

# 中银理财-（2 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	CYQZQ2M
理财产品名称	中银理财-（2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	Z7001021000811
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	2021-12-07
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
CYQZQ2MA	2,796,648,266.72	1.049762	1.049762	2,935,816,233.03	2.57%
CYQZQ2MB	639,854,533.87	1.051778	1.051778	672,985,375.05	2.67%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：106.28%

### 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	9,871.84	2.74%	162,709.54	43.19%
同业存单	-	0.00%	4,889.98	1.30%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	6,375.38	1.69%
债券	31,055.38	8.61%	199,607.87	52.98%
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%	3,173.23	0.84%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	319,878.80	88.66%	-	0.00%
合计	360,806.02	100%	376,755.99	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	100201030110022102703：存放同业	77,064.54	20.45%
2	CNY：现金及银行存款	37,770.59	10.03%
3	100201030110022092903：存放同业	12,430.41	3.30%
4	019709：23 国债 16	9,979.57	2.65%
5	YMYJ1912023120720402801：28 日 质押式逆回购	5,905.69	1.57%
6	D002008840：存放同业	5,244.19	1.39%
7	D002008753：存放同业	5,243.89	1.39%
8	185269：22 兴业 01	5,023.31	1.33%
9	019727：23 国债 24	5,010.87	1.33%

10	D002008821：存放同业	4,981.70	1.32%
----	-----------------	----------	-------

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（2个月最短持有期固收增强）
账号	771875387955
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，产品管理人严格遵守流动性新规等监管要求，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，控制流动性受限资产、杠杆融资比例，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年全年资金面偏宽松和债市利率中枢持续下行的背景下，本产品为满足流动性备付的基础上，积极配置具有安全边际的固收类资产获取底仓票息收益，并根据市场走势调整组合久期和杠杆，博弈中短线交易的资本利得。权益投资方面，保持较低的权益类资产仓位，等待市场筑底反弹的机会。

### （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	112204033	22 中国银行 CD033	100	9,882.89
中国银行股份有限公司	112204033	22 中国银行 CD033	17,800	1,765,076.93
中国银行股份有限公司	112304002	23 中国银行 CD002	17,800	1,753,950.64
中国银行股份有限公司	112304012	23 中国银行 CD012	13,500	1,342,186.89
中国银行股份有限公司	112304013	23 中国银行 CD013	17,800	1,750,179.61
中国银行股份有限公司	112304018	23 中国银行 CD018	13	1,301.83
中国银行股份有限公司	112304018	23 中国银行 CD018	20	1,952.90
中国银行股份有限公司	112304021	23 中国银行 CD021	4,050	396,836.67
中国银行股份有限公司	112304022	23 中国银行 CD022	34,000	3,343,185.94
中国银行股份有限公司	112304022	23 中国银行 CD022	34,000	3,343,189.34
中国银行股份有限公司	112304023	23 中国银行 CD023	2,700	264,525.10
中国银行股份有限公司	112304024	23 中国银行 CD024	26	2,605.08
中国银行股份有限公司	112304025	23 中国银行 CD025	2,700	264,509.24
中国银行股份有限公司	112304025	23 中国银行 CD025	2,700	264,472.79
中国银行股份有限公司	112304025	23 中国银行 CD025	2,900	283,497.74
中国银行股份有限公司	112304025	23 中国银行 CD025	2,900	283,497.45
中国银行股份有限公司	112304026	23 中国银行 CD026	51,000	5,015,891.76
中国银行股份有限公司	112304032	23 中国银行 CD032	2,700	264,368.63
中国银行股份有限公司	112304045	23 中国银行 CD045	13	1,288.98

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	30,240	3,024,000.00
中国银行股份有限公司	012383553	23 福高国资 SCP002	15,120	1,512,000.00
中国银行股份有限公司	012384563	23 东泰投资 SCP001	12,119	1,211,914.00
中国银行股份有限公司	012384567	23 常德经建 SCP003	12,119	1,211,914.00
中国银行股份有限公司	032380567	23 平潭城发 PPN001	10,530	1,053,106.45
中国银行股份有限公司	032380965	23 上饶城投 PPN003	39,920	3,992,433.01
中国银行股份有限公司	042380569	23 云能投 CP012	45,360	4,536,000.00
中国银行股份有限公司	082380667	23 华能罗源 ABN001 优先	251,369	25,139,370.42
中国银行股份有限公司	082380820	23 华电山西 ABN001 优先	67,701	6,770,052.60
中国银行股份有限公司	082380909	23 京东东裕 2ABN001 优先 A	14,633	1,463,311.80
中国银行股份有限公司	092100012	21 长城资本债 01BC	14,531	1,408,603.07
中国银行股份有限公司	092100012	21 长城资本债 01BC	18,163	1,760,753.84
中国银行股份有限公司	092100012	21 长城资本债 01BC	20,453	1,982,972.58
中国银行股份有限公司	102101129	21 江西交投 MTN004	4,585	467,910.11
中国银行股份有限公司	102101706	21 京住总集 MTN002	16,051	1,625,877.47
中国银行股份有限公司	102101832	21 建发 MTN001	2,248	228,181.56
中国银行股份有限公司	102101956	21 戴姆勒财 MTN002BC	2,248	226,240.16
中国银行股份有限公司	102102329	21 中建四局 MTN002	2,248	235,985.73
中国银行股份有限公司	102180037	21 龙城发展 MTN004	65,570	6,556,348.70
中国银行股份有限公司	102280732	22 南昌城投 MTN001	196,710	20,005,763.77

中国银行股份有限公司	102282189	22 柳州钢铁 MTN002(绿色)	191	19,070.35
中国银行股份有限公司	102300486	23 华能 MTN015	15,120	1,512,000.00
中国银行股份有限公司	102380398	23 中船租 MTN001BC( 可持续挂钩)	14,010	1,401,126.32
中国银行股份有限公司	102380568	23 云能投 MTN001	4,670	467,222.02
中国银行股份有限公司	102380686	23 宁夏国资 MTN001	4,670	467,047.08
中国银行股份有限公司	102380846	23 中广核租 MTN002(碳中和 债)	5,625	562,550.41
中国银行股份有限公司	102381130	23 天马电子 MTN003	4,980	498,044.63
中国银行股份有限公司	102381265	23 福建港口 MTN002	4,980	498,046.94
中国银行股份有限公司	102381341	23 首农食品 MTN002	63,180	6,319,652.00
中国银行股份有限公司	102381573	23 南昌轨交 MTN003(绿色)	4,776	477,644.37
中国银行股份有限公司	102381732	23 国新租赁 MTN001	18,884	1,899,671.80
中国银行股份有限公司	102382270	23 贵州高速 MTN002	21,640	2,164,177.38
中国银行股份有限公司	102382357	23 绿城房产 MTN001(绿色)	82,400	8,240,970.34
中国银行股份有限公司	102382465	23 云南机场 MTN001	136,080	13,608,000.00
中国银行股份有限公司	102382502	23 华发实业 MTN003B	151,200	15,120,000.00
中国银行股份有限公司	102382515	23 中建六局 MTN001(科创 票据)	8,240	824,083.30
中国银行股份有限公司	102382568	23 闽冶金 MTN003	30,240	3,024,000.00
中国银行股份有限公司	102382594	23 华侨城 MTN005	90,720	9,072,000.00

中国银行股份有限公司	102382652	23 本钢集团 MTN001(科创 票据)	15,120	1,512,000.00
中国银行股份有限公司	102382703	23 湘建工 MTN002(科创 票据)	45,958	4,596,259.78
中国银行股份有限公司	102382927	23 中建投资 MTN001	25,137	2,513,931.08
中国银行股份有限公司	102383017	23 新创建 MTN002BC	9,594	959,544.44
中国银行股份有限公司	102383076	23 中建七局 MTN002(科创 票据)	8,936	893,848.48
中国银行股份有限公司	102383134	23 中交天航 MTN003(科创 票据)	973	97,294.40
中国银行股份有限公司	102383173	23 中航租赁 MTN003	938	93,764.40
中国银行股份有限公司	1828012	18 中信银行二 级 02	17,240	1,750,772.00
中国银行股份有限公司	1920059	19 江苏银行二 级	5,861	595,871.28
中国银行股份有限公司	1920076	19 徽商银行永 续债	170,700	17,457,638.65
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	196,710	20,261,813.90
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永 续债 01	8,186	859,194.56
中国银行股份有限公司	2320044	23 湖南银行 01	10,820	1,082,000.00
中国银行股份有限公司	2389373	23 汇聚融 1A1_BC	59,055	5,905,515.00
中国银行股份有限公司	242300001	23 宁波银行永 续债 01	10,820	1,088,801.70
中国银行股份有限公司	242300001	23 宁波银行永 续债 01	21,640	2,177,120.83
中国银行股份有限公司	242300001	23 宁波银行永 续债 01	21,640	2,177,120.83
中国银行股份有限公司	242300001	23 宁波银行永 续债 01	21,640	2,177,603.40
中国银行股份有限公司	242300001	23 宁波银行永 续债 01	32,460	3,266,405.10
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	16,073	1,607,280.60

中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	123,600	12,360,000.00
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	29,506	2,950,840.61
中国银行股份有限公司	UL492881	23 龙湖拓展 MTN001	75,740	7,574,000.00
中国银行股份有限公司	UL510018	23 中联重科 ABN002 优先 A1(科创票据)	73,464	7,346,426.20
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	11,940	1,210,072.43
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	17,910	1,814,952.83
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	29,850	3,025,151.24
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	29,850	3,028,581.00
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	45,360	4,626,025.12
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	81,890	8,338,047.99
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2128051	21 工商银行二级 02	24,540	2,504,283.80

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	3,750	375,192.62
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	10,820	1,082,099.04
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	108,200	10,820,000.00
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	2,323	238,022.08
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	3,180	325,843.28
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	3,180	325,843.28
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	4,216	431,780.27
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	4,865	498,462.79

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	9,837	1,007,487.31
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	960	98,342.34
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2028017	20 农业银行永 续债 01	19,569	2,007,124.27
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2028041	20 工商银行二 级 01	6,523	670,684.54
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2128002	21 工商银行二 级 01	12,630	1,336,952.64
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	8,379	838,091.26
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	41,381	4,139,258.13
中银国际证 券股份有限 公司	115629	23 津投 13	2,388	238,800.00
中银国际证 券股份有限 公司	138907	23 信科 K1	590	59,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	1828010	18 建设银行二 级 01	147,300	14,889,113.46

中银国际证 券股份有限 公司	1828010	18 建设银行二 级 01	163,780	16,622,851.10
中银国际证 券股份有限 公司	1828013	18 建设银行二 级 02	115,400	11,692,951.16
中银国际证 券股份有限 公司	1828013	18 建设银行二 级 02	46,160	4,677,914.41
中银国际证 券股份有限 公司	185065	21 华电 07	1,080	108,799.20
中银国际证 券股份有限 公司	1928004	19 农业银行二 级 02	56,030	5,695,959.37
中银国际证 券股份有限 公司	1928006	19 工商银行二 级 01	60,340	6,134,104.06
中银国际证 券股份有限 公司	1928009	19 农业银行二 级 04	4,769	480,090.16
中银国际证 券股份有限 公司	1928009	19 农业银行二 级 04	8,620	877,135.86
中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	3,179	320,398.07
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	1,920	196,226.64
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	1,920	196,226.64
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	2,323	237,517.40
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	29,850	3,029,300.39
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	29,850	3,025,995.99

中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	29,850	3,025,995.99
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	3,180	325,116.79
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	4,760	486,691.62
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	45,360	4,616,079.54
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	5,299	541,880.93
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	5,759	588,679.93
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	6,969	712,552.21
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	8,439	863,001.17
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	1,875	191,187.80
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	14,053	1,431,710.60
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	2,856	291,121.07
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	30,240	3,068,101.89
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	30,240	3,068,389.17
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	30,240	3,068,389.17

中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	7,501	764,780.47
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	7,734	787,752.90
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	7,734	787,752.90
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	2,323	236,530.30
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	4,396	447,148.44
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	7,326	745,247.41
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	1,913	193,958.38
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	1,913	193,916.85
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	1,913	193,826.73
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	3,827	387,889.96
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	67,701	6,969,513.56
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	9,567	969,391.98
中银国际证 券股份有限 公司	2389307	23 欣荣 2 优先	4,944	494,400.00
中银国际证 券股份有限 公司	252674	23 岷交 D2	4,721	472,096.20

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	BOCIZGH HZ37	中银证券中国 红-汇中 37 号 集合资产管理 计划	106,290,463	110,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCIZGH HZ37	中银证券中国 红-汇中 37 号 集合资产管理 计划	131,106,147	135,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCIZGH HZ37	中银证券中国 红-汇中 37 号 集合资产管理 计划	194,269,063	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCIZGH HZ37	中银证券中国 红-汇中 37 号 集合资产管理 计划	29,120,559	30,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCIZGH HZ37	中银证券中国 红-汇中 37 号 集合资产管理 计划	48,538,977	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCIZGH HZ37	中银证券中国 红-汇中 37 号 集合资产管理 计划	48,548,403	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCIZGH HZ37	中银证券中国 红-汇中 37 号 集合资产管理 计划	50,301,811	50,000,000.00
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	139,990,667	150,000,000.00
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	140,108,350	150,000,000.00

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	140,357,444	150,000,000.00
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	185,735,513	200,000,000.00
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	28,222,013	30,000,000.00
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	32,950,480	35,000,000.00
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	466,809,822	500,000,000.00
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	483,278,562	500,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ- ZYLC032	中银证券-中 银理财 32 号 单一资产管理 计划	285,008,550	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ- ZYLC032	中银证券-中 银理财 32 号 单一资产管理 计划	29,443,518	30,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ- ZYLC032	中银证券-中 银理财 32 号 单一资产管理 计划	47,915,668	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ- ZYLC032	中银证券-中 银理财 32 号 单一资产管理 计划	479,432,352	500,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ- ZYLC032	中银证券-中 银理财 32 号 单一资产管理 计划	48,694,975	50,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ- ZYLC032	中银证券-中 银理财 32 号 单一资产管理 计划	48,699,718	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ- ZYLC032	中银证券-中 银理财 32 号 单一资产管理 计划	57,012,543	60,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ- ZYLC032	中银证券-中 银理财 32 号 单一资产管理 计划	67,698,259	70,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ- ZYLC032	中银证券-中 银理财 32 号 单一资产管理 计划	67,928,190	70,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ- ZYLC032	中银证券-中 银理财 32 号 单一资产管理 计划	68,694,799	70,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ- ZYLC032	中银证券-中 银理财 32 号 单一资产管理 计划	68,925,905	72,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ- ZYLC032	中银证券-中 银理财 32 号 单一资产管理 计划	76,452,599	80,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ- ZYLC032	中银证券-中 银理财 32 号 单一资产管理 计划	95,858,896	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ- ZYLC032	中银证券-中 银理财 32 号 单一资产管理 计划	96,052,252	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ- ZYLC032	中银证券-中 银理财 32 号 单一资产管理 计划	96,683,747	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ- ZYLC032	中银证券-中 银理财 32 号 单一资产管理 计划	97,924,011	100,000,000.00

中银基金管理有限公司	163820	中银货币 B	58,000	58,000.00
中银基金管理有限公司	163820	中银货币 B	58,000	58,000.00
中银基金管理有限公司	163820	中银货币 B	58,000	58,000.00

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	14,224,688.49
产品托管费	中国银行股份有限公司	1,011,309.13
11 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	41,705,000.00
14 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	1,700,000.00
14 日质押式逆回购	中国银行股份有限公司	178,000.00
1 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	5,612,928.60
1 日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	1,377,000.00
21 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	39,949,000.00
3 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	2,854,000.00
7 日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	2,160,237.60
7 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	1,046,000.00
现券买入	中国银行股份有限公司	134,560,908.36
现券买入	中银国际证券股份有限公司	5,454,946.33
现券卖出	中银国际证券股份有限公司	11,308,868.17
证券交易佣金	中银国际证券股份有限公司	6,664.85

## 八、后市展望及下阶段投资策略

流动性整体宽松基调不变及经济温和修复的新周期下，预计 2024 年债券表现仍有韧性，权益市场仍需等待筑底回升的机会。固收投资方面，本产品下阶段将继续根据市场变化灵活调整持仓结构，择机增配适当久期票息资产；权益投资方面，本产品将控制加仓节

奏，分散投资，优化资产配置。

## 中银理财-（2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-（2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

