

中银理财-稳富（90 天持有期）02

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：中国工商银行股份有限公司

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	GH14205
理财产品名称	中银理财-稳富（90天持有期）02
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000193
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	2022-11-10
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
GH14205A	19,736,554,682.14	1.037235	1.037235	20,471,460,844.86	3.16%
GH14205B	4,826,401,256.50	1.037912	1.037912	5,009,380,934.13	3.21%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：107.15%

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	283,821.69	11.13%	363,497.07	13.52%

同业存单	-	0.00%	8,637.14	0.32%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	72.78	0.00%
债券	-	0.00%	2,291,478.64	85.25%
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%	24,415.65	0.91%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	2,265,639.19	88.87%	-	0.00%
合计	2,549,460.88	100%	2,688,101.28	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	321,449.60	11.96%
2	1928018：19 工商银行永续债	77,319.31	2.88%
3	1928021：19 农业银行永续债 01	36,038.01	1.34%
4	1928038：19 平安银行永续债 01	27,493.77	1.02%
5	1928013：19 民生银行永续债	25,936.19	0.96%
6	1928023：19 农业银行永续债 02	21,412.25	0.80%
7	180335：工鑫 12A	20,314.77	0.76%
8	1928004：19 农业银行二级 02	19,764.62	0.74%
9	1928010：19 平安银行二级	19,324.50	0.72%
10	137625：22 银河 C5	18,183.17	0.68%

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	工商银行托管专户—中银理财稳富 90 天持有期 02
账号	1001252429200322924
开户行	中国工商银行股份有限公司上海市虹口支行

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，以及根据流动性新规要求设置大额赎回机制，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

2023 年经济内生需求不足，基本面表现弱于预期，央行两次降准降息，推动收益率曲线平坦化下行；地方债务化债政策有效缓解信用风险，信用利差大幅收窄，高收益资产稀缺。投资操作方面，产品管理人积极参与各类债券、资产证券化资产的配置，夯实产品收益，阶段性参与波段交易增厚组合净值，保持产品适度的杠杆率、在保障产品流动性安全的前提下获取杠杆套息收益。

（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）

中国工商银行(澳门)股份有限公司	233001	23 工银澳门债	17,880	1,788,000.00
中国工商银行股份有限公司	112302022	23 工商银行 CD022	188,000	18,320,793.92
中国工商银行股份有限公司	112302030	23 工商银行 CD030	376,000	36,868,680.00
中国工商银行股份有限公司	112302031	23 工商银行 CD031	376,000	36,604,352.00
中国工商银行股份有限公司	112302040	23 工商银行 CD040	457,800	44,606,841.72
中国工商银行股份有限公司	112302040	23 工商银行 CD040	715,200	69,687,228.48
中国工商银行股份有限公司	112302063	23 工商银行 CD063	1,639,222	159,783,863.03
中国工商银行股份有限公司	1928006	19 工商银行二级 01	919,100	94,545,907.04
中国工商银行股份有限公司	1928011	19 工商银行二级 03	183,820	18,889,841.28
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	1,838,200	187,543,392.44
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	161,621	16,563,336.56
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	163,403	16,737,694.20
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	164,640	16,854,014.43
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	164,640	16,854,014.43

中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	164,640	16,852,893.52
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	169,998	17,369,765.56
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	171,043	17,483,132.10
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	242,431	24,845,004.85
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	251,130	25,679,278.22
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	254,997	26,048,732.40
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	3,690	391,267.69
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	329,280	33,701,207.35
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	409,315	41,918,868.29
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	409,315	41,926,638.55
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	435,048	44,470,315.39
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	435,048	44,472,012.07
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	459,550	46,842,917.96
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	459,550	46,810,240.18

中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	459,550	46,869,422.66
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	5,848	597,416.00
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	576,240	58,989,276.24
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	82,320	8,426,446.76
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	84,999	8,684,228.28
中国工商银行股份有限公司	1928018	19 工商银行永续债	849,990	86,855,861.73
中国工商银行股份有限公司	2128021	21 工商银行永续债 01	12,150	1,252,084.31
中国工商银行股份有限公司	2128021	21 工商银行永续债 01	4,814	497,486.39
中国工商银行股份有限公司	2128021	21 工商银行永续债 01	9,720	1,001,412.79
中银国际证券股份有限公司	180389	G 电建 2A	48,276	4,909,442.37
中银国际证券股份有限公司	183965	22 电 2A	53,640	5,481,918.36

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）
中国工商银行股份有限公司	012284373	22 电网 SCP024	14,760	1,495,104.31

中国工商银行股份有限公司	012381026	23 津融投资 SCP001	56,400	5,640,847.54
中国工商银行股份有限公司	012381046	23 瘦西湖 SCP003	39,935	4,037,647.85
中国工商银行股份有限公司	032191420	21 托克集团 PPN001	89,400	9,147,660.52
中国工商银行股份有限公司	042380328	23 津城建 CP007	79,329	8,322,799.36
中国工商银行股份有限公司	102001677	20 中交二航 MTN001	969,700	98,917,934.69
中国工商银行股份有限公司	102002074	20 五矿 MTN001	28,500	2,910,979.23
中国工商银行股份有限公司	102100522	21 南京浦口 MTN001	502,260	52,036,974.72
中国工商银行股份有限公司	102381339	23 湘高速 MTN003	37,800	3,780,000.00
中国工商银行股份有限公司	102381622	23 渝两江 MTN002A	10,200	1,020,000.00
中国工商银行股份有限公司	102381747	23 华电江苏 MTN003(能源保供特别债)	20,400	2,040,000.00
中国工商银行股份有限公司	102381880	23 渝两江 MTN003A	12,750	1,275,000.00
中国工商银行股份有限公司	102382487	23 中船租 MTN002	2,430	243,000.00
中国工商银行股份有限公司	102382576	23 水利十四 MTN003(乡村振兴)	2,430	243,000.00
中国工商银行股份有限公司	102382683	23 深能源 MTN002	2,494	249,428.10

中国工商银行股份有限公司	1920039	19 杭州银行二级	275,730	28,311,153.17
中国工商银行股份有限公司	1920039	19 杭州银行二级	326,806	33,688,526.16
中国工商银行股份有限公司	1920039	19 杭州银行二级	406,001	41,861,282.45
中国工商银行股份有限公司	1920039	19 杭州银行二级	411,600	42,407,234.81
中国工商银行股份有限公司	1920039	19 杭州银行二级	411,600	42,407,234.81
中国工商银行股份有限公司	2028051	20 浦发银行永续债	4,814	517,161.88
中国工商银行股份有限公司	282380003	23 人保健康永续债	13,991	1,399,072.00
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	1928002	19 民生银行二级 01	174,019	17,975,620.84
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	1928002	19 民生银行二级 01	261,029	26,964,423.17
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	1928002	19 民生银行二级 01	7,977	827,067.58
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	153,888	16,145,201.66

中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	163,403	17,143,002.55
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	163,726	17,167,027.64
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	230,832	24,217,802.49
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	233,756	24,528,960.29
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	324,800	34,074,399.75
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	324,800	34,089,102.54
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	409,315	42,918,619.87
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	81,200	8,518,599.94

中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	81,863	8,583,513.82
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	2322014	23 福特汽车债 03	10,229	1,022,873.60
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	2322017	23 招银金租债 01	12,105	1,210,488.80
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	2322019	23 招银金租债 02	27,344	2,734,433.80
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	14,546	1,465,275.11
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	24,244	2,442,125.19
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	38,514	3,851,356.00
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	4,849	487,512.77

中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	57,506	5,795,252.87
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	71,882	7,244,066.09
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	9,698	976,850.08
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	17,860	1,787,883.59
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	26,790	2,681,825.39
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	28,753	2,897,515.30
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	43,129	4,346,657.14
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	71,882	7,244,428.56

中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	9,698	974,668.31
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	138,471	13,847,076.00
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司	292380007	23 加拿大银行债 01BC	5,123	512,263.70
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928010	19 平安银行二级	145,952	15,081,360.32
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928010	19 平安银行二级	364,881	37,715,476.56
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928010	19 平安银行二级	364,881	37,703,400.81
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928010	19 平安银行二级	389,594	40,255,274.59

中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928010	19 平安银行二级	396,643	40,988,369.72
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928013	19 民生银行永续债	162,400	16,750,117.19
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928013	19 民生银行永续债	323,242	33,342,862.61
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928013	19 民生银行永续债	375,440	38,800,197.53
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928013	19 民生银行永续债	384,720	39,690,685.75
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928013	19 民生银行永续债	613,181	63,400,028.94

中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928013	19 民生银行永续债	750,880	77,586,738.30
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	242380017	23 农行永续债 01	28,753	2,885,460.22
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	242380017	23 农行永续债 01	86,258	8,656,380.65
中国工商银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	242380033	23 招行永续债 01	279,263	27,926,308.00
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	251,130	25,627,100.64
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	329,280	33,625,470.76
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	329,280	33,632,909.77

中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	406,001	41,501,513.84
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	406,001	41,501,513.84
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	409,315	41,826,932.20
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	409,315	41,829,949.92
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	411,600	42,037,956.62
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	5,446	555,678.01
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	82,320	8,408,227.44
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	823,199	84,082,595.81

中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928023	19 农业银行永续债 02	164,640	16,765,433.89
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928023	19 农业银行永续债 02	242,431	24,711,486.91
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928023	19 农业银行永续债 02	246,960	25,148,150.84
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928023	19 农业银行永续债 02	406,001	41,387,551.14
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928023	19 农业银行永续债 02	406,001	41,365,305.09
中国工商银行股份有限公司;中银国际证券股份有限公司	1928025	19 交通银行永续债	2,178	221,356.62
中国工商银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	102002200	20 五矿 MTN002	19,000	1,939,567.11
中国工商银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	102101710	21 物产中大 MTN002	969,700	99,296,526.82

中国工商银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102101953	21 戴姆勒财 MTN001BC	28,500	2,886,088.07
中国工商银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102381462	23 粤环保 MTN002	37,800	3,780,000.00
中国工商银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102382060	23 吉利汽车 MTN001	19,600	1,960,000.00
中国工商银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102382594	23 华侨城 MTN005	7,290	729,000.00
中国工商银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	132380060	23 三峡 GN001	11,760	1,176,000.00
中国工商银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2228001	22 邮储银行永 续债 01	2,460	253,368.20
中国工商银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2320022	23 杭州银行 01	3,024	302,400.00
中国工商银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2320041	23 南京银行 01	3,920	392,000.00

中国工商银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	2322010	23 福特汽车债 02	3,920	392,000.00
中国工商银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	232380026	23 厦门国际二级资本债 01	2,550	255,000.00
中国工商银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	233001	23 工银澳门债	17,880	1,788,000.00
中国工商银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	242300001	23 宁波银行永续债 01	5,100	510,000.00
中国工商银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	72,900	7,290,000.00
中国工商银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928010	19 平安银行二级	183,820	18,903,952.07
中国工商银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	222380003	23 兴业银行绿债 01	17,880	1,788,000.00

中国工商银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	232380033	23 成都银行二级资本债 01	11,760	1,176,000.00
中国工商银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	232380034	23 厦门国际二级资本债 02	2,430	243,000.00
中国工商银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	242380017	23 农行永续债 01	12,150	1,202,945.47
中国工商银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	242380017	23 农行永续债 01	156,800	15,680,000.00
中国工商银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	6,150	650,310.47
中国工商银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928023	19 农业银行永续债 02	459,550	46,640,882.78
中国工商银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928023	19 农业银行永续债 02	459,550	46,588,324.74

中国工商银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928023	19 农业银行永续债 02	7,380	776,681.35
中国工商银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928025	19 交通银行永续债	275,730	29,070,059.04
中国银行股份有限公司	012282667	22 凤城河 SCP003	297,660	29,940,029.97
中国银行股份有限公司	012380787	23 荣盛 SCP002	75,200	7,520,000.00
中国银行股份有限公司	012380811	23 红狮 SCP001	37,600	3,760,000.00
中国银行股份有限公司	012382234	23 闽能源 SCP002(碳资产)	153,660	15,366,000.00
中国银行股份有限公司	012382241	23 津城建 SCP037	153,660	15,366,000.00
中国银行股份有限公司	012382241	23 津城建 SCP037	5,180	518,000.00
中国银行股份有限公司	012383442	23 云建投 SCP019	72,430	7,243,000.00
中国银行股份有限公司	012384302	23 凤城河 SCP004	384,720	38,472,010.50
中国银行股份有限公司	012384563	23 东泰投资 SCP001	13,057	1,305,738.80
中国银行股份有限公司	032000747	20 武侯资本 PPN001	297,660	30,369,297.69
中国银行股份有限公司	032100347	21 武侯资本 PPN001	18,800	1,989,365.70
中国银行股份有限公司	032100916	21 洛阳城乡 PPN004	19,668	2,020,679.76
中国银行股份有限公司	032100916	21 洛阳城乡 PPN004	6,804	706,021.98
中国银行股份有限公司	032380089	23 晋江建投 PPN001	1,788	183,946.11
中国银行股份有限公司	032380089	23 晋江建投 PPN001	6,804	709,417.59
中国银行股份有限公司	032380198	23 吴中国裕 PPN001	3,920	392,000.00

中国银行股份有限公司	032380359	23 吴中经发 PPN002	53,640	5,364,000.00
中国银行股份有限公司	032380965	23 上饶城投 PPN003	82,320	8,320,171.56
中国银行股份有限公司	042380292	23 广西金控 CP001	68,490	6,850,010.51
中国银行股份有限公司	082280714	22 丰田租赁 ABN001 优先	99,000	3,718,311.30
中国银行股份有限公司	082380820	23 华电山西 ABN001 优先	27,926	2,792,630.80
中国银行股份有限公司	092280003	22 中国信达债 01	35,760	3,566,520.12
中国银行股份有限公司	102000223	20 泉州文旅 (疫情防控 债)MTN001	496,100	50,977,265.19
中国银行股份有限公司	102000426	20 泉州文旅 MTN002	496,100	50,723,978.28
中国银行股份有限公司	102000782	20 张家建设 MTN001	290,910	30,096,401.30
中国银行股份有限公司	102000864	20 九龙江(疫 情防控 债)MTN003	47,500	4,901,644.47
中国银行股份有限公司	102101334	21 鲁高速 MTN004	252,300	25,406,819.56
中国银行股份有限公司	102101617	21 陕延油 MTN003	3,576	369,287.20
中国银行股份有限公司	102101832	21 建发 MTN001	163,726	16,650,899.71
中国银行股份有限公司	102101876	21 环球租赁 MTN002	47,500	4,827,574.92
中国银行股份有限公司	102101899	21 京住总集 MTN003B	348,038	35,205,737.60
中国银行股份有限公司	102102148	21 中建四局 MTN001	71,520	7,359,784.41
中国银行股份有限公司	102102152	21 远东宏信 MTN003BC	193,940	19,538,649.22
中国银行股份有限公司	102102329	21 中建四局 MTN002	143,040	14,653,784.92
中国银行股份有限公司	102103231	21 陕西水务 MTN001	19,000	1,920,615.86
中国银行股份有限公司	102103238	21 中建三局 MTN002	9,500	949,768.59
中国银行股份有限公司	102300544	23 晋能煤业 MTN010	4,849	484,875.40

中国银行股份有限公司	102300571	23 金辉集团 MTN002	7,814	781,366.02
中国银行股份有限公司	102380816	23 福瑞能源 MTN001	17,880	1,788,000.00
中国银行股份有限公司	102380843	23 水电八局 MTN001	17,880	1,788,193.94
中国银行股份有限公司	102380846	23 中广核租 MTN002(碳中和债)	26,820	2,682,000.00
中国银行股份有限公司	102381241	23 新创建 MTN001BC	33,000	3,300,000.00
中国银行股份有限公司	102381255	23 桂铁投 MTN001	5,500	550,000.00
中国银行股份有限公司	102381341	23 首农食品 MTN002	15,120	1,512,000.00
中国银行股份有限公司	102381363	23 中化股 MTN001	15,120	1,512,000.00
中国银行股份有限公司	102381458	23 龙岩汇金 MTN001	7,560	756,000.00
中国银行股份有限公司	102381466	23 北部湾 MTN002	7,560	756,000.00
中国银行股份有限公司	102381495	23 柯桥开发 MTN001	15,120	1,512,000.00
中国银行股份有限公司	102381573	23 南昌轨交 MTN003(绿色)	1,020	102,000.00
中国银行股份有限公司	102381635	23 粤交投 MTN002A	2,550	255,000.00
中国银行股份有限公司	102381755	23 瘦西湖 MTN003	7,650	765,000.00
中国银行股份有限公司	102381781	23 长沙水业 MTN003	2,550	255,000.00
中国银行股份有限公司	102382076	23 光大控股 MTN001	11,760	1,176,000.00
中国银行股份有限公司	102382080	23 陕有色 MTN001	19,600	1,960,000.00
中国银行股份有限公司	102382092	23 大唐集 MTN009	7,840	784,000.00
中国银行股份有限公司	102382117	23 成都环境 MTN003	7,840	784,000.00
中国银行股份有限公司	102382418	23 光大控股 MTN002	4,860	486,000.00

中国银行股份有限公司	102382424	23 三明高速 MTN001(革命老区)	2,430	243,000.00
中国银行股份有限公司	102382436	23 大唐集 MTN014	2,430	243,000.00
中国银行股份有限公司	102382528	23 中交天航 MTN001(科创 票据)	4,860	486,000.00
中国银行股份有限公司	102382589	23 象屿股份 MTN002	4,860	486,000.00
中国银行股份有限公司	102382700	23 京住总集 MTN002	16,401	1,640,117.00
中国银行股份有限公司	102382703	23 湘建工 MTN002(科创 票据)	3,280	328,023.40
中国银行股份有限公司	102382772	23 陕有色 MTN002	4,814	481,441.00
中国银行股份有限公司	102382856	23 北电 MTN001	85,491	8,549,101.80
中国银行股份有限公司	102382878	23 中交天航 MTN002(科创 票据)	51,226	5,122,637.00
中国银行股份有限公司	102382920	23 武商贸集 MTN002	5,123	512,263.70
中国银行股份有限公司	102382923	23 天津港 MTN001(科创 票据)	5,123	512,263.70
中国银行股份有限公司	102383017	23 新创建 MTN002BC	17,860	1,785,990.20
中国银行股份有限公司	102383076	23 中建七局 MTN002(科创 票据)	11,595	1,159,536.70
中国银行股份有限公司	132100076	21 京能洁能 GN001(碳中和 债)	71,250	7,266,980.36
中国银行股份有限公司	2320031	23 华润银行小 微债 01	2,550	255,000.00
中国银行股份有限公司	2320056	23 广州银行绿 色债 02	10,229	1,022,873.60
中国银行股份有限公司	2320063	23 海峡银行小 微债 03	14,239	1,423,877.60
中国银行股份有限公司	2322018	23 兴业消费金 融债 01	14,239	1,423,877.60

中国银行股份有限公司	232380063	23 创兴银行二级资本债 01BC	4,860	486,000.00
中国银行股份有限公司	242380014	23 富邦华一永续债 01	3,060	306,000.00
中国银行股份有限公司	272380014	23 东方二级资本债 01BC	12,150	1,215,000.00
中国银行股份有限公司	282380005	23 太平人寿永续债 01	13,023	1,302,276.70
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	1,838,200	187,543,392.44
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	3,690	391,267.69
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	459,550	46,869,422.66
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	459,550	46,842,917.96
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	459,550	46,810,240.18
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	12,150	1,252,084.31
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	9,720	1,001,412.79

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	161,621	16,563,336.56
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	163,403	16,737,694.20
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	164,640	16,854,014.43
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	164,640	16,854,014.43
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	164,640	16,852,893.52
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	169,998	17,369,765.56
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	171,043	17,483,132.10
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	242,431	24,845,004.85

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	251,130	25,679,278.22
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	254,997	26,048,732.40
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	329,280	33,701,207.35
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	409,315	41,918,868.29
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	409,315	41,926,638.55
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	435,048	44,472,012.07
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	435,048	44,470,315.39
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	5,848	597,416.00

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	576,240	58,989,276.24
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	82,320	8,426,446.76
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	84,999	8,684,228.28
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	849,990	86,855,861.73
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	4,814	497,486.39
中银国际证 券股份有限 公司	115629	23 津投 13	738	73,800.00
中银国际证 券股份有限 公司	177536	21 嵊州 01	228,900	23,406,595.94
中银国际证 券股份有限 公司	183965	22 电 2A	53,640	5,481,918.36
中银国际证 券股份有限 公司	1928004	19 农业银行二 级 02	311,675	32,235,662.39
中银国际证 券股份有限 公司	1928004	19 农业银行二 级 02	364,881	37,750,553.36
中银国际证 券股份有限 公司	1928004	19 农业银行二 级 02	396,643	41,021,576.97

中银国际证 券股份有限 公司	1928004	19 农业银行二 级 02	77,919	8,058,915.59
中银国际证 券股份有限 公司	1928004	19 农业银行二 级 02	919,100	94,601,475.87
中银国际证 券股份有限 公司	1928006	19 工商银行二 级 01	919,100	94,545,907.04
中银国际证 券股份有限 公司	1928009	19 农业银行二 级 04	919,100	94,453,045.73
中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	183,820	18,889,841.28
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	2,460	251,869.36
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	669,680	68,930,437.55
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	849,990	87,412,886.78
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	1,230	125,673.70
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	3,690	377,056.91
中银国际证 券股份有限 公司	252674	23 岷交 D2	6,937	693,704.40

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）
工银瑞信基 金管理有限 公司	006834	工银尊享 A	1,132,804	1,229,998.77

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）
1 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	393,368,420.00
3 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	48,064,400.00
3 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	624,000.00
7 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	70,999,800.00
现券买入	中国工商银行股份有限公司	1,055,899,779.42
现券买入	中银国际证券股份有限公司	208,049,958.34
现券买入	中国银行股份有限公司	173,161,764.02
现券买入	工银理财有限责任公司	68,954,361.44
现券买入	中国工商银行(澳门)股份有限公司	1,788,000.00
现券卖出	中国工商银行股份有限公司	211,546,761.70
现券卖出	中银国际证券股份有限公司	316,874.05

八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市，经济内生需求仍然不足，汇率压力减轻后国内货币政策自主空间提升，预计资金面将维持宽松，债券市场风险可控。但收益率已处于低位，期限利差和信用利差均压缩到极低水平，经济刺激政策和防资金空转政策可能导致市场波动。后续产品管理人将以稳健为主，配置高性价比固收类资产，保持适度杠杆水平，控制久期。

中银理财-稳富（90天持有期）02

2023年年度托管报告

（报告期间：2023年01月01日-2023年12月31日）

本托管人依据中银理财有限责任公司与我行签署的《中银理财理财产品托管协议》履行托管人责任，现将本报告期间托管情况报告如下：

一、本托管人在报告期间，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在损害资产委托人利益的行为。

（一）本托管人以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责，安全保管托管专户内委托资产；非依法律规定、行政法规或托管协议约定，不得擅自动用或处分托管资产；

（二）根据托管协议约定，执行管理人划款指令，办理托管专户项下资金往来；

（三）根据《托管协议》约定，对资产管理人运用投资组合资产进行投资的行为进行了监督；

（四）为投资组合单独设立托管专户，与自有账户以及所托管的其他非本投资组合的托管专户分别保管，实行了严格的分账管理，维护投资组合资产的独立性。

二、本计划托管人复核了管理人编制的《中银理财-稳富（90天持有期）02 2023年年度投资运作情况报告》中最后一个交易日的产品总份额、份额净值，核对无误。

中国工商银行股份有限公司
上海市分行资产管理与养老金业务部

