 桂铁投 MTN001	5,585	558,500.00
中国银行股份有限公司	102381341	23 首农食品 MTN002	19,980	1,998,000.00
中国银行股份有限公司	102381363	23 中化股 MTN001	19,980	1,998,000.00
中国银行股份有限公司	102381458	23 龙岩汇金 MTN001	9,990	999,000.00
中国银行股份有限公司	102381462	23 粤环保 MTN002	49,950	4,995,000.00
中国银行股份有限公司	102381466	23 北部湾 MTN002	9,990	999,000.00
中国银行股份有限公司	102381495	23 柯桥开发 MTN001	19,980	1,998,000.00
中国银行股份有限公司	102381573	23 南昌轨交 MTN003(绿色)	3,776	377,600.00

中国银行股份有限公司	102381635	23 粤交投 MTN002A	9,440	944,000.00
中国银行股份有限公司	102381755	23 瘦西湖 MTN003	28,320	2,832,000.00
中国银行股份有限公司	102381781	23 长沙水业 MTN003	9,440	944,000.00
中国银行股份有限公司	102382060	23 吉利汽车 MTN001	70,750	7,075,000.00
中国银行股份有限公司	102382076	23 光大控股 MTN001	42,450	4,245,000.00
中国银行股份有限公司	102382080	23 陕有色 MTN001	70,750	7,075,000.00
中国银行股份有限公司	102382092	23 大唐集 MTN009	28,300	2,830,000.00
中国银行股份有限公司	102382117	23 成都环境 MTN003	28,300	2,830,000.00
中国银行股份有限公司	102382347	23 郑州公用 MTN002	22,680	2,268,000.00
中国银行股份有限公司	102382354	23 武金控 MTN004	5,320	532,000.00
中国银行股份有限公司	102382366	23 泉州水务 MTN002	11,340	1,134,000.00
中国银行股份有限公司	102382418	23 光大控股 MTN002	33,540	3,354,000.00
中国银行股份有限公司	102382424	23 三明高速 MTN001(革命 老区)	16,770	1,677,000.00
中国银行股份有限公司	102382436	23 大唐集 MTN014	16,770	1,677,000.00
中国银行股份有限公司	102382465	23 云南机场 MTN001	56,700	5,670,000.00
中国银行股份有限公司	102382501	23 华发实业 MTN003A	11,340	1,134,000.00
中国银行股份有限公司	102382528	23 中交天航 MTN001(科创 票据)	33,540	3,354,000.00
中国银行股份有限公司	102382589	23 象屿股份 MTN002	33,540	3,354,000.00
中国银行股份有限公司	102382594	23 华侨城 MTN005	50,310	5,031,000.00
中国银行股份有限公司	102382700	23 京住总集 MTN002	11,338	1,133,833.00
中国银行股份有限公司	102382700	23 京住总集 MTN002	85,451	8,545,127.00

中国银行股份有限公司	102382703	23 湘建工 MTN002(科创 票据)	17,090	1,709,025.40
中国银行股份有限公司	102382772	23 陕有色 MTN002	16,820	1,681,995.40
中国银行股份有限公司	102382856	23 北电 MTN001	298,677	29,867,733.00
中国银行股份有限公司	102382878	23 中交天航 MTN002(科创 票据)	160,455	16,045,533.00
中国银行股份有限公司	102382920	23 武商贸集 MTN002	16,046	1,604,553.30
中国银行股份有限公司	102382923	23 天津港 MTN001(科创 票据)	16,046	1,604,553.30
中国银行股份有限公司	102383017	23 新创建 MTN002BC	29,002	2,900,165.20
中国银行股份有限公司	102383076	23 中建七局 MTN002(科创 票据)	12,808	1,280,844.90
中国银行股份有限公司	132380060	23 三峡 GN001	42,450	4,245,000.00
中国银行股份有限公司	132380065	23 华能水电 GN015	34,020	3,402,000.00
中国银行股份有限公司	132380067	23 晋能电力 GN011(碳中和 债)	11,340	1,129,558.64
中国银行股份有限公司	1928002	19 民生银行二 级 01	51,729	5,363,203.77
中国银行股份有限公司	1928002	19 民生银行二 级 01	6,429	664,067.36
中国银行股份有限公司	1928002	19 民生银行二 级 01	9,643	996,137.69
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	71,888	7,571,637.49
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永 续债 01	10,243	1,075,044.48
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永 续债 01	10,243	1,074,580.81
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永 续债 01	11,564	1,213,454.39
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永 续债 01	11,645	1,221,728.17

中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	13,168	1,380,725.89
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	17,467	1,832,592.25
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	2,561	268,645.20
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	2,634	276,138.42
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	5,186	544,040.13
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	5,267	552,276.84
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	79,380	8,236,926.49
中国银行股份有限公司	2320022	23 杭州银行 01	3,996	399,600.00
中国银行股份有限公司	2320031	23 华润银行小微债 01	9,440	944,000.00
中国银行股份有限公司	2320041	23 南京银行 01	14,150	1,415,000.00
中国银行股份有限公司	2320056	23 广州银行绿色债 02	12,536	1,253,561.10
中国银行股份有限公司	2320063	23 海峡银行小微债 03	15,751	1,575,108.30
中国银行股份有限公司	2322010	23 福特汽车债 02	14,150	1,415,000.00
中国银行股份有限公司	2322014	23 福特汽车债 03	12,536	1,253,561.10
中国银行股份有限公司	2322017	23 招银金租债 01	12,451	1,245,124.60
中国银行股份有限公司	2322018	23 兴业消费金融债 01	15,751	1,575,108.30
中国银行股份有限公司	2322019	23 招银金租债 02	30,249	3,024,859.00
中国银行股份有限公司	232380026	23 厦门国际二级资本债 01	9,440	944,000.00
中国银行股份有限公司	232380063	23 创兴银行二级资本债 01BC	33,540	3,354,000.00
中国银行股份有限公司	233001	23 工银澳门债	3,770	377,000.00
中国银行股份有限公司	242300001	23 宁波银行永续债 01	18,880	1,888,000.00

中国银行股份有限公司	242380014	23 富邦华一永续债 01	11,328	1,132,800.00
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	134,554	13,455,364.00
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	14,693	1,477,267.90
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	29,386	2,960,064.52
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	44,078	4,440,096.78
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	55,345	5,577,477.60
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	69,181	6,971,847.00
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	73,464	7,400,161.30
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	27,672	2,788,631.85
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	29,002	2,903,239.77
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	29,386	2,953,453.31
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	41,509	4,183,317.51
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	43,502	4,354,859.66
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	503,100	50,310,000.00
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	69,181	6,972,195.85
中国银行股份有限公司	272380012	23 泰康养老资本补充债 01	56,700	5,670,000.00
中国银行股份有限公司	272380014	23 东方二级资本债 01BC	83,850	8,385,000.00
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	153,178	15,317,779.00
中国银行股份有限公司	282380005	23 太平人寿永续债 01	14,406	1,440,592.00
中国银行股份有限公司	292380007	23 加拿大银行债 01BC	16,046	1,604,553.30

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	7,600	781,580.00
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	19,000	1,936,710.79
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	19,000	1,937,806.62
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	19,000	1,935,359.73
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	76,000	7,753,942.89
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2128021	21 工商银行永续债 01	67,080	6,910,984.54
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2128021	21 工商银行永续债 01	83,850	8,640,927.54
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	222380003	23 兴业银行绿债 01	3,770	377,000.00

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	42,450	4,245,000.00
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	232380034	23 厦门国际二级资本债 02	16,770	1,677,000.00
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	34,020	3,377,339.07
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	56,700	5,631,444.28
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	566,000	56,600,000.00
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	83,850	8,301,808.84
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	90,720	9,020,098.94
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	18,043	1,864,501.25

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	19,273	1,991,439.47
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	19,907	2,056,983.89
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	49,767	5,142,459.74
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	49,767	5,144,106.78
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	10,103	1,042,170.26
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	102,414	10,582,246.30
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	29,112	3,003,445.22
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	5,122	528,236.88

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	51,207	5,292,054.49
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	77,827	8,046,974.56
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	10,996	1,125,384.64
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	13,168	1,348,813.07
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	13,168	1,348,563.10
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	16,072	1,642,914.71
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	16,072	1,642,852.03
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	19,242	1,969,829.29

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	2,749	281,384.39
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	3,082	314,851.01
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	30,817	3,149,002.42
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	5,052	517,706.50
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	5,186	531,177.50
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	5,498	562,768.78
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	5,498	562,806.22
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	5,498	562,806.22

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	6,163	629,749.48
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	6,319	645,873.52
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	7,577	776,559.75
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	8,718	891,413.51
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	9,245	944,409.74
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2128021	21 工商银行永 续债 01	16,820	1,738,052.67
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	27,672	2,777,029.77
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	83,017	8,331,089.30

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	308,924	30,892,374.00
中银国际亚洲有限公司	02020	港股通	1,097	102,781.66
中银国际亚洲有限公司	02020	港股通	1,207	113,744.70
中银国际亚洲有限公司	02020	港股通	132	12,065.91
中银国际亚洲有限公司	02020	港股通	176	15,131.42
中银国际证券股份有限公司	183965	22 电 2A	11,310	1,155,863.10
中银国际证券股份有限公司	1928004	19 农业银行二级 02	15,419	1,594,707.06
中银国际证券股份有限公司	1928004	19 农业银行二级 02	18,043	1,866,011.80
中银国际证券股份有限公司	1928004	19 农业银行二级 02	3,855	398,676.76
中银国际证券股份有限公司	1928004	19 农业银行二级 02	38,000	3,911,278.51
中银国际证券股份有限公司	1928004	19 农业银行二级 02	49,767	5,148,890.99
中银国际证券股份有限公司	1928006	19 工商银行二级 01	38,000	3,908,981.03
中银国际证券股份有限公司	1928009	19 农业银行二级 04	38,000	3,905,141.70
中银国际证券股份有限公司	1928011	19 工商银行二级 03	7,600	780,996.59
中银国际证券股份有限公司	1928014	19 华夏银行永续 债	23,247	2,392,805.69

中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	30,817	3,169,197.64
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	10,996	1,122,855.57
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	10,996	1,123,103.98
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	12,804	1,308,804.57
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	12,804	1,308,804.57
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	13,168	1,345,702.52
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	13,168	1,345,605.44
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	13,745	1,403,773.76
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	2,749	280,775.99
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	27,489	2,807,770.68
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	8,718	889,602.25
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	12,804	1,305,210.61
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	12,804	1,304,509.05
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	19,000	1,926,184.68

中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	19,000	1,928,357.68
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	5,498	559,848.24
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	7,577	772,386.49
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	8,247	839,772.37
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	11,400	1,201,895.60
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	35,944	3,649,997.60
中银国际证 券股份有限 公司	252674	23 嵊交 D2	16,034	1,603,396.65
中银国际证 券股份有限 公司	300232	洲明科技	10,356	86,656.75
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	1,031	21,366.05
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	1,393	28,867.45
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	3,763	77,888.10
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	5,485	117,485.63
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	614	12,925.29
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	680	14,316.95

中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	143	13,115.84
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	186	17,898.32
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	197	17,569.66
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	197	18,381.99
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	801	73,001.84
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	998	88,452.32
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	4,180	118,885.84
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	21,578	118,678.95
中银国际证 券股份有限 公司	601800	中国交建	1,338	15,426.67
中银国际证 券股份有限 公司	601800	中国交建	2,084	22,239.48
中银国际证 券股份有限 公司	601800	中国交建	2,973	35,823.08
中银国际证 券股份有限 公司	601800	中国交建	5,935	73,392.48
中银国际证 券股份有限 公司	601800	中国交建	6,944	73,884.27
中银国际证 券股份有限 公司	601800	中国交建	9,237	102,860.31

中银国际证 券股份有限 公司	601808	中海油服	3,878	57,251.56
中银国际证 券股份有限 公司	601808	中海油服	6,399	97,833.03
中银国际证 券股份有限 公司	601808	中海油服	6,496	97,326.89
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	1,141	12,777.86

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	ZYLCZYZ Q202122	中银证券中国 红-汇中 22 号 集合资产管理 计划	957,212,597	1,000,000,000.00
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	5,688,929	5,000,000.00
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	5,939,653	5,000,000.00

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	28,636,996.57
产品托管费	中国银行股份有限公司	2,118,302.74
1 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	202,639,874.40
3 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	56,288,000.00
3 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公 司	14,356,000.00

7日质押式正回购	中银基金管理有限公司	136,770,400.00
现券买入	中国银行股份有限公司	128,688,520.50
现券买入	中银国际证券股份有限公司	30,844,788.39
现券卖出	中银国际证券股份有限公司	12,327,813.21
证券交易佣金	中银国际证券股份有限公司	15,921.86

八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市，经济内生动能弱，货币大概率维持宽松，叠加目前的信用债资产荒，整体基本面对债券市场仍然友好，但同时也存在不确定性，比如利率债供给的不确定性等。后续产品管理人将继续采取稳健的投资策略，控制产品的久期和杠杆，力争为产品创造较好的收益。

中银理财-（3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-（3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

