

中银理财-智富（2年滚续）
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	ZF2Y001
理财产品名称	中银理财-智富（2年滚续）
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001021000492
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	2021-08-26
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
ZF2Y001A	2,618,079,304.55	1.009868	1.009868	2,643,916,815.35	3.85%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：114.48%

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	36,639.19	13.84%	38,979.36	13.04%
同业存单	-	0.00%	1,371.69	0.46%

拆放同业及买入返售	-	0.00%	524.70	0.18%
债券	-	0.00%	180,731.74	60.45%
非标准化债权类资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	70,469.97	23.57%
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%	6,894.60	2.31%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	228,037.25	86.16%	-	0.00%
合计	264,676.44	100%	298,972.05	100%

注：报告期末本理财产品持仓金融衍生品 10.98 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	38,979.36	13.04%
2	360028：招银优 1	8,736.13	2.92%
3	360021：交行优 1	7,234.03	2.42%
4	360018：北银优 1	6,869.40	2.30%
5	360030：建行优 1	6,725.17	2.25%
6	360001：农行优 1	5,161.09	1.73%
7	360036：工行优 2	5,107.47	1.71%
8	360022：光大优 2	4,714.47	1.58%
9	140002：平银优 01	4,630.99	1.55%
10	360019：南银优 1	4,179.46	1.40%

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（智富2年滚续）
账号	448181875531
开户行	中国银行上海市中银大厦支行营业部

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	27,000	2,672,237.88
中国银行股份有限公司	112304018	23 中国银行 CD018	13,500	1,323,597.92
中国银行股份有限公司	112304025	23 中国银行 CD025	200	19,551.57
中国银行股份有限公司	112304025	23 中国银行 CD025	200	19,551.55
中国银行股份有限公司	1928001	19 中国银行永续债 01	1,880	198,696.61
中国银行股份有限公司	1928001	19 中国银行永续债 01	9,400	993,530.03

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	012283965	22 韵达股份 SCP004	21,580	2,210,910.11
中国银行股份有限公司	012383098	23 金风科技 SCP001(科创票据)	10,790	1,079,202.53
中国银行股份有限公司	032100270	21 常德城投 PPN003	16,974	1,764,062.89
中国银行股份有限公司	032380472	23 常德城投 PPN007	12,440	1,280,569.99
中国银行股份有限公司	032380472	23 常德城投 PPN007	12,440	1,280,850.92
中国银行股份有限公司	032380472	23 常德城投 PPN007	25,785	2,588,247.56
中国银行股份有限公司	032381012	23 常德城发 PPN001	26,547	2,651,176.46
中国银行股份有限公司	032381012	23 常德城发 PPN001	39,821	3,982,072.80
中国银行股份有限公司	042380292	23 广西金控 CP001	14,210	1,421,209.66

中国银行股份有限公司	082380110	23 新能源 3ABN001 优 先(碳中和债)	9,940	994,204.25
中国银行股份有限公司	082380191	23 新能源 4ABN002 优 先(碳中和债)	14,210	1,421,097.33
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	56,580	5,854,491.02
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	65,890	6,720,200.17
中国银行股份有限公司	101901234	19 华电 MTN002B	97,450	10,270,925.10
中国银行股份有限公司	102000518	20 河钢集 MTN004	12,392	1,270,052.86
中国银行股份有限公司	102002001	20 中建三局 MTN002	66,800	6,938,776.52
中国银行股份有限公司	102101129	21 江西交投 MTN004	11,328	1,139,350.98
中国银行股份有限公司	102101189	21 豫水利 MTN001(乡村 振兴)	97,450	9,856,318.79
中国银行股份有限公司	102101617	21 陕延油 MTN003	46,830	4,893,463.39
中国银行股份有限公司	102102121	21 华电股 MTN005	35,150	3,614,707.65
中国银行股份有限公司	102103103	21 蜀道投资 MTN006	28,120	2,874,279.87
中国银行股份有限公司	102103240	21 水利十四 MTN002	5,268	530,150.03
中国银行股份有限公司	102280239	22 鲁能源 MTN001	29,543	2,975,927.69
中国银行股份有限公司	102280270	22 中化股 MTN001A	10,600	1,077,079.16
中国银行股份有限公司	102280270	22 中化股 MTN001A	21,200	2,154,158.31
中国银行股份有限公司	102280270	22 中化股 MTN001A	21,200	2,159,798.67
中国银行股份有限公司	102280270	22 中化股 MTN001A	33,120	3,383,847.03
中国银行股份有限公司	102281110	22 福瑞能源 MTN001	33,400	3,378,222.96
中国银行股份有限公司	102281518	22 水电八局 MTN002(绿 色)	13,274	1,324,445.38

中国银行股份有限公司	102281518	22 水电八局 MTN002(绿色)	13,274	1,324,445.38
中国银行股份有限公司	102281518	22 水电八局 MTN002(绿色)	13,274	1,324,448.03
中国银行股份有限公司	102281518	22 水电八局 MTN002(绿色)	30,440	3,035,385.48
中国银行股份有限公司	102281663	22 联发集 MTN002	37,050	3,665,000.82
中国银行股份有限公司	102281903	22 宿迁城投 MTN003	33,603	3,346,277.47
中国银行股份有限公司	102300441	23 华能 MTN013	33,400	3,339,215.10
中国银行股份有限公司	102300441	23 华能 MTN013	43,160	4,316,324.29
中国银行股份有限公司	102300475	23 华能 MTN014	5,560	556,139.00
中国银行股份有限公司	102300486	23 华能 MTN015	14,500	1,450,121.80
中国银行股份有限公司	102300571	23 金辉集团 MTN002	2,000	199,984.99
中国银行股份有限公司	102380023	23 南安市贸 MTN001	21,660	2,194,410.12
中国银行股份有限公司	102380100	23 华能 MTN001(能源 保供特别债)	8,730	873,094.00
中国银行股份有限公司	102380118	23 华电股 MTN001(能源 保供特别债)	9,400	940,097.09
中国银行股份有限公司	102380225	23 华能 MTN003(能源 保供特别债)	56,800	5,695,429.76
中国银行股份有限公司	102380277	23 华能 MTN004(能源 保供特别债)	15,610	1,602,870.70
中国银行股份有限公司	102380372	23 中交三航 MTN001	39,000	3,901,182.79
中国银行股份有限公司	102380454	23 华能 MTN007(能源 保供特别债)	31,220	3,199,107.16
中国银行股份有限公司	102380488	23 中冶 MTN006	33,400	3,416,636.30

中国银行股份有限公司	102380596	23 华电股 MTN003(能源 保供特别债)	16,700	1,703,670.54
中国银行股份有限公司	102380652	23 珠海华发 MTN001	78,000	7,800,831.15
中国银行股份有限公司	102380686	23 宁夏国资 MTN001	9,940	994,100.22
中国银行股份有限公司	102380843	23 水电八局 MTN001	44,360	4,458,321.95
中国银行股份有限公司	102381069	23 厦国贸控 MTN001(科创 票据)	110,900	11,211,823.65
中国银行股份有限公司	102381090	23 水电八局 MTN002	29,640	2,964,000.00
中国银行股份有限公司	102381118	23 西安高新 MTN002	11,448	1,145,614.50
中国银行股份有限公司	102381150	23 碧桂园 MTN002	1,421	142,115.34
中国银行股份有限公司	102381152	23 碧桂园 MTN001	1,421	142,114.75
中国银行股份有限公司	102381189	23 厦港务 MTN001	21,090	2,109,579.11
中国银行股份有限公司	102381217	23 湘建工 MTN001(科创 票据)	72,203	7,232,547.63
中国银行股份有限公司	102381341	23 首农食品 MTN002	36,880	3,688,964.32
中国银行股份有限公司	102381581	23 中核汇能 MTN001A(碳 中和债)	24,750	2,475,208.95
中国银行股份有限公司	102381619	23 水利十四 MTN002	16,680	1,675,047.72
中国银行股份有限公司	102381619	23 水利十四 MTN002	24,750	2,475,659.32
中国银行股份有限公司	102381997	23 中煤集团 MTN002	5,840	584,044.20
中国银行股份有限公司	102382436	23 大唐集 MTN014	12,440	1,244,112.84
中国银行股份有限公司	102382520	23 河钢集 MTN013	37,320	3,732,411.95
中国银行股份有限公司	102382772	23 陕有色 MTN002	12,132	1,213,549.02
中国银行股份有限公司	102382810	23 大唐山西 MTN002	18,394	1,839,568.85

中国银行股份有限公司	102382904	23 北控集 MTN001	6,159	616,060.15
中国银行股份有限公司	102383109	23 中电路桥 MTN001	5,739	573,906.96
中国银行股份有限公司	102383228	23 福建港口 MTN003	11,701	1,170,448.60
中国银行股份有限公司	102383376	23 本钢集团 MTN002(科创 票据)	19,996	1,999,807.32
中国银行股份有限公司	132100133	21 福瑞能源 GN004(碳中和 债)	19,800	2,054,037.33
中国银行股份有限公司	132380060	23 三峡 GN001	16,700	1,670,131.93
中国银行股份有限公司	132380065	23 华能水电 GN015	14,500	1,450,134.85
中国银行股份有限公司	132380067	23 晋能电力 GN011(碳中和 债)	5,560	553,770.75
中国银行股份有限公司	1920076	19 徽商银行永 续债	9,400	958,550.31
中国银行股份有限公司	1920076	19 徽商银行永 续债	9,400	959,061.67
中国银行股份有限公司	1920091	19 南京银行二 级	16,080	1,640,672.95
中国银行股份有限公司	1923001	19 中国人寿	64,320	6,783,373.73
中国银行股份有限公司	1928002	19 民生银行二 级 01	8,160	840,590.54
中国银行股份有限公司	1928002	19 民生银行二 级 01	8,160	840,723.09
中国银行股份有限公司	1928022	19 兴业银行二 级 01	42,911	4,371,522.20
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	50,100	5,310,083.97
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	11,723	1,237,020.58
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	11,737	1,238,990.95
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永 续债	13,385	1,356,984.25
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永 续债	83,500	8,750,741.55

中国银行股份有限公司	198234	23 四川债 34	67,270	6,729,381.36
中国银行股份有限公司	2020082	20 华润银行永续债	76,100	7,781,597.89
中国银行股份有限公司	2023001	20 人民财险	15,610	1,596,615.78
中国银行股份有限公司	2023001	20 人民财险	21,160	2,125,581.25
中国银行股份有限公司	2023002	20 中邮人寿	14,060	1,433,193.99
中国银行股份有限公司	2023002	20 中邮人寿	16,080	1,679,966.04
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	29,000	2,970,296.00
中国银行股份有限公司	2023021	20 中邮人寿 02	50,100	5,305,945.71
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	100,000	10,317,830.00
中国银行股份有限公司	2028024	20 中信银行二级	52,640	5,376,349.55
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	100,000	10,307,380.00
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	111,960	12,054,449.64
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	12,440	1,338,870.93
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	16,080	1,686,328.90
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	18,909	2,022,236.68
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	19,430	2,086,631.88
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	32,160	3,355,291.39
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	32,160	3,372,657.79
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	97,150	10,450,525.98
中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永续债	10,253	1,045,366.71
中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永续债	24,648	2,483,162.15
中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永续债	33,556	3,421,174.70

中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永续债	50,040	5,037,596.68
中国银行股份有限公司	2120064	21 恒丰银行永续债	25,020	2,497,191.20
中国银行股份有限公司	2120115	21 厦门国际银行永续债 01	22,180	2,207,664.12
中国银行股份有限公司	2120118	21 广州银行永续债	14,060	1,436,317.75
中国银行股份有限公司	2120118	21 广州银行永续债	37,050	3,668,220.46
中国银行股份有限公司	2120118	21 广州银行永续债	51,570	5,300,039.50
中国银行股份有限公司	2121026	21 杭州联合农商永续债 01	97,450	10,039,821.49
中国银行股份有限公司	2123006	21 交银康联人寿 01	14,060	1,454,858.11
中国银行股份有限公司	2126003	21 华侨永亨中国 01	12,450	1,262,263.48
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永续债 01	34,380	3,605,570.03
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永续债 01	46,230	4,853,662.24
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	34,380	3,444,820.80
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	51,570	5,170,430.74
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	6,752	686,018.98
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	85,950	8,609,896.31
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永续债	105,280	10,976,587.55
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永续债	16,080	1,695,764.64
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永续债	16,560	1,737,877.61
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永续债	8,497	894,169.18
中国银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永续债	62,200	6,453,118.70
中国银行股份有限公司	2128025	21 建设银行二级 01	52,640	5,346,707.97
中国银行股份有限公司	2128025	21 建设银行二级 01	52,640	5,346,707.97

中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	100,000	9,992,360.00
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	16,080	1,611,937.99
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	16,080	1,611,937.99
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	32,945	3,397,176.39
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	33,987	3,458,828.62
中国银行股份有限公司	2220007	22 厦门国际银行永续债 01	110,900	10,840,652.44
中国银行股份有限公司	2220007	22 厦门国际银行永续债 01	44,360	4,335,883.92
中国银行股份有限公司	2226006	22 汇丰银行 02	20,750	2,131,825.67
中国银行股份有限公司	2228001	22 邮储银行永续债 01	16,080	1,593,613.22
中国银行股份有限公司	2228001	22 邮储银行永续债 01	65,890	6,723,132.27
中国银行股份有限公司	2228038	22 民生银行永续债 01	73,050	7,010,915.31
中国银行股份有限公司	2305401	23 浙江债 28	33,635	3,363,500.00
中国银行股份有限公司	2305424	23 河北债 24	67,270	6,731,204.38
中国银行股份有限公司	2305554	23 安徽债 62	65,890	6,585,988.83
中国银行股份有限公司	2320005	23 厦门国际银行三农债 01	9,940	994,082.83
中国银行股份有限公司	2320031	23 华润银行小微债 01	18,280	1,828,135.22
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	101,500	10,150,933.80
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	38,920	3,892,358.36
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	73,850	7,385,000.00
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	78,120	7,812,719.30
中国银行股份有限公司	272380014	23 东方二级资本债 01BC	97,650	9,766,067.21
中国银行股份有限公司	282380001	23 泰康人寿永续债 01	13,504	1,370,032.66

中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	11,868	1,186,910.49
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	22,371	2,237,059.80
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	9,159	916,015.23
中国银行股份有限公司	282380005	23 太平人寿永续债 01	6,752	678,433.30
中国银行股份有限公司	282380005	23 太平人寿永续债 01	6,752	678,398.43
中国银行股份有限公司	282380005	23 太平人寿永续债 01	6,752	678,280.04
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	52,640	5,245,354.91
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	52,640	5,243,159.82
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	65,890	6,705,427.63
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	52,640	5,356,556.91
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	8,300	883,590.39
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	8,300	883,433.00

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	14,500	1,492,738.75
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	29,000	2,986,301.10
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	29,000	2,981,469.70
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	33,120	3,412,469.52
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	50,100	5,157,389.19
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	50,750	5,218,079.47
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	21,090	2,148,080.15
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	72,500	7,448,874.75

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	9,700	979,369.68
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	21,090	2,129,399.14
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	252,590	25,859,723.35
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	3,700	383,569.40
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	58,290	5,947,300.35
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	77,720	7,926,684.31
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	9,700	1,004,071.44
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	97,150	9,938,985.05

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	97,150	9,917,798.90
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	58,290	6,271,535.84
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	66,800	7,205,335.24
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	97,150	10,479,502.36
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	14,060	1,485,143.08
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	64,320	6,642,879.55
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	12,440	1,290,160.20
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	14,500	1,497,552.75

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	23,580	2,411,059.72
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	28,500	2,912,583.15
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	29,000	2,993,832.40
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	51,570	5,303,411.70
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	21,160	2,137,071.13
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2128038	21 农业银行永续债 01	16,080	1,622,425.37
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	58,000	6,050,409.20
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	65,890	6,813,032.59

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	120,330	12,283,917.23
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	65,890	6,710,323.26
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	98,835	10,096,944.07
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	64,600	6,485,982.12
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	21,060	2,107,081.77
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	37,050	3,705,000.00
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	59,280	5,953,431.12
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	167,000	16,701,469.60

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	194,300	19,433,408.21
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	221,800	22,180,000.00
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	55,600	5,561,950.56
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	5,850	612,650.93
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	11,328	1,146,129.91
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	16,974	1,737,716.09
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	33,949	3,475,432.18
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	13,688	1,394,893.88

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	30,502	3,155,740.21
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	30,502	3,151,906.05
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	36,103	3,686,501.54
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	76,256	7,887,794.89
中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限 公司	232380078	23 交行二级资 本债 01A	13,610	1,371,993.86
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	17,552	1,755,698.80
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	22,005	2,201,110.14
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	22,683	2,268,262.40
中银国际亚 洲有限公司	00020	港股通	156,792	453,408.96
中银国际亚 洲有限公司	00390	港股通	31,000	167,221.36

中银国际亚洲有限公司	00836	港股通	15,030	226,218.45
中银国际亚洲有限公司	00836	港股通	20,667	317,564.32
中银国际亚洲有限公司	00836	港股通	7,218	112,143.72
中银国际亚洲有限公司	00857	港股通	10	90,874.32
中银国际亚洲有限公司	00857	港股通	7,180	33,972.54
中银国际亚洲有限公司	01658	港股通	38,095	175,571.28
中银国际亚洲有限公司	01658	港股通	41,303	196,592.73
中银国际亚洲有限公司	01658	港股通	82,004	400,055.46
中银国际亚洲有限公司	06606	港股通	12,050	286,556.20
中银国际亚洲有限公司	09926	港股通	19,169	821,874.18
中银国际证券股份有限公司	002773	康弘药业	2,298	35,391.66
中银国际证券股份有限公司	002773	康弘药业	4,147	67,682.81
中银国际证券股份有限公司	002773	康弘药业	6,095	96,668.60
中银国际证券股份有限公司	002773	康弘药业	8,493	135,891.20
中银国际证券股份有限公司	002773	康弘药业	9,093	142,190.66
中银国际证券股份有限公司	003816	中国广核	5,673	16,224.44
中银国际证券股份有限公司	003816	中国广核	630	1,853.14
中银国际证券股份有限公司	110053	苏银转债	2,090	256,685.44

中银国际证 券股份有限 公司	110053	苏银转债	283	34,612.65
中银国际证 券股份有限 公司	110053	苏银转债	4,535	568,594.83
中银国际证 券股份有限 公司	115072	23 联发 01	31,220	3,187,985.39
中银国际证 券股份有限 公司	137974	22 交 YK01	13,385	1,323,785.12
中银国际证 券股份有限 公司	137974	22 交 YK01	26,770	2,647,802.73
中银国际证 券股份有限 公司	138677	22CHNG3Y	74,940	7,692,524.27
中银国际证 券股份有限 公司	185991	22 新汶 Y1	18,490	1,861,073.97
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	76,100	7,656,192.70
中银国际证 券股份有限 公司	188410	21 外高 01	12,111	1,213,940.94
中银国际证 券股份有限 公司	1928001	19 中国银行永 续债 01	1,880	198,696.61
中银国际证 券股份有限 公司	1928001	19 中国银行永 续债 01	9,400	993,530.03
中银国际证 券股份有限 公司	1928004	19 农业银行二 级 02	11,328	1,139,118.75
中银国际证 券股份有限 公司	1928009	19 农业银行二 级 04	11,328	1,140,399.99

中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	11,328	1,141,621.20
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	11,328	1,146,493.56
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	16,974	1,733,464.25
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	27,736	2,831,659.24
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	11,737	1,195,834.03
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	53,540	5,500,865.06
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	100,000	10,250,600.00
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	27,736	2,819,512.57
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	29,518	3,004,344.13
中银国际证 券股份有限 公司	2028013	20 农业银行二 级 01	21,160	2,120,196.03
中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二 级	4,080	410,138.26
中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二 级	43,821	4,404,418.88
中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二 级	8,160	820,860.99
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	32,160	3,344,665.73

中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	35,150	3,705,590.38
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	38,860	3,973,923.46
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	26,770	2,781,881.67
中银国际证 券股份有限 公司	2120110	21 北京银行永 续债 02	16,080	1,620,508.63
中银国际证 券股份有限 公司	2228014	22 交通银行二 级 01	30,502	3,132,360.06
中银国际证 券股份有限 公司	282380004	23 农银人寿永 续债	29,053	2,910,672.40
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	100,200	10,199,358.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	100,200	10,199,358.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	100,200	10,199,358.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	100,200	10,199,358.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	100,200	10,199,358.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	90,700	9,289,494.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	90,700	9,289,494.00
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	12,626	265,764.70

中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	14,025	294,800.02
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	12,690	92,382.04
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	13,158	96,316.05
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	16,496	125,202.51
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	19,434	138,840.84
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	22,382	161,310.35
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	310,157	2,205,216.77
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	394	2,773.41
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	5,745	40,390.16
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	54,102	406,421.35
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	59,045	463,973.60
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	6,045	43,585.60
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	1,354	136,595.61
中银国际证 券股份有限 公司	600941	中国移动	6,339	588,148.55

中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	158	2,637.89
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	18,786	340,285.79
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	2,024	34,731.84
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	4,255	73,648.16
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	44,742	812,972.65
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	6,506	119,501.63
中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	12,110	194,707.79
中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	12,713	257,666.84
中银国际证 券股份有限 公司	601225	陕西煤业	14,121	286,372.26
中银国际证 券股份有限 公司	601298	青岛港	8,273	48,479.49
中银国际证 券股份有限 公司	601390	中国中铁	12,848	72,335.70
中银国际证 券股份有限 公司	601390	中国中铁	17,744	100,078.42
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	1,084	5,953.25
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	18,043	111,324.75

中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	23,429	127,923.32
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	30,857	198,739.61
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	69,328	445,075.98
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	72,758	406,430.83
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	73,649	433,308.11
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	867	5,451.48
中银国际证 券股份有限 公司	601669	中国电建	13,853	102,648.36
中银国际证 券股份有限 公司	601669	中国电建	14,370	108,924.60
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	104,053	702,384.50
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	25,165	146,207.20
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	308,463	1,999,823.60
中银国际证 券股份有限 公司	601728	中国电信	75,884	447,097.85
中银国际证 券股份有限 公司	601800	中国交建	6,303	67,885.46
中银国际证 券股份有限 公司	601808	中海油服	13,638	203,098.10

中银国际证 券股份有限 公司	601949	中国出版	14,851	76,927.40
中银国际证 券股份有限 公司	601949	中国出版	264	1,411.10
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	1,059	12,281.58
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	2,072	22,350.21
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	37,537	376,545.33
中银国际证 券股份有限 公司	601958	金钼股份	4,611	45,606.31
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	1,421	10,498.34
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	1,435	11,064.64
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	1,463	10,634.91
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	1,500	10,231.20
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	17,013	161,704.55
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	20,810	202,490.49
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	322	2,415.00
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	6,501	67,230.49

中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	7,214	51,948.34
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	70,391	655,455.61
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	728	5,475.36
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	728	5,546.88
中银国际证 券股份有限 公司	603128	华贸物流	805	5,979.96
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	3,216	22,036.83
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	45,215	223,816.03
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	62,368	287,517.77
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	652	3,866.36
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	8,686	53,143.67
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	8,996	44,517.97

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	107,388,316	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	120,100,448	110,000,000.00
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	159,540,523	150,000,000.00
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	329,344,604	300,000,000.00
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	333,037,300	300,000,000.00
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	45,376,626	45,000,000.00
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	49,474,335	40,000,000.00
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	60,422,961	60,000,000.00
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	672,043,011	600,000,000.00
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	79,106,101	80,000,000.00
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	80,217,204	65,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYGJZGH HZ5820220 815	中银证券中国 红-汇中 58 号 集合资产管理 计划	197,180,321	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCHZT D20211025	中银证券中国 红-汇中 27 号 集合资产管理 计划	5,749,770	5,000,000.00
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	45,947,436	50,000,000.00
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	115,584,666	120,000,000.00
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	14,282,994	15,000,000.00
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	96,525,097	100,000,000.00
中银基金管 理有限公司	005689	中银医疗保健 混合 A	1,302,898	2,989,500.00
中银基金管 理有限公司	005689	中银医疗保健 混合 A	184,078	446,500.00
中银基金管 理有限公司	005689	中银医疗保健 混合 A	759,720	1,793,700.00
中银基金管 理有限公司	005689	中银医疗保健 混合 A	78,309	170,000.00
中银基金管 理有限公司	005689	中银医疗保健 混合 A	800,563	1,934,000.00
中银基金管 理有限公司	163807	中银行业优选	1,613,011	1,934,000.00
中银基金管 理有限公司	163807	中银行业优选	375,557	446,500.00
中银基金管 理有限公司	163807	中银优选混合 A	649,587	707,400.00
中银基金管 理有限公司	163820	中银货币 B	4,000	4,000.00
中银基金管 理有限公司	163820	中银货币 B	4,000	4,000.00

中银基金管理有限公司	163820	中银货币 B	4,000	4,000.00
中银基金管理有限公司	163822	中银主题策略混合 A	697,992	2,989,500.00
中银基金管理有限公司	163822	中银主题策略混合 A	703,743	2,989,500.00
中银基金管理有限公司	ZYJXIH 120221128	中银基金-羲和 1 号集合资产管理计划	49,280,505	50,000,000.00
中银基金管理有限公司	ZYJXIH 120221128	中银基金-羲和 1 号集合资产管理计划	59,189,109	60,000,000.00
中银基金管理有限公司	ZYJXIH 120221128	中银基金-羲和 1 号集合资产管理计划	97,991,181	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	19,081,661.96
产品托管费	中国银行股份有限公司	848,073.86
14 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	21,399,000.00
16 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	3,106,958.06
1 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	8,146,447.50
1 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	5,587,000.00
28 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	12,615,000.00
3 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	3,205,000.00
4 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	24,554,491.57
7 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	59,074,342.03
7 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	20,000.00
现券买入	中银资产管理有限公司	261,214,814.35
现券买入	中国银行股份有限公司	34,187,340.48

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-智富（2年滚续）

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-智富（2年滚续）”（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。

1、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。

2、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

上海分行托管中心

二〇二四年二月

(2)

