

中银理财-ESG 优享 30 天持有期固收理财产品 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 | CYQESGGS30D |
| 理财产品名称 | 中银理财-ESG 优享 30 天持有期固收理财产品 |
| 全国银行业理财信息登记系统登记编码 | Z7001023000161 |
| 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 | 2023-03-23 |
| 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 |
|--------------|-------------------|--------------|----------------|-------------------|-----------------------|
| CYQESGGS30DA | 12,350,483,050.39 | 1.022953 | 1.022953 | 12,633,964,276.17 | 2.30% |
| CYQESGGS30DB | 10,464,056,779.03 | 1.023546 | 1.023546 | 10,710,445,891.03 | 2.35% |
| CYQESGGS30DC | 3,175,287.46 | 1.023040 | 1.023040 | 3,248,447.29 | 2.30% |

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：104.00%

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 | 255,314.96 | 10.93% | 1,335,219.64 | 56.08% |
| 同业存单 | - | 0.00% | 176,984.98 | 7.43% |
| 拆放同业及买入返售 | - | 0.00% | 36,182.67 | 1.52% |
| 债券 | - | 0.00% | 803,435.77 | 33.74% |
| 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% | 29,156.32 | 1.22% |
| 私募基金 | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 资产管理产品 | 2,080,771.05 | 89.07% | - | 0.00% |
| 合计 | 2,336,086.01 | 100% | 2,380,979.38 | 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 | 407,942.47 | 17.13% |
| 2 | DQ23051201: 存放同业 | 56,009.67 | 2.35% |
| 3 | 100201030110023083101: 存放同业 | 55,846.30 | 2.35% |
| 4 | RBRBZCZ20231222DQ231222031: 存放同业 | 49,972.37 | 2.10% |
| 5 | DQ23042103: 存放同业 | 42,007.23 | 1.76% |
| 6 | 100201030110023082901: 存放同业 | 41,884.73 | 1.76% |
| 7 | TD20220331: 存放同业 | 39,523.37 | 1.66% |

| | | | |
|----|------------------|-----------|-------|
| 8 | DQ23051101: 存放同业 | 28,004.83 | 1.18% |
| 9 | DQ23051103: 存放同业 | 28,004.83 | 1.18% |
| 10 | DQ23051102: 存放同业 | 28,004.83 | 1.18% |

注：本表列示穿透后投资规模占比较高的前十名资产

五、投资账户信息

| | |
|-----|---------------------------|
| 户名 | 中银理财-ESG 优享 30 天持有期固收理财产品 |
| 账号 | 761476894146 |
| 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

本产品主要投资固定收益类资产，产品杠杆率保持在 100%-120%之间，流动性压力可控，在本运作期内未出现流动性风险事件。

七、本运作期主要操作回顾

（一）主要投资策略及操作

2023 年，本产品积极加大了对债券类资产和存款类资产的投资，在把控风险的前提下，维持灵活偏短久期，精选信用债获取票息和资本利得收益。

（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 | 112304012 | 23 中国银行 CD012 | 8,500 | 845,080.64 |
| 中国银行股份有限公司 | 112304018 | 23 中国银行 CD018 | 867 | 85,562.89 |
| 中国银行股份有限公司 | 112304021 | 23 中国银行 CD021 | 2,550 | 249,860.12 |
| 中国银行股份有限公司 | 112304023 | 23 中国银行 CD023 | 1,700 | 166,552.84 |
| 中国银行股份有限公司 | 112304025 | 23 中国银行 CD025 | 1,700 | 166,542.86 |
| 中国银行股份有限公司 | 112304025 | 23 中国银行 CD025 | 1,700 | 166,519.91 |
| 中国银行股份有限公司 | 112304025 | 23 中国银行 CD025 | 1,900 | 185,739.71 |
| 中国银行股份有限公司 | 112304025 | 23 中国银行 CD025 | 1,900 | 185,739.90 |
| 中国银行股份有限公司 | 112304032 | 23 中国银行 CD032 | 1,700 | 166,454.32 |
| 中国银行股份有限公司 | 112304034 | 23 中国银行 CD034 | 25,317 | 2,496,060.16 |
| 中国银行股份有限公司 | 112304054 | 23 中国银行 CD054 | 39,856 | 3,946,291.28 |
| 中国银行股份有限公司 | 112304068 | 23 中国银行 CD068 | 159,424 | 15,742,762.29 |

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 | 012382234 | 23 闽能源 SCP002(碳资产) | 10 | 1,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 012383442 | 23 云建投 SCP019 | 33,520 | 3,352,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 032380829 | 23 湖州高新 PPN002 | 10,056 | 1,005,696.17 |
| 中国银行股份有限公司 | 082380667 | 23 华能罗源 ABN001 优先 | 231,201 | 23,122,323.77 |
| 中国银行股份有限公司 | 102300425 | 23 龙城发展 MTN002 | 45,100 | 4,510,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102300486 | 23 华能 MTN015 | 9,420 | 942,000.00 |

| | | | | |
|------------|-----------|----------------------------|---------|---------------|
| 中国银行股份有限公司 | 102300571 | 23 金辉集团 MTN002 | 4,295 | 429,530.03 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381152 | 23 碧桂园 MTN001 | 6 | 600.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381222 | 23 南京浦口 MTN002 | 20 | 2,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381573 | 23 南昌轨交 MTN003(绿色) | 3,580 | 358,033.26 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381762 | 23 南京浦口 MTN003 | 67,650 | 6,765,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381892 | 23 武汉城建 MTN001 | 22,550 | 2,255,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381960 | 23 深投控 MTN002 | 42,840 | 4,284,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382080 | 23 陕有色 MTN001 | 85,680 | 8,568,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382259 | 23 晋能煤业 MTN004 | 42,840 | 4,284,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382270 | 23 贵州高速 MTN002 | 16,220 | 1,622,132.95 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382355 | 23 美的置业 MTN004A | 33,520 | 3,352,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382357 | 23 绿城房产 MTN001(绿色) | 93,900 | 9,391,105.76 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382366 | 23 泉州水务 MTN002 | 33,520 | 3,352,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382418 | 23 光大控股 MTN002 | 100,560 | 10,056,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382424 | 23 三明高速 MTN001(革命老区) | 9,420 | 942,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382515 | 23 中建六局 MTN001(科创票据) | 9,390 | 939,094.93 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382515 | 23 中建六局 MTN001(科创票据) | 9,420 | 942,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382568 | 23 闽冶金 MTN003 | 33,520 | 3,352,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382569 | 23 福瑞能源 MTN002(能源保供特别债) | 33,520 | 3,352,000.00 |

| | | | | |
|------------|-----------|-----------------------------|---------|---------------|
| 中国银行股份有限公司 | 102382589 | 23 象屿股份 MTN002 | 33,520 | 3,352,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382652 | 23 本钢集团 MTN001(科创 票据) | 18,843 | 1,886,244.88 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382786 | 23 桂交投 MTN004 | 39,069 | 3,906,860.80 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382927 | 23 中建投资 MTN001 | 23,120 | 2,312,226.89 |
| 中国银行股份有限公司 | 102383017 | 23 新创建 MTN002BC | 8,825 | 882,555.73 |
| 中国银行股份有限公司 | 102383076 | 23 中建七局 MTN002(科创 票据) | 8,219 | 822,130.82 |
| 中国银行股份有限公司 | 102383376 | 23 本钢集团 MTN002(科创 票据) | 42,953 | 4,295,300.30 |
| 中国银行股份有限公司 | 102383382 | 23 陕延油 MTN005A | 42,953 | 4,295,300.30 |
| 中国银行股份有限公司 | 132380060 | 23 三峡 GN001 | 128,520 | 12,852,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 132380067 | 23 晋能电力 GN011(碳中和 债) | 9,420 | 938,310.61 |
| 中国银行股份有限公司 | 1828008 | 18 中信银行二 级 01 | 192,600 | 20,153,731.01 |
| 中国银行股份有限公司 | 1920076 | 19 徽商银行永 续债 | 342,720 | 36,131,750.36 |
| 中国银行股份有限公司 | 1928031 | 19 广发银行永 续债 | 399,150 | 42,242,319.53 |
| 中国银行股份有限公司 | 1928032 | 19 建设银行永 续债 | 1,526 | 154,613.64 |
| 中国银行股份有限公司 | 1928032 | 19 建设银行永 续债 | 3,053 | 309,291.08 |
| 中国银行股份有限公司 | 1928032 | 19 建设银行永 续债 | 4,579 | 464,311.17 |
| 中国银行股份有限公司 | 2028037 | 20 光大银行永 续债 | 1,526 | 156,941.16 |
| 中国银行股份有限公司 | 2028037 | 20 光大银行永 续债 | 1,526 | 157,036.71 |
| 中国银行股份有限公司 | 2028037 | 20 光大银行永 续债 | 2,289 | 235,278.50 |
| 中国银行股份有限公司 | 2028037 | 20 光大银行永 续债 | 2,289 | 235,555.06 |

| | | | | |
|------------|-----------|-------------------|---------|---------------|
| 中国银行股份有限公司 | 2028040 | 20 交通银行永续债 | 1,526 | 156,989.85 |
| 中国银行股份有限公司 | 2028040 | 20 交通银行永续债 | 1,526 | 156,962.22 |
| 中国银行股份有限公司 | 2028040 | 20 交通银行永续债 | 1,526 | 157,072.12 |
| 中国银行股份有限公司 | 2028040 | 20 交通银行永续债 | 3,053 | 313,856.38 |
| 中国银行股份有限公司 | 2320044 | 23 湖南银行01 | 8,110 | 811,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 2322016 | 23 农银金租绿色债 | 40,198 | 4,019,753.60 |
| 中国银行股份有限公司 | 2322019 | 23 招银金租债02 | 40,289 | 4,028,881.20 |
| 中国银行股份有限公司 | 232380026 | 23 厦门国际二级资本债 01 | 33,825 | 3,382,500.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 232380063 | 23 创兴银行二级资本债 01BC | 9,420 | 942,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 242300001 | 23 宁波银行永续债 01 | 16,220 | 1,632,196.26 |
| 中国银行股份有限公司 | 242300001 | 23 宁波银行永续债 01 | 16,220 | 1,631,834.56 |
| 中国银行股份有限公司 | 242300001 | 23 宁波银行永续债 01 | 16,220 | 1,631,834.56 |
| 中国银行股份有限公司 | 242300001 | 23 宁波银行永续债 01 | 24,330 | 2,448,294.40 |
| 中国银行股份有限公司 | 242300001 | 23 宁波银行永续债 01 | 8,110 | 816,098.13 |
| 中国银行股份有限公司 | 242380014 | 23 富邦华一永续债 01 | 9,020 | 902,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 242380019 | 23 邮储永续债 01 | 18,330 | 1,833,006.40 |
| 中国银行股份有限公司 | 242380019 | 23 邮储永续债 01 | 74,924 | 7,492,406.20 |
| 中国银行股份有限公司 | 242380021 | 23 建行永续债 02 | 140,850 | 14,085,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 242380021 | 23 建行永续债 02 | 94,200 | 9,420,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 272380014 | 23 东方二级资本债 01BC | 23,550 | 2,355,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 282380002 | 23 太保寿险永续债 01 | 141,011 | 14,101,084.20 |

| | | | | |
|--------------------------|-----------|-----------------|---------|---------------|
| 中国银行股份有限公司 | 282380002 | 23 太保寿险永续债 01 | 27,138 | 2,714,080.77 |
| 中国银行股份有限公司 | UL492881 | 23 龙湖拓展 MTN001 | 56,770 | 5,677,000.00 |
| 中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司 | 1928018 | 19 工商银行永续债 | 100,560 | 10,257,952.58 |
| 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 | 100,560 | 10,255,568.48 |
| 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 | 112,750 | 11,479,651.60 |
| 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 | 167,600 | 17,085,926.90 |
| 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 | 224,460 | 22,804,844.20 |
| 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 | 256,800 | 27,276,842.20 |
| 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 | 67,040 | 6,837,045.66 |
| 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 | 42,840 | 4,284,000.00 |

| | | | | |
|---|-----------|---------------------|---------|---------------|
| 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 | 8,110 | 811,074.23 |
| 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 | 404,320 | 40,432,000.00 |
| 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 | 514,080 | 51,408,000.00 |
| 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 | 81,100 | 8,110,000.00 |
| 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 | 201,444 | 20,791,470.81 |
| 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 | 171,812 | 17,618,887.83 |
| 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 | 40,835 | 4,182,850.40 |
| 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 | 42,953 | 4,404,451.35 |

| | | | | |
|---|-----------|------------------|---------|---------------|
| 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 | 80,395 | 8,233,830.46 |
| 中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司 | 2320061 | 23 厦门国际银 行 01 | 7,707 | 770,847.37 |
| 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 | 197,406 | 19,740,559.50 |
| 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 | 38,061 | 3,807,146.33 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 115629 | 23 津投 13 | 1,396 | 139,630.41 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 115629 | 23 津投 13 | 1,790 | 179,000.00 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 115629 | 23 津投 13 | 4,510 | 451,000.00 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928004 | 19 农业银行二 级 02 | 39,481 | 4,081,761.85 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928004 | 19 农业银行二 级 02 | 78,962 | 8,163,523.70 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928009 | 19 农业银行二 级 04 | 201,444 | 20,800,805.86 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928009 | 19 农业银行二 级 04 | 74,776 | 7,527,557.38 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928011 | 19 工商银行二 级 03 | 10,880 | 1,104,068.67 |

| | | | | |
|----------------------|---------|-------------------|---------|---------------|
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928011 | 19 工商银行二 级 03 | 49,850 | 5,023,670.69 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928011 | 19 工商银行二 级 03 | 5,440 | 552,034.34 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928014 | 19 华夏银行永 续债 | 256,800 | 26,290,857.90 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928014 | 19 华夏银行永 续债 | 299,696 | 30,827,443.73 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928014 | 19 华夏银行永 续债 | 64,200 | 6,572,714.47 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928014 | 19 华夏银行永 续债 | 78,962 | 8,145,685.41 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928021 | 19 农业银行永 续债 01 | 134,080 | 13,652,959.57 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928021 | 19 农业银行永 续债 01 | 159,660 | 16,262,448.16 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928021 | 19 农业银行永 续债 01 | 167,600 | 17,046,532.40 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928021 | 19 农业银行永 续债 01 | 197,406 | 20,182,529.80 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928021 | 19 农业银行永 续债 01 | 204,603 | 20,921,086.85 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928021 | 19 农业银行永 续债 01 | 214,200 | 22,700,810.37 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928021 | 19 农业银行永 续债 01 | 239,490 | 24,393,672.24 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928021 | 19 农业银行永 续债 01 | 24,937 | 2,526,204.24 |

| | | | | |
|----------------------|---------|-------------------|---------|---------------|
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928021 | 19 农业银行永 续债 01 | 249,400 | 25,345,399.70 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928021 | 19 农业银行永 续债 01 | 3,053 | 308,773.37 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928021 | 19 农业银行永 续债 01 | 3,816 | 385,934.15 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928021 | 19 农业银行永 续债 01 | 49,873 | 5,051,934.69 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928021 | 19 农业银行永 续债 01 | 5,342 | 540,501.90 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928021 | 19 农业银行永 续债 01 | 74,810 | 7,581,103.91 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928021 | 19 农业银行永 续债 01 | 763 | 77,251.11 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928021 | 19 农业银行永 续债 01 | 99,747 | 10,104,717.22 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928023 | 19 农业银行永 续债 02 | 1,526 | 154,358.90 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928023 | 19 农业银行永 续债 02 | 124,700 | 12,625,899.94 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928023 | 19 农业银行永 续债 02 | 187,310 | 19,043,953.55 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928023 | 19 农业银行永 续债 02 | 2,289 | 231,441.06 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928023 | 19 农业银行永 续债 02 | 3,053 | 308,555.11 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928023 | 19 农业银行永 续债 02 | 3,053 | 308,525.40 |

| | | | | |
|----------------------|---------|-------------------|---------|---------------|
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928023 | 19 农业银行永 续债 02 | 5,342 | 540,256.17 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928025 | 19 交通银行永 续债 | 124,700 | 12,632,908.08 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928025 | 19 交通银行永 续债 | 24,940 | 2,532,669.47 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928025 | 19 交通银行永 续债 | 33,520 | 3,533,317.67 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2028023 | 20 招商银行永 续债 01 | 124,594 | 12,624,664.20 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2028023 | 20 招商银行永 续债 01 | 2,289 | 232,630.10 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2028023 | 20 招商银行永 续债 01 | 24,919 | 2,525,433.71 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2028023 | 20 招商银行永 续债 01 | 24,919 | 2,525,974.44 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2028023 | 20 招商银行永 续债 01 | 24,919 | 2,524,260.04 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2028023 | 20 招商银行永 续债 01 | 3,053 | 310,092.27 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2028023 | 20 招商银行永 续债 01 | 49,837 | 5,051,600.02 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2389307 | 23 欣荣 2 优先 | 5,634 | 563,400.00 |

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 Q202131 | 中银证券中国 红-汇中 31 号 集合资产管理 计划 | 277,213,084 | 300,000,000.00 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | ZYLCZYZ Q202131 | 中银证券中国 红-汇中 31 号 集合资产管理 计划 | 417,904,903 | 450,000,000.00 |
| 中银基金管 理有限公司 | 018581 | 中银纯债债券 D | 14,618,217 | 16,115,121.91 |
| 中银基金管 理有限公司 | 163820 | 中银货币 B | 38,000 | 38,000.00 |
| 中银基金管 理有限公司 | 163820 | 中银货币 B | 38,000 | 38,000.00 |
| 中银基金管 理有限公司 | 163820 | 中银货币 B | 38,000 | 38,000.00 |

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 | 23,546,134.67 |
| 产品托管费 | 中国银行股份有限公司 | 2,021,230.06 |
| 1 日质押式正回购 | 中银基金管理有限公司 | 339,966.00 |
| 1 日质押式逆回购 | 中银国际证券股份有限公司 | 25,973,419.60 |
| 1 日质押式逆回购 | 中银基金管理有限公司 | 9,184,958.00 |
| 2 日质押式正回购 | 中银富登村镇银行股份有 限公司 | 173,388.00 |
| 3 日质押式正回购 | 中银富登村镇银行股份有 限公司 | 7,971,102.29 |
| 3 日质押式逆回购 | 中银国际证券股份有限公 司 | 2,700,940.00 |
| 4 日质押式正回购 | 中银基金管理有限公司 | 3,945,735.09 |
| 7 日质押式正回购 | 中银基金管理有限公司 | 62,553,000.00 |
| 7 日质押式逆回购 | 中银国际证券股份有限公 司 | 85,125,502.68 |
| 7 日质押式逆回购 | 中银基金管理有限公司 | 30,260,826.83 |
| 现券买入 | 中国银行股份有限公司 | 123,397,033.60 |
| 现券买入 | 中银国际证券股份有限公 司 | 179,000.00 |

八、后市展望及下阶段投资策略

目前债市收益率偏低，预计未来或有小幅调整。后续产品将维持灵活偏短久期，并加大存款类资产的投资。

中银理财-ESG 优享 30 天持有期固收理财产品

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-ESG 优享 30 天持有期固收理财产品（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

