

中银理财-（2年）最短持有期混合类理财产品 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	CYQHH2Y
理财产品名称	中银理财-（2年）最短持有期混合类理财产品
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001021000536
产品类型	混合类产品
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	03 三级(中)
理财产品成立日	2021-10-09
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
CYQHH2YA	2,506,819,143.17	1.018815	1.018815	2,553,985,076.21	2.15%
CYQHH2YB	1,694,266,915.33	1.020902	1.020902	1,729,681,153.45	2.25%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：119.03%

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	53,465.62	12.46%	57,165.70	11.34%
同业存单	-	0.00%	-	0.00%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	1,721.37	0.34%
债券	-	0.00%	346,318.31	68.72%
非标准化债权类 资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	68,392.85	13.57%
境外投资资产	-	0.00%	26,463.28	5.25%
商品类资产	-	0.00%	-	0.00%
另类资产	-	0.00%	-	0.00%
公募基金	-	0.00%	3,870.51	0.77%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	375,560.17	87.54%	-	0.00%
合计	429,025.79	100%	503,932.03	100%

注：报告期末本理财产品持仓金融衍生品 223.33 万元。

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	57,165.70	11.34%
2	XS2420457850：BCHINA 4.4 11/04/26	9,285.97	1.84%
3	XS2406874292：BCHINA 4.4 11/04/26	8,622.16	1.71%
4	360028：招银优 1	7,729.34	1.53%
5	360021：交行优 1	6,400.34	1.27%
6	360018：北银优 1	6,077.73	1.21%
7	360030：建行优 1	5,950.13	1.18%
8	360001：农行优 1	4,566.30	0.91%

9	360036: 工行优 2	4,518.86	0.90%
10	360022: 光大优 2	4,171.15	0.83%

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	中银理财有限责任公司（2 年最短持有期混合类）
账号	745875221982
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

本产品为开放式产品，报告期内，产品管理人合理安排资产配置结构，控制资产久期，严格按照产品说明书约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本报告期内，本产品未发生重大流动性风险事件。

七、本运作期主要操作回顾

（一） 主要投资策略及操作

（1） 固收部分：

运作期内，积极把握利率下行以及地方债务风险化解机会，合理控制久期风险，严格控制信用风险，延续高等级、中短久期票息策略，将其作为组合重要基础收益来源。操作上，主要持有高等级信用债和部分债券型基金，动态控制组合久期。

（2） 权益部分：

运作期内，根据产品情况严格控制权益敞口，适度把握市场的结构性机会，一方面，根据市场情况，围绕收益目标和波动控制，动态管理权益资产配置比例；另一方面，持续优化权益资产结构，紧扣国家战略，挖掘市场主线，适度参与市场热点机会。

（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	112304013	23 中国银行 CD013	10,200	1,009,512.09
中国银行股份有限公司	112304018	23 中国银行 CD018	5,100	500,025.88
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	112304025	23 中国银行 CD025	2,900	283,497.74
中国银行股份有限公司	1928001	19 中国银行永续债 01	43,150	4,560,725.60
中国银行股份有限公司	1928001	19 中国银行永续债 01	8,630	912,101.97
中银国际控股有限公司	XS2406874 292	BCHINA 4.4 11/04/26	153	106,656,200.95
中银国际控股有限公司	XS2414737 911	BCHINA 4.75 10/24/23	5	3,497,268.13
中银国际控股有限公司	XS2415688 907	BCHINA 4.7 04/24/24	4	2,802,219.43
中银国际控股有限公司	XS2416404 007	BCHINA 5.25 03/12/24	4	2,839,573.47
中银国际控股有限公司	XS2418690 165	BCHINA 6.25 06/23/23	3	1,351,463.82
中银国际控股有限公司	XS2418690 322	BCHINA 6.25 06/23/23	6	2,702,927.65
中银国际控股有限公司	XS2420127 800	BCHINA 3.25 07/16/26	10	6,801,836.07
中银国际控股有限公司	XS2422961 685	BCHINA 2.25 07/10/24	10	6,957,859.14
中银国际控股有限公司	XS2427227 959	BCHINA 5.75 11/15/24	10	6,575,519.64
中银国际控股有限公司	XS2427855 411	BCHINA 4.25 07/19/24	5	3,419,323.17
中银国际控股有限公司	XS2439674 818	BCHINA 3.2 09/25/26	5	3,468,161.65

中银国际控 股份有限公司	XS2448332 507	BCHINA 3.2 09/25/26	10	6,898,033.72
-----------------	------------------	------------------------	----	--------------

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	032380472	23 常德城投 PPN007	15,590	1,604,830.08
中国银行股份有限公司	032380472	23 常德城投 PPN007	15,590	1,605,182.15
中国银行股份有限公司	032380472	23 常德城投 PPN007	19,695	1,976,945.35
中国银行股份有限公司	032381012	23 常德城发 PPN001	55,255	5,518,147.69
中国银行股份有限公司	032381012	23 常德城发 PPN001	82,883	8,288,269.80
中国银行股份有限公司	042380292	23 广西金控 CP001	9,690	969,142.97
中国银行股份有限公司	082380110	23 新能源 3ABN001 优 先(碳中和债)	9,210	921,189.25
中国银行股份有限公司	082380191	23 新能源 4ABN002 优 先(碳中和债)	9,690	969,066.37
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	29,690	3,028,118.73
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	40,390	4,179,266.39
中国银行股份有限公司	101901234	19 华电 MTN002B	68,850	7,256,574.58
中国银行股份有限公司	102000518	20 河钢集 MTN004	25,821	2,646,309.84
中国银行股份有限公司	102002001	20 中建三局 MTN002	44,280	4,599,536.29
中国银行股份有限公司	102002203	20 广州城投 MTN001	143,271	14,936,619.24
中国银行股份有限公司	102101189	21 豫水利 MTN001(乡村 振兴)	68,850	6,963,648.52
中国银行股份有限公司	102101617	21 陕延油 MTN003	10,350	1,081,514.97

中国银行股份有限公司	102102121	21 华电股 MTN005	44,150	4,540,237.34
中国银行股份有限公司	102103103	21 蜀道投资 MTN006	35,320	3,610,226.35
中国银行股份有限公司	102103240	21 水利十四 MTN002	14,916	1,501,162.11
中国银行股份有限公司	102280239	22 鲁能源 MTN001	61,490	6,194,083.55
中国银行股份有限公司	102280270	22 中化股 MTN001A	15,060	1,538,669.58
中国银行股份有限公司	102280270	22 中化股 MTN001A	4,820	489,766.18
中国银行股份有限公司	102280270	22 中化股 MTN001A	9,640	979,532.36
中国银行股份有限公司	102280270	22 中化股 MTN001A	9,640	982,097.13
中国银行股份有限公司	102280427	22 江宁经开 MTN001	37,170	3,790,735.31
中国银行股份有限公司	102281110	22 福瑞能源 MTN001	22,140	2,239,337.02
中国银行股份有限公司	102281518	22 水电八局 MTN002(绿色)	27,628	2,756,700.64
中国银行股份有限公司	102281518	22 水电八局 MTN002(绿色)	27,628	2,756,695.11
中国银行股份有限公司	102281518	22 水电八局 MTN002(绿色)	27,628	2,756,695.11
中国银行股份有限公司	102281518	22 水电八局 MTN002(绿色)	52,500	5,235,142.50
中国银行股份有限公司	102281663	22 联发集 MTN002	104,650	10,352,019.86
中国银行股份有限公司	102300441	23 华能 MTN013	22,140	2,213,479.71
中国银行股份有限公司	102300475	23 华能 MTN014	11,590	1,159,289.75
中国银行股份有限公司	102300486	23 华能 MTN015	12,100	1,210,101.64
中国银行股份有限公司	102300571	23 金辉集团 MTN002	2,392	239,227.79
中国银行股份有限公司	102380023	23 南安市贸 MTN001	22,980	2,328,141.48

中国银行股份有限公司	102380100	23 华能 MTN001(能源 保供特别债)	9,060	906,097.55
中国银行股份有限公司	102380118	23 华电股 MTN001(能源 保供特别债)	43,150	4,315,445.69
中国银行股份有限公司	102380118	23 华电股 MTN001(能源 保供特别债)	94,600	9,460,977.10
中国银行股份有限公司	102380146	23 华电 MTN002B(能 源保供特别 债)	50,200	5,021,600.90
中国银行股份有限公司	102380225	23 华能 MTN003(能源 保供特别债)	7,720	774,097.14
中国银行股份有限公司	102380277	23 华能 MTN004(能源 保供特别债)	3,450	354,253.94
中国银行股份有限公司	102380372	23 中交三航 MTN001	37,500	3,751,137.29
中国银行股份有限公司	102380454	23 华能 MTN007(能源 保供特别债)	6,900	707,041.62
中国银行股份有限公司	102380488	23 中冶 MTN006	22,140	2,264,800.23
中国银行股份有限公司	102380596	23 华电股 MTN003(能源 保供特别债)	11,070	1,129,319.33
中国银行股份有限公司	102380652	23 珠海华发 MTN001	75,000	7,500,799.18
中国银行股份有限公司	102380686	23 宁夏国资 MTN001	9,210	921,092.86
中国银行股份有限公司	102380843	23 水电八局 MTN001	53,540	5,380,941.33
中国银行股份有限公司	102381069	23 厦国贸控 MTN001(科创 票据)	133,850	13,532,034.22
中国银行股份有限公司	102381090	23 水电八局 MTN002	83,720	8,372,000.00
中国银行股份有限公司	102381118	23 西安高新 MTN002	11,008	1,101,583.19
中国银行股份有限公司	102381150	23 碧桂园 MTN002	969	96,910.46

中国银行股份有限公司	102381152	23 碧桂园 MTN001	969	96,910.06
中国银行股份有限公司	102381189	23 厦港务 MTN001	26,490	2,649,727.39
中国银行股份有限公司	102381217	23 湘建工 MTN001(科创 票据)	150,283	15,053,794.51
中国银行股份有限公司	102381341	23 首农食品 MTN002	19,100	1,910,499.42
中国银行股份有限公司	102381581	23 中核汇能 MTN001A(碳 中和债)	47,150	4,715,398.07
中国银行股份有限公司	102381619	23 水利十四 MTN002	34,770	3,491,691.20
中国银行股份有限公司	102381619	23 水利十四 MTN002	47,150	4,716,256.04
中国银行股份有限公司	102381997	23 中煤集团 MTN002	8,910	891,067.43
中国银行股份有限公司	102382436	23 大唐集 MTN014	15,590	1,559,141.42
中国银行股份有限公司	102382520	23 河钢集 MTN013	46,770	4,677,516.26
中国银行股份有限公司	102382772	23 陕有色 MTN002	25,278	2,528,577.16
中国银行股份有限公司	102382810	23 大唐山西 MTN002	38,326	3,832,965.60
中国银行股份有限公司	102382904	23 北控集 MTN001	12,833	1,283,636.30
中国银行股份有限公司	102382927	23 中建投资 MTN001	82,814	8,294,943.74
中国银行股份有限公司	102383020	23 晋能煤业 MTN009	85,963	8,580,705.56
中国银行股份有限公司	102383109	23 中电路桥 MTN001	14,135	1,413,626.11
中国银行股份有限公司	102383228	23 福建港口 MTN003	28,822	2,883,004.69
中国银行股份有限公司	102383229	23 温州交通 MTN003	82,814	8,286,081.74
中国银行股份有限公司	102383255	23 上海宝冶 MTN001	55,209	5,521,459.96
中国银行股份有限公司	102383321	23 东南国资 MTN004	82,814	8,282,140.16

中国银行股份有限公司	102383376	23 本钢集团 MTN002(科创票据)	23,920	2,392,226.94
中国银行股份有限公司	132100133	21 福瑞能源 GN004(碳中和债)	37,720	3,913,044.85
中国银行股份有限公司	132380060	23 三峡 GN001	11,070	1,107,087.45
中国银行股份有限公司	132380065	23 华能水电 GN015	12,100	1,210,112.53
中国银行股份有限公司	132380067	23 晋能电力 GN011(碳中和债)	11,590	1,154,353.06
中国银行股份有限公司	1920076	19 徽商银行永续债	43,150	4,402,501.17
中国银行股份有限公司	1920076	19 徽商银行永续债	43,150	4,400,153.81
中国银行股份有限公司	1928002	19 民生银行二级 01	11,780	1,213,690.93
中国银行股份有限公司	1928002	19 民生银行二级 01	11,780	1,213,499.58
中国银行股份有限公司	1928022	19 兴业银行二级 01	61,894	6,305,327.85
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	33,210	3,519,917.94
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	27,003	2,849,265.88
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	27,035	2,853,804.31
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	2,835	287,415.04
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	55,350	5,800,641.25
中国银行股份有限公司	198227	23 四川债 27	77,235	7,726,236.81
中国银行股份有限公司	198234	23 四川债 34	30,310	3,032,072.97
中国银行股份有限公司	2020082	20 华润银行永续债	131,250	13,420,955.62
中国银行股份有限公司	2023001	20 人民财险	13,650	1,371,180.72
中国银行股份有限公司	2023001	20 人民财险	3,450	352,871.52

中国银行股份有限公司	2023002	20 中邮人寿	17,660	1,800,156.88
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	24,200	2,478,660.80
中国银行股份有限公司	2023021	20 中邮人寿 02	33,210	3,517,174.79
中国银行股份有限公司	2028024	20 中信银行二 级	44,050	4,499,015.92
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	14,160	1,520,674.60
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	14,443	1,544,617.08
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	140,310	15,106,822.33
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	15,590	1,677,893.72
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永 续债	70,800	7,616,029.22
中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永 续债	104,152	10,485,232.43
中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永 续债	22,237	2,267,133.47
中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永 续债	51,301	5,168,443.33
中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永 续债	72,774	7,419,653.61
中国银行股份有限公司	2120064	21 恒丰银行永 续债	52,076	5,197,643.20
中国银行股份有限公司	2120115	21 厦门国际银 行永续债 01	26,770	2,664,525.18
中国银行股份有限公司	2120118	21 广州银行永 续债	104,650	10,361,113.95
中国银行股份有限公司	2120118	21 广州银行永 续债	17,660	1,804,080.48
中国银行股份有限公司	2120118	21 广州银行永 续债	39,390	4,048,255.88
中国银行股份有限公司	2121026	21 杭州联合农 商永续债 01	111,500	11,214,313.20
中国银行股份有限公司	2121026	21 杭州联合农 商永续债 01	68,850	7,093,296.15
中国银行股份有限公司	2123006	21 交银康联人 寿 01	17,660	1,827,368.01
中国银行股份有限公司	2126003	21 华侨永亨中 国 01	12,480	1,265,305.08

中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永续债 01	26,260	2,753,992.70
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	26,260	2,631,209.84
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	39,390	3,949,258.61
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	65,650	6,576,378.04
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永续债	88,100	9,185,385.29
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永续债	9,539	1,003,885.72
中国银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永续债	77,950	8,087,147.95
中国银行股份有限公司	2128025	21 建设银行二级 01	44,050	4,474,211.36
中国银行股份有限公司	2128025	21 建设银行二级 01	44,050	4,474,211.36
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	14,845	1,530,765.93
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	38,158	3,883,234.54
中国银行股份有限公司	2220007	22 厦门国际银行永续债 01	133,850	13,084,051.66
中国银行股份有限公司	2220007	22 厦门国际银行永续债 01	53,540	5,233,165.57
中国银行股份有限公司	2226006	22 汇丰银行 02	20,800	2,136,962.60
中国银行股份有限公司	2228001	22 邮储银行永续债 01	29,690	3,029,439.93
中国银行股份有限公司	2228032	22 建设银行绿色金融债 01	102,500	10,318,482.10
中国银行股份有限公司	2228061	22 交通银行小微债 02	210,400	21,660,243.64
中国银行股份有限公司	2305390	23 江西债 35	25,120	2,512,447.72
中国银行股份有限公司	2305401	23 浙江债 28	15,155	1,515,500.00
中国银行股份有限公司	2305424	23 河北债 24	30,310	3,032,894.38
中国银行股份有限公司	2305554	23 安徽债 62	29,690	2,967,643.17
中国银行股份有限公司	2320005	23 厦门国际银行三农债 01	9,210	921,076.75

中国银行股份有限公司	2320031	23 华润银行小微债 01	10,570	1,057,078.19
中国银行股份有限公司	2328006	23 交通银行小微债 01	205,000	20,773,896.92
中国银行股份有限公司	2328006	23 交通银行小微债 01	251,200	25,129,245.26
中国银行股份有限公司	2328007	23 浦发银行绿色金融债 01	100,480	10,052,420.13
中国银行股份有限公司	2328007	23 浦发银行绿色金融债 01	251,200	25,119,649.56
中国银行股份有限公司	2328007	23 浦发银行绿色金融债 01	257,450	25,850,535.09
中国银行股份有限公司	2371340	23 河北债 62	58,602	5,861,143.26
中国银行股份有限公司	2371340	23 河北债 62	87,903	8,788,198.75
中国银行股份有限公司	2371358	23 云南债 38	28,410	2,841,412.55
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	153,750	15,375,000.00
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	81,130	8,113,747.02
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	84,700	8,470,779.24
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	89,480	8,948,823.90
中国银行股份有限公司	272380014	23 东方二级资本债 01BC	111,850	11,186,222.40
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	11,102	1,110,293.38
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	138,023	13,884,430.18
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	29,233	2,923,553.15
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	48,516	4,851,611.00
中国银行股份有限公司	809112	23 湖南 140	27,605	2,759,156.66
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	092280065	22 工行二级资本债 03A	44,050	4,389,397.49

中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	092280065	22 工行二级资本债 03A	44,050	4,387,560.61
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	29,690	3,021,462.23
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	092280134	22 工行二级资本债 04A	44,050	4,482,453.12
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1920049	19 成都银行二级	8,320	885,719.53
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1920049	19 成都银行二级	8,320	885,561.76
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2020016	20 江苏银行永续债	12,100	1,245,664.75
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2020016	20 江苏银行永续债	24,200	2,487,985.06
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2020016	20 江苏银行永续债	24,200	2,492,016.78

中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2020016	20 江苏银行永续债	33,210	3,418,700.50
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2020016	20 江苏银行永续债	42,350	4,354,397.35
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2028006	20 邮储银行永续债	26,490	2,698,086.45
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2028006	20 邮储银行永续债	44,550	4,498,032.89
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2028006	20 邮储银行永续债	60,500	6,215,957.55
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	17,000	1,762,345.87
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	184,080	18,845,789.13
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	26,490	2,674,622.25

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	42,480	4,334,213.74
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	44,550	4,611,482.73
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	56,640	5,776,729.27
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	70,800	7,243,233.57
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	70,800	7,227,793.74
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2028032	20 农业银行永续债 02	42,480	4,570,506.82
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2028032	20 农业银行永续债 02	44,280	4,776,231.20
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2028032	20 农业银行永续债 02	70,800	7,637,146.34

中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2120089	21 北京银行永续债 01	17,660	1,865,407.32
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	12,100	1,249,681.95
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	15,210	1,555,225.54
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	15,590	1,616,848.68
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	18,520	1,892,668.07
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	24,200	2,498,301.52
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	39,390	4,050,831.63
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2128028	21 邮储银行二级 01	13,650	1,378,592.67

中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2128042	21 兴业银行二级 02	48,400	5,048,962.16
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2128044	21 工商银行永续债 02	29,690	3,069,948.97
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2228011	22 农业银行永续债 01	29,690	3,023,668.20
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2228011	22 农业银行永续债 01	91,910	9,382,654.64
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2228017	22 邮储银行二级 01	44,535	4,549,677.79
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	232280003	22 成都银行二级资本债 01	111,450	11,189,825.19
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	104,650	10,465,000.00
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	167,440	16,815,831.76

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	19,500	1,951,001.64
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2328018	23 兴业银行绿色金融债 02	37,610	3,761,274.09
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2328021	23 兴业银行小微债 01	92,250	9,225,641.96
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	110,700	11,070,974.16
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	115,900	11,594,066.00
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	141,600	14,162,483.80
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	267,700	26,770,000.00
中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司	190311	19 进出 11	10,215	1,069,766.19

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	21,759	2,221,842.35
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	25,447	2,632,722.31
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	25,447	2,629,523.61
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	8,893	906,200.49
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	63,618	6,580,507.98
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	26,672	2,667,944.57
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	43,234	4,324,570.82
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	49,193	4,919,281.60
中银国际控 股有限公司	XS2406874 292	BCHINA 4.4 11/04/26	153	106,656,200.95
中银国际控 股有限公司	XS2414737 911	BCHINA 4.75 10/24/23	5	3,497,268.13

中银国际控 股有限公司	XS2415688 907	BCHINA 4.7 04/24/24	4	2,802,219.43
中银国际控 股有限公司	XS2416404 007	BCHINA 5.25 03/12/24	4	2,839,573.47
中银国际控 股有限公司	XS2418690 165	BCHINA 6.25 06/23/23	3	1,351,463.82
中银国际控 股有限公司	XS2418690 322	BCHINA 6.25 06/23/23	6	2,702,927.65
中银国际控 股有限公司	XS2420127 800	BCHINA 3.25 07/16/26	10	6,801,836.07
中银国际控 股有限公司	XS2422961 685	BCHINA 2.25 07/10/24	10	6,957,859.14
中银国际控 股有限公司	XS2427227 959	BCHINA 5.75 11/15/24	10	6,575,519.64
中银国际控 股有限公司	XS2427855 411	BCHINA 4.25 07/19/24	5	3,419,323.17
中银国际控 股有限公司	XS2439674 818	BCHINA 3.2 09/25/26	5	3,468,161.65
中银国际控 股有限公司	XS2448332 507	BCHINA 3.2 09/25/26	10	6,898,033.72
中银国际亚 洲有限公司	00020	港股通	58,687	169,711.06
中银国际亚 洲有限公司	00390	港股通	62,791	231,530.52
中银国际亚 洲有限公司	00390	港股通	66,167	290,972.42
中银国际亚 洲有限公司	00390	港股通	70,139	291,193.20
中银国际亚 洲有限公司	00728	港股通	14,417	50,637.37
中银国际亚 洲有限公司	00728	港股通	93,446	351,677.42
中银国际亚 洲有限公司	00836	港股通	33,762	520,100.49
中银国际亚 洲有限公司	00981	港股通	109,478	1,745,778.94
中银国际亚 洲有限公司	00981	港股通	11,916	173,687.05
中银国际亚 洲有限公司	00981	港股通	2,074	33,575.11
中银国际亚 洲有限公司	00981	港股通	25,747	438,988.63
中银国际亚 洲有限公司	00981	港股通	32,200	692,538.84

中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	44,911	682,085.02
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	46,986	896,254.01
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	62,713	1,390,636.49
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	7,260	111,224.53
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	70,144	1,295,465.20
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	75,369	1,161,335.28
中银国际亚洲有限公司	01024	港股通	4,734	289,968.31
中银国际亚洲有限公司	01024	港股通	4,734	289,968.31
中银国际亚洲有限公司	01024	港股通	439	23,628.31
中银国际亚洲有限公司	01024	港股通	526	29,431.92
中银国际亚洲有限公司	01024	港股通	549	25,682.56
中银国际亚洲有限公司	01024	港股通	714	38,029.45
中银国际亚洲有限公司	01339	港股通	63,254	145,002.43
中银国际亚洲有限公司	01658	港股通	13,902	62,387.94
中银国际亚洲有限公司	01658	港股通	27,805	134,514.51
中银国际亚洲有限公司	01658	港股通	5,149	22,757.70
中银国际亚洲有限公司	01658	港股通	6,179	28,527.66
中银国际亚洲有限公司	01800	港股通	41,044	144,715.08
中银国际亚洲有限公司	01800	港股通	72,853	291,168.15
中银国际亚洲有限公司	01810	港股通	629	111,049.00
中银国际亚洲有限公司	01816	港股通	144,945	231,598.27
中银国际亚洲有限公司	01816	港股通	175,066	291,245.92

中银国际亚洲有限公司	01880	港股通	1,355	255,276.52
中银国际亚洲有限公司	01898	港股通	12,872	68,925.49
中银国际亚洲有限公司	01898	港股通	14,417	84,879.62
中银国际亚洲有限公司	01898	港股通	22,106	131,395.97
中银国际亚洲有限公司	01898	港股通	6,531	37,628.69
中银国际亚洲有限公司	02099	港股通	10,555	292,376.66
中银国际亚洲有限公司	02099	港股通	820	23,299.49
中银国际亚洲有限公司	02357	港股通	12,358	45,703.27
中银国际亚洲有限公司	02357	港股通	19,051	68,551.42
中银国际亚洲有限公司	02869	港股通	53,652	194,191.30
中银国际亚洲有限公司	03958	港股通	27,288	108,000.84
中银国际亚洲有限公司	03958	港股通	27,526	99,742.78
中银国际亚洲有限公司	06030	港股通	60,748	785,512.97
中银国际亚洲有限公司	06606	港股通	5,480	130,317.67
中银国际亚洲有限公司	06865	港股通	1,892	37,020.19
中银国际亚洲有限公司	06865	港股通	7,260	134,860.82
中银国际亚洲有限公司	06865	港股通	8,041	163,502.62
中银国际亚洲有限公司	09926	港股通	4,060	174,073.20
中银国际证券股份有限公司	002739	万达电影	50,685	635,104.91
中银国际证券股份有限公司	110053	苏银转债	3,576	439,190.02

中银国际证 券股份有限 公司	110053	苏银转债	4,330	542,892.09
中银国际证 券股份有限 公司	110053	苏银转债	485	59,222.41
中银国际证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	2,315	241,721.52
中银国际证 券股份有限 公司	113055	成银转债	1,389	169,939.95
中银国际证 券股份有限 公司	113055	成银转债	45	5,498.26
中银国际证 券股份有限 公司	115072	23 联发 01	6,900	704,583.58
中银国际证 券股份有限 公司	136450	16 油服 02	37,610	3,901,347.64
中银国际证 券股份有限 公司	137974	22 交 YK01	2,835	280,383.33
中银国际证 券股份有限 公司	137974	22 交 YK01	5,670	560,815.89
中银国际证 券股份有限 公司	185991	22 新汶 Y1	131,250	13,204,668.75
中银国际证 券股份有限 公司	185991	22 新汶 Y1	33,270	3,348,725.31
中银国际证 券股份有限 公司	185991	22 新汶 Y1	40,155	4,041,721.21
中银国际证 券股份有限 公司	1928001	19 中国银行永 续债 01	43,150	4,560,725.60
中银国际证 券股份有限 公司	1928001	19 中国银行永 续债 01	8,630	912,101.97

中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	11,340	1,165,106.65
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	27,035	2,754,399.69
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	67,990	6,919,994.42
中银国际证 券股份有限 公司	2028013	20 农业银行二 级 01	13,650	1,367,706.79
中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二 级	11,780	1,185,017.46
中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二 级	26,411	2,654,528.74
中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二 级	5,890	592,086.85
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	28,320	2,896,075.98
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	44,150	4,654,390.19
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	5,670	589,214.38
中银国际证 券股份有限 公司	2120110	21 北京银行永 续债 02	161,520	16,044,298.46
中银国际证 券股份有限 公司	212380003	23 华夏银行债 01	257,450	25,845,795.19
中银国际证 券股份有限 公司	2228014	22 交通银行二 级 01	25,447	2,613,217.08
中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	55,209	5,523,013.66

中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	65,768	6,589,022.69
中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	82,814	8,284,520.50
中银国际证 券股份有限 公司	300232	洲明科技	21,883	205,718.74
中银国际证 券股份有限 公司	300232	洲明科技	3,244	30,170.37
中银国际证 券股份有限 公司	300232	洲明科技	3,759	34,433.05
中银国际证 券股份有限 公司	300365	恒华科技	99,106	710,724.09
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	86,600	8,869,572.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	86,600	8,869,572.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	95,700	9,741,303.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	95,700	9,741,303.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	95,700	9,741,303.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	95,700	9,741,303.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	95,700	9,741,303.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	95,700	9,741,303.00
中银国际证 券股份有限 公司	600015	华夏银行	54,397	290,459.29

中银国际证 券股份有限 公司	600015	华夏银行	76,349	396,918.32
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	1,483	32,194.07
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	15,271	318,564.85
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	19,032	423,381.27
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	2,111	46,067.61
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	3,261	77,883.59
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	6,575	157,154.87
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	7,054	153,651.05
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	7,469	164,328.91
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	9,320	205,049.31
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	1,157	25,240.15
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	1,208	26,643.03
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	1,480	33,126.63
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	12,045	262,850.78

中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	15,805	330,955.18
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	2,157	48,483.48
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	2,223	46,581.40
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	2,367	51,983.41
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	5,416	120,433.79
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	6,811	141,547.85
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	7,623	155,377.53
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	80,109	1,811,239.74
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	10,762	76,090.88
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	11,285	80,040.71
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	141,911	1,027,238.50
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	15,879	116,119.37
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	2,678	19,532.04
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	21,626	161,704.20

中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	22,102	173,672.34
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	228,291	1,770,645.22
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	23,380	163,922.67
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	23,924	173,704.90
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	27,260	193,982.57
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	33,560	251,050.94
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	37,648	275,958.11
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	43,377	313,986.88
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	43,628	316,835.29
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	46,260	340,545.76
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	6,262	47,043.08
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	66,494	502,457.56
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	8,140	59,551.92
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	96,505	681,942.45

中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	1,261	123,683.88
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	1,708	159,746.28
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	1,736	161,884.93
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	2,373	220,144.11
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	2,550	249,451.23
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	3,293	322,113.22
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	3,690	369,180.50
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	884	79,729.41
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	10,148	116,293.12
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	12,116	136,519.85
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	16,503	193,617.41
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	20,444	238,615.42
中银国际证 券股份有限 公司	600962	国投中鲁	8,794	99,277.60
中银国际证 券股份有限 公司	601019	山东出版	56,116	484,919.68

中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	1,656	47,135.79
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	12,452	344,877.38
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	14,176	406,619.55
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	2,445	72,859.97
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	25,600	767,269.15
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	3,840	117,854.89
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	3,905	111,490.27
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	33,571	985,329.06
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	4,814	145,269.38
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	4,966	141,199.26
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	41,259	1,171,974.93
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	5,129	143,411.15
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	6,580	187,129.43
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	7,200	211,778.05

中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	9,406	288,856.40
中银国际证 券股份有限 公司	601098	中南传媒	18,568	210,015.26
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	11,677	174,318.24
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	15,052	242,275.03
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	18,934	307,686.81
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	2,666	48,290.03
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	36,454	636,425.27
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	39,349	639,271.99
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	4,914	70,669.03
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	5,179	94,101.20
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	5,897	95,755.29
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	73,238	1,252,768.86
中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	13,069	258,781.03
中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	28,324	518,634.13

中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	33,788	549,346.58
中银国际证 券股份有限 公司	601390	中国中铁	11,500	80,940.23
中银国际证 券股份有限 公司	601390	中国中铁	126,321	893,812.26
中银国际证 券股份有限 公司	601390	中国中铁	20,598	150,586.16
中银国际证 券股份有限 公司	601390	中国中铁	52,841	317,674.51
中银国际证 券股份有限 公司	601390	中国中铁	69,667	423,400.85
中银国际证 券股份有限 公司	601390	中国中铁	85,109	485,083.09
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	12,116	68,459.34
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	15,044	86,746.34
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	16,624	102,399.24
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	165,035	1,007,637.44
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	18,495	87,481.93
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	20,481	115,715.79
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	22,289	125,272.90

中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	22,940	135,092.44
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	24,165	150,562.51
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	25,061	145,668.90
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	27,582	175,789.54
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	28,259	173,511.79
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	3,347	20,316.98
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	3,965	25,653.83
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	4,120	25,908.79
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	4,418	24,961.40
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	45,524	237,479.80
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	69,341	425,580.61
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	74,829	387,765.74
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	8,422	47,044.18
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	8,575	49,489.12

中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	9,024	51,709.53
中银国际证 券股份有限 公司	601669	中国电建	139	964.80
中银国际证 券股份有限 公司	601669	中国电建	24,164	181,473.59
中银国际证 券股份有限 公司	601669	中国电建	43,225	330,992.25
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	12,562	80,900.17
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	135,080	572,799.63
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	224,834	1,457,640.91
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	24,452	159,669.27
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	27,591	160,303.71
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	38,947	262,902.65
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	4,120	24,566.17
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	48,960	324,993.17
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	69,126	411,632.11
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	78,438	491,862.87

中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	79,981	474,817.52
中银国际证 券股份有限 公司	601800	中国交建	13,565	150,427.24
中银国际证 券股份有限 公司	601800	中国交建	14,573	155,210.99
中银国际证 券股份有限 公司	601800	中国交建	2,713	33,086.65
中银国际证 券股份有限 公司	601800	中国交建	47,465	423,381.94
中银国际证 券股份有限 公司	601800	中国交建	86,776	793,297.09
中银国际证 券股份有限 公司	601811	新华文轩	14,351	173,653.09
中银国际证 券股份有限 公司	601811	新华文轩	21,938	273,832.51
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	2,934	32,260.35
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	29,274	328,838.46
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	4,513	49,168.31
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	8,688	96,812.28
中银国际证 券股份有限 公司	601991	大唐发电	15,653	51,345.76
中银国际证 券股份有限 公司	601991	大唐发电	63,755	200,842.74

中银国际证 券股份有限 公司	601991	大唐发电	8,456	28,076.96
中银国际证 券股份有限 公司	601995	中金公司	1,420	56,536.83
中银国际证 券股份有限 公司	601995	中金公司	2,980	120,220.99
中银国际证 券股份有限 公司	601995	中金公司	4,787	205,840.00
中银国际证 券股份有限 公司	601995	中金公司	6,007	236,314.27
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	1,831	13,773.43
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	1,831	13,953.34
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	1,937	14,315.09
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	10,905	98,634.88
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	120,440	1,121,487.69
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	173,092	1,646,336.10
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	18,201	131,063.69
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	2,025	15,042.75
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	29,109	276,677.27

中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	3,609	27,833.42
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	3,692	26,831.47
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	3,785	25,812.93
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	42,071	405,936.09
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	64,855	631,078.74
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	7,740	59,582.21
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	810	6,075.00
中银国际证 券股份有限 公司	688009	中国通号	28,494	155,592.08
中银国际证 券股份有限 公司	688009	中国通号	4,697	25,929.26
中银国际证 券股份有限 公司	688009	中国通号	88,369	526,991.99

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	ZYGJZGH HZ5720220 719	中银证券中国 红-汇中 57 号 集合资产管理 计划	106,360,349	100,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYGJZGH HZ5720220 719	中银证券中国 红-汇中 57 号 集合资产管理 计划	116,726,976	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYGJZGH HZ5720220 719	中银证券中国 红-汇中 57 号 集合资产管理 计划	116,931,712	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYGJZGH HZ5720220 719	中银证券中国 红-汇中 57 号 集合资产管理 计划	123,517,787	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYGJZGH HZ5720220 719	中银证券中国 红-汇中 57 号 集合资产管理 计划	198,019,802	160,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYGJZGH HZ5720220 719	中银证券中国 红-汇中 57 号 集合资产管理 计划	219,563,069	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYGJZGH HZ5720220 719	中银证券中国 红-汇中 57 号 集合资产管理 计划	24,737,168	20,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYGJZGH HZ5720220 719	中银证券中国 红-汇中 57 号 集合资产管理 计划	50,352,467	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYGJZGH HZ5720220 719	中银证券中国 红-汇中 57 号 集合资产管理 计划	80,868,762	70,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202132	中银证券中国 红-汇中 32 号 集合资产管理 计划	93,205,331	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ QHZ55202 20302	中银证券中国 红-汇中 55 号 集合资产管理 计划	95,822,154	100,000,000.00
中银基金管 理有限公司	005689	中银医疗保健 混合 A	331,981	802,000.00
中银基金管 理有限公司	163807	中银行业优选	668,891	802,000.00

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
中银基金管理有限公司	ZYJXIHE 120221128	中银基金-羲和 1 号集合资产管理计划	98,068,059	100,000,000.00

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	20,975,728.53
产品托管费	中国银行股份有限公司	1,031,246.83
14 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	21,569,700.00
16 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	370,994.99
1 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	7,330,180.13
1 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	4,751,500.00
1 日质押式逆回购	中国银行股份有限公司	3,311,000.00
28 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	10,527,000.00
3 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	2,623,000.00
4 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	20,484,942.87
7 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	23,966,969.30
7 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	290,000.00
现券买入	中银资产管理有限公司	233,982,580.86
现券买入	中国银行股份有限公司	29,685,114.24

八、后市展望及下阶段投资策略

从基本面看，经济正沿着高质量发展的主线运行，短期存在有效需求不足、社会预期偏弱等问题，相应的政策措施陆续推出，财政政策适度加力，地方债务风险有序化解，随着经济增速企稳和增长质量提升，社会预期将逐步改善，股票市场存在估值提升空间。流

动性的合理充裕有利于债券市场的稳健表现，下阶段重点关注政策力度和经济增长动能的变化。

资产配置方面，将继续围绕收益目标和波动控制，动态管理权益资产配置比例，沿着国家政策引导的方向重点布局扩内需、安全可控和技术变革等相关领域，挖掘市场预期差，捕捉阶段性投资机会。丰富投资策略，力争多渠道增厚产品收益、增强净值稳定性。同时，持续优化固收类资产配置，控制组合久期。

中银理财-（2年）最短持有期混合类理财产品

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年）最短持有期混合类理财产品（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

