

中银理财-悦享（90 天持有期）  
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：招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	CYQYX90D
理财产品名称	中银理财-悦享（90天持有期）
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001021000879
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	2022-02-08
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
CYQYX90D	4,360,681,048.42	1.055844	1.055844	4,604,202,535.92	3.24%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：107.63%

### 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	60,941.22	13.22%	267,898.31	55.03%
同业存单	-	0.00%	35,570.07	7.31%

拆放同业及买入返售	-	0.00%	4,225.42	0.87%
债券	-	0.00%	167,860.68	34.48%
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%	11,271.99	2.32%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	399,868.91	86.78%	-	0.00%
合计	460,810.13	100%	486,826.46	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	106,722.25	21.92%
2	TI-000002465：存放同业	50,989.52	10.47%
3	100201030110022102703：存放同业	18,330.31	3.77%
4	Depo_jh_20230613_CZ：存放同业	10,244.72	2.10%
5	YGQH11-ZYYG-2022-20220419-DQ：存放同业	8,197.13	1.68%
6	Depo_jh_20230707_XT：存放同业	7,683.54	1.58%
7	YGQH11-ZYYG-2022-20220415-DQ：存放同业	7,172.49	1.47%
8	Depo_nh_20230720_GZ：存放同业	5,122.37	1.05%
9	Depo_gh_20230607_ZZ：存放同业	5,122.37	1.05%
10	Depo_jh_20230830_AX12：存放同业	5,122.36	1.05%

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-悦享（90天持有期）
账号	955106090607223
开户行	招商银行股份有限公司北京月坛支行

## 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）
招商银行股份有限公司	112207057	22 招商银行 CD057	28,800	2,814,935.04
招商银行股份有限公司	112307005	23 招商银行 CD005	5,760	565,306.56
招商银行股份有限公司	1828015	18 招商银行二级 01	3,840	390,169.34

招商银行股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	10,023	1,018,477.71
招商银行股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	10,816	1,095,961.81
招商银行股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	13,364	1,357,614.79
招商银行股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	2,163	219,235.84
招商银行股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	2,163	219,133.96
招商银行股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	2,163	219,282.79
招商银行股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	4,326	438,535.29
招商银行股份有限公司	242380033	23 招行永续债 01	87,516	8,751,612.50
招银金融租赁有限公司	2322019	23 招银金租债 02	17,270	1,726,962.50
中国交通建设集团有限公司	102001816	20 中交集 MTN001	3,200	323,571.84
中国交通建设集团有限公司	102001816	20 中交集 MTN001	5,120	517,751.81
中国银行股份有限公司	112304012	23 中国银行 CD012	46,000	4,573,377.56
中国银行股份有限公司	112304018	23 中国银行 CD018	16,515	1,629,981.44
中国银行股份有限公司	112304018	23 中国银行 CD018	228	22,472.42
中国银行股份有限公司	112304018	23 中国银行 CD018	24,772	2,445,165.38
中国银行股份有限公司	112304021	23 中国银行 CD021	13,800	1,352,184.20
中国银行股份有限公司	112304023	23 中国银行 CD023	9,200	901,344.78
中国银行股份有限公司	112304024	23 中国银行 CD024	33,030	3,261,736.26
中国银行股份有限公司	112304025	23 中国银行 CD025	9,200	901,290.76
中国银行股份有限公司	112304025	23 中国银行 CD025	9,200	901,166.56
中国银行股份有限公司	112304025	23 中国银行 CD025	9,800	958,026.86

中国银行股份有限公司	112304025	23 中国银行 CD025	9,800	958,025.88
中国银行股份有限公司	112304032	23 中国银行 CD032	9,200	900,811.62
中国银行股份有限公司	112304034	23 中国银行 CD034	362	35,717.86
中国银行股份有限公司	112304035	23 中国银行 CD035	21,950	2,145,767.11
中国银行股份有限公司	112304035	23 中国银行 CD035	31,200	3,050,976.34
中国银行股份有限公司	112304042	23 中国银行 CD042	21,950	2,142,026.13
中国银行股份有限公司	112304044	23 中国银行 CD044	43,900	4,284,468.18
中国银行股份有限公司	112304045	23 中国银行 CD045	16,515	1,613,891.37
中国银行股份有限公司	112304046	23 中国银行 CD046	43,894	4,282,676.99
中国银行股份有限公司	112304054	23 中国银行 CD054	421	41,703.69
中国银行股份有限公司	112304055	23 中国银行 CD055	6,350	627,138.12
中国银行股份有限公司	112304068	23 中国银行 CD068	1,685	166,366.65

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）
招商银行股份有限公司	012381882	23 吴中经发 SCP005	95,640	9,564,000.00
招商银行股份有限公司	012382128	23 乌高新 SCP002	76,760	7,676,000.00
招商银行股份有限公司	012382286	23 闽漳龙 SCP002	172,710	17,271,000.00
招商银行股份有限公司	012383171	23 湘建工 SCP002(科创 票据)	10,010	1,001,000.00
招商银行股份有限公司	012384416	23 中广核 SCP006(科创 票据)	49,497	4,950,079.97
招商银行股份有限公司	012384441	23 沪电力 SCP025	135	13,474.00

招商银行股份有限公司	012384536	23 深圳水务 SCP002	82,495	8,249,545.00
招商银行股份有限公司	042380323	23 常高新 CP001	38,380	3,838,000.00
招商银行股份有限公司	102002093	20 中建四局 MTN002	102,900	10,761,089.31
招商银行股份有限公司	102300440	23 陕投集团 MTN006	20,020	2,002,000.00
招商银行股份有限公司	102381165	23 江宁国资 MTN001	63,760	6,376,000.00
招商银行股份有限公司	102381320	23 济南高新 MTN002	19,190	1,919,000.00
招商银行股份有限公司	102382142	23 中航租赁 MTN001	10,010	1,001,000.00
招商银行股份有限公司	102382381	23 水利三 MTN001	20,580	2,058,000.00
招商银行股份有限公司	102382438	23 中兵投资 MTN001	1,880	188,000.00
招商银行股份有限公司	102382468	23 渝东高速 MTN001	6,190	619,000.00
招商银行股份有限公司	102382522	23 中建三局 MTN001(科创 票据)	6,190	619,000.00
中国银行股份有限公司	012380956	23 贵州交通 SCP001	7,540	754,000.00
中国银行股份有限公司	012382234	23 闽能源 SCP002(碳资 产)	19,190	1,919,000.00
中国银行股份有限公司	012383442	23 云建投 SCP019	20,580	2,058,000.00
中国银行股份有限公司	032100788	21 嵊州城投 PPN002	3,060	311,461.24
中国银行股份有限公司	032380829	23 湖州高新 PPN002	6,174	617,459.04
中国银行股份有限公司	102300425	23 龙城发展 MTN002	20,560	2,056,000.00
中国银行股份有限公司	102300486	23 华能 MTN015	6,190	619,000.00
中国银行股份有限公司	102300571	23 金辉集团 MTN002	1,650	164,990.90
中国银行股份有限公司	102380398	23 中船租 MTN001BC( 可持续挂钩)	45,240	4,524,407.90

中国银行股份有限公司	102380416	23 中原高速 MTN001	15,080	1,508,000.00
中国银行股份有限公司	102380743	23 象屿 MTN001	15,080	1,508,000.00
中国银行股份有限公司	102381222	23 南京浦口 MTN002	63,760	6,376,000.00
中国银行股份有限公司	102381762	23 南京浦口 MTN003	30,840	3,084,000.00
中国银行股份有限公司	102381892	23 武汉城建 MTN001	10,280	1,028,000.00
中国银行股份有限公司	102381960	23 深投控 MTN002	10,010	1,001,000.00
中国银行股份有限公司	102382080	23 陕有色 MTN001	20,020	2,002,000.00
中国银行股份有限公司	102382259	23 晋能煤业 MTN004	10,010	1,001,000.00
中国银行股份有限公司	102382355	23 美的置业 MTN004A	20,580	2,058,000.00
中国银行股份有限公司	102382366	23 泉州水务 MTN002	20,580	2,058,000.00
中国银行股份有限公司	102382418	23 光大控股 MTN002	61,740	6,174,000.00
中国银行股份有限公司	102382424	23 三明高速 MTN001(革命老区)	6,190	619,000.00
中国银行股份有限公司	102382515	23 中建六局 MTN001(科创票据)	6,190	619,000.00
中国银行股份有限公司	102382589	23 象屿股份 MTN002	20,580	2,058,000.00
中国银行股份有限公司	102382652	23 本钢集团 MTN001(科创票据)	12,376	1,238,879.22
中国银行股份有限公司	102383376	23 本钢集团 MTN002(科创票据)	16,499	1,649,909.00
中国银行股份有限公司	102383382	23 陕延油 MTN005A	16,499	1,649,909.00
中国银行股份有限公司	132380067	23 晋能电力 GN011(碳中和债)	6,190	616,575.66
中国银行股份有限公司	1828008	18 中信银行二级 01	1,410	147,542.89

中国银行股份有限公司	1828012	18 中信银行二级 02	2,560	259,975.42
中国银行股份有限公司	1920076	19 徽商银行永续债	80,080	8,442,549.51
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	13,364	1,354,106.52
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	20,047	2,032,799.59
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	6,682	676,913.60
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	10,023	1,031,283.46
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	10,023	1,030,072.64
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	6,682	687,522.30
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	6,682	687,104.00
中国银行股份有限公司	232380026	23 厦门国际二级资本债 01	15,420	1,542,000.00
中国银行股份有限公司	232380063	23 创兴银行二级资本债 01BC	6,190	619,000.00
中国银行股份有限公司	242380014	23 富邦华一永续债 01	4,112	411,200.00
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	61,900	6,190,000.00
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	75,600	7,560,000.00
中国银行股份有限公司	272380014	23 东方二级资本债 01BC	15,475	1,547,500.00
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	1,880	199,690.28
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	10,020	1,015,400.75

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	102,900	10,490,106.67
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	12,160	1,238,132.42
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	16,700	1,692,463.17
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	16,700	1,694,382.00
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	19,440	1,975,078.73
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	41,160	4,197,684.95
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	51,400	5,233,295.72
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	6,680	676,991.95

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	61,740	6,296,527.43
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	61,740	6,297,991.17
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	99,090	9,909,000.00
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	10,010	1,001,000.00
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司, 招商银行股份有限公司	242380017	23 农行永续债 01	120,120	12,012,000.00
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司, 招商银行股份有限公司	242380017	23 农行永续债 01	132,560	13,256,000.00
中国银行股份有限公司; 招商银行股份有限公司	102382786	23 桂交投 MTN004	20,322	2,032,234.80
中国银行股份有限公司; 招商银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	13,364	1,374,094.40

中国银行股份有限公司; 招商银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	6,682	687,677.33
中国银行股份有限公司; 招商银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	6,682	687,317.16
中国银行股份有限公司; 招商银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	6,682	687,196.21
中国银行股份有限公司; 招商银行股份有限公司	2322016	23 农银金租绿色债	18,453	1,845,347.60
中国银行股份有限公司; 招商银行股份有限公司	2322019	23 招银金租债 02	17,270	1,726,962.50
中国银行股份有限公司; 招商银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	42,113	4,211,295.60
中国银行股份有限公司; 招商银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	60,444	6,044,368.75
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	16,499	1,691,836.06
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	18,746	1,920,220.41
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	36,907	3,779,903.15

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	65,996	6,767,760.01
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	87,516	8,751,612.50
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司;招商银 行股份有限 公司	1928013	19 民生银行永 续债	86,348	8,912,174.03
中国银行股 份有限公 司, 招商银 行股份有限 公司	092000013	20 信达二级资 本债 01	5,100	514,599.04
中国银行股 份有限公 司, 招商银 行股份有限 公司	102381152	23 碧桂园 MTN001	19,128	1,912,800.00
中国银行股 份有限公 司, 招商银 行股份有限 公司	102382568	23 闽冶金 MTN003	20,580	2,058,000.00
中国银行股 份有限公 司, 招商银 行股份有限 公司	102382569	23 福瑞能源 MTN002(能源 保供特别债)	20,580	2,058,000.00
中国银行股 份有限公 司, 招商银 行股份有限 公司	132380060	23 三峡 GN001	30,030	3,003,000.00

中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	7,700	814,896.31
中银国际证券股份有限公司	115629	23 津投 13	2,056	205,600.00
中银国际证券股份有限公司	1828010	18 建设银行二级 01	17,900	1,809,335.58
中银国际证券股份有限公司	1828010	18 建设银行二级 01	24,320	2,468,358.40
中银国际证券股份有限公司	1828013	18 建设银行二级 02	3,580	362,801.85
中银国际证券股份有限公司	1828013	18 建设银行二级 02	8,950	906,862.33
中银国际证券股份有限公司	185065	21 华电 07	15,690	1,580,610.60
中银国际证券股份有限公司	1928004	19 农业银行二级 02	17,503	1,809,573.74
中银国际证券股份有限公司	1928004	19 农业银行二级 02	35,006	3,619,147.48
中银国际证券股份有限公司	1928004	19 农业银行二级 02	8,320	845,803.71
中银国际证券股份有限公司	1928006	19 工商银行二级 01	8,960	910,864.64
中银国际证券股份有限公司	1928009	19 农业银行二级 04	1,280	130,247.55
中银国际证券股份有限公司	1928009	19 农业银行二级 04	6,491	653,475.92
中银国际证券股份有限公司	1928009	19 农业银行二级 04	86,348	8,916,175.46

中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	4,328	436,110.64
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	1,880	192,472.01
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	168,452	17,327,341.13
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	35,006	3,611,239.20
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	470	48,118.00
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	102,900	10,465,919.95
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	13,364	1,351,839.92
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	16,700	1,692,935.78
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	16,700	1,692,935.78
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	16,700	1,694,784.47
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	16,705	1,689,658.06
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	2,165	219,302.68
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	21,600	2,195,110.80
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	23,388	2,366,370.04

中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	3,080	313,718.78
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	3,341	338,212.90
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	4,330	438,564.23
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	4,620	470,578.17
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	50,050	5,304,274.32
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	6,494	658,124.30
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	8,659	877,202.05
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	82,320	8,382,395.82
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	87,516	8,947,551.87
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	90,707	9,274,977.43
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	10,023	1,013,271.53
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	10,800	1,093,502.16
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	105,282	10,704,133.71
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	13,364	1,350,884.37

中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	13,364	1,350,754.86
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	23,388	2,365,294.21
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	6,682	675,798.34
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	10,023	1,018,477.71
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	10,816	1,095,961.81
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	13,364	1,357,614.79
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	2,163	219,235.84
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	2,163	219,282.79
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	2,163	219,133.96
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	4,326	438,535.29
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	1928025	19 交通银行永 续债	10,800	1,094,109.12
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	1928025	19 交通银行永 续债	2,160	219,349.08

中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	1928025	19 交通银行永续债	20,580	2,169,322.13
-------------------------	---------	------------	--------	--------------

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）
大家资产管理有限责任公司	DJZCWJX 3-1	大家资产-稳健精选 3 号（第一期）集合资产管理产品	87,757,619	91,000,000.00
大家资产管理有限责任公司	DJZCWJX 6-5	大家资产-稳健精选 6 号（第五期）货币市场类集合资产管理产品	320,000,000	320,000,000.00
中银基金管理有限公司	006678	中银稳汇短债债券 C	6,169,795	6,606,000.00
中银基金管理有限公司	018581	中银纯债债券 D	6,266,035	6,907,677.30
中银基金管理有限公司	163820	中银货币 B	196,000	196,000.00
中银基金管理有限公司	163820	中银货币 B	196,000	196,000.00
中银基金管理有限公司	163820	中银货币 B	196,000	196,000.00

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）
14 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	124,415,500.00
14 日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	3,580,500.00
14 日质押式逆回购	招银理财有限责任公司	100,000.23
1 日质押式正回购	招银理财有限责任公司	103,541,245.20

1日质押式正回购	大家资产管理有限责任公司	7,981,767.86
1日质押式正回购	招商银行股份有限公司	919,895.04
1日质押式正回购	招商基金管理有限公司	382,163.29
1日质押式正回购	中银基金管理有限公司	99,990.00
1日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	90,401,947.53
1日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	44,911,568.20
1日质押式逆回购	招银理财有限责任公司	22,062,806.13
1日质押式逆回购	招商基金管理有限公司	3,048,948.13
21日质押式正回购	中国银行股份有限公司	80,067,800.00
2日质押式正回购	中银富登村镇银行股份有限公司	45,539.00
2日质押式逆回购	招商基金管理有限公司	1,568,000.00
3日质押式正回购	招银理财有限责任公司	80,126,048.00
3日质押式正回购	招商银行股份有限公司	384,940.00
3日质押式正回购	大家资产管理有限责任公司	256,597.42
3日质押式正回购	招商基金管理有限公司	119,804.00
3日质押式正回购	中银富登村镇银行股份有限公司	84,237.16
3日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	96,706,995.00
3日质押式逆回购	招银理财有限责任公司	10,782,000.00
3日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	6,706,408.80
4日质押式正回购	大家资产管理有限责任公司	88,437.26
4日质押式正回购	中银基金管理有限公司	41,697.81
4日质押式逆回购	招商基金管理有限公司	5,700,000.00
6日质押式逆回购	招银理财有限责任公司	19,283,000.00
7日质押式正回购	中国银行股份有限公司	164,057,600.00
7日质押式正回购	中银基金管理有限公司	126,779,605.20
7日质押式正回购	招商基金管理有限公司	24,748,635.00
7日质押式正回购	招银理财有限责任公司	4,166,400.00
7日质押式正回购	大家资产管理有限责任公司	1,044,945.00

7日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	30,626,039.88
7日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	23,060,892.28
7日质押式逆回购	招银理财有限责任公司	19,272,011.80
7日质押式逆回购	招商基金管理有限公司	4,512,692.30
现券买入	中国银行股份有限公司	33,456,338.01
现券卖出	中国银行股份有限公司	12,867,511.20
现券卖出	招商银行股份有限公司	10,023,921.77

#### 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。

关于《中银理财-悦享（90天持有期）2023年年度报告》托管人复  
核意见的回函

中银理财有限责任公司：

托管人声明,在本报告期内,资产托管人严格遵守有关法律法  
规、托管合同关于托管人职责的约定,尽职尽责地履行了托管职责  
并安全保管托管资产。

在管理人提供的各项数据和信息真实、准确、有效的前提下,  
在我行能够知悉和掌握的情况范围内,我行对《中银理财-悦享（90  
天持有期）2023年年度报告》报告中的截至报告期末财务数据进行  
了复核。

特此报告。

招商银行股份有限公司北京分行

2024年2月4日

