

# 中银理财-（18 个月）最短持有期固收增强理财产品 2 号 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	CYQZQ18M2
理财产品名称	中银理财-（18个月）最短持有期固收增强理财产品2号
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000579
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	2022-12-08
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
CYQZQ18M2A	6,289,932,405.32	1.040468	1.040468	6,544,476,614.57	3.85%
CYQZQ18M2B	12,224,983,586.44	1.041557	1.041557	12,733,025,451.66	3.95%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：109.38%

### 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	22,446.76	1.14%	130,024.30	6.26%
同业存单	-	0.00%	39,344.94	1.90%
拆放同业及买入返售	-	0.00%	6,374.93	0.31%
债券	175,106.28	8.92%	1,708,380.55	82.30%
非标准化债权类资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	84,903.81	4.09%
境外投资资产	-	0.00%	63,720.56	3.07%
商品类资产	-	0.00%	-	0.00%
另类资产	-	0.00%	-	0.00%
公募基金	-	0.00%	43,168.93	2.08%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	1,766,596.94	89.94%	-	0.00%
合计	1,964,149.98	100%	2,075,918.02	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	96,512.12	4.65%
2	092280003：22 中国信达债 01	43,165.52	2.08%
3	019703：23 国债 10	43,003.35	2.07%
4	019670：22 国债 05	30,023.46	1.45%
5	1928002：19 民生银行二级 01	24,275.83	1.17%
6	019694：23 国债 01	20,002.42	0.96%
7	112305095：23 建设银行 CD095	17,812.94	0.86%
8	1928013：19 民生银行永续债	16,767.11	0.81%
9	2120107：21 浙商银行永续债	16,588.72	0.80%
10	2028022：20 民生银行二级	15,923.30	0.77%

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（18个月最短持有期固收增强2号）
账号	748476446067
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，控制资产久期、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

报告期内，债券市场收益率整体先上后下，市场波动加大。在资产配置上，一方面，抓住市场调整机会，配置性价比较高资产，以期获得后续收益率下行带来的资本利得收益；另一方面，在短端利率较低时，处置部分短久期资产，实现资本利得并降低组合杠杆水平，以应对潜在市场调整。同时，积极拓展低波动资产，并根据市场变化进行配置。在市场预期高开低走、海外流动性趋紧等多重因素叠加下，权益市场震荡下行，产品管理人在前期保持低仓位运行严防回撤，于市场下行阶段结合大类资产性价比及风险预算，将权益仓位分批提高，以提高净值稳定性和捕捉大类资产轮动收益。

### （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	XS2731858 366	BCHINA 4.18 12/06/25	32,107,500	32,255,515.58
中国银行股份有限公司	XS2739604 655	BCHIN 4.18 12/21/2026	3,334,251	33,613,920.30

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	012283152	22 招商局港 SCP005	2,400	242,883.38
中国银行股份有限公司	012380527	23 闽冶金 SCP002	1,800	180,952.18
中国银行股份有限公司	012380883	23 三峡新能 SCP001	592,200	59,680,108.33
中国银行股份有限公司	012381072	23 津城建 SCP013	207	20,700.00
中国银行股份有限公司	012381525	23 东方国际 SCP001	3,600	360,391.63
中国银行股份有限公司	012381961	23 吴中国太 SCP003	600	60,000.00
中国银行股份有限公司	012381971	23 津城建 SCP032	20,800	2,080,000.00
中国银行股份有限公司	012381971	23 津城建 SCP032	600	60,000.00
中国银行股份有限公司	012382133	23 江苏核电 SCP001(科创 票据)	1,800	180,000.00
中国银行股份有限公司	012382241	23 津城建 SCP037	20,650	2,065,000.00
中国银行股份有限公司	012383142	23 温州交运 SCP002	15,200	1,516,948.99
中国银行股份有限公司	012383899	23 南通高新 SCP010	106,307	10,631,559.10
中国银行股份有限公司	012383899	23 南通高新 SCP010	37,719	3,772,153.51
中国银行股份有限公司	032100573	21 戴姆勒财 PPN004BC	3,450	357,484.23
中国银行股份有限公司	032100573	21 戴姆勒财 PPN004BC	6,900	715,180.49

中国银行股份有限公司	032280151	22 昆交投 PPN001	57,882	5,941,622.42
中国银行股份有限公司	032280151	22 昆交投 PPN001	57,882	5,941,622.42
中国银行股份有限公司	032380359	23 吴中经发 PPN002	2,010	201,020.26
中国银行股份有限公司	032380567	23 平潭城发 PPN001	600	60,000.00
中国银行股份有限公司	042380292	23 广西金控 CP001	31,200	3,120,460.33
中国银行股份有限公司	042380292	23 广西金控 CP001	59,385	5,939,376.17
中国银行股份有限公司	082380667	23 华能罗源 ABN001 优先	240,871	24,089,434.03
中国银行股份有限公司	082380675	23 华能安源 ABN001 优先	479,749	47,979,515.79
中国银行股份有限公司	082380909	23 京东东裕 2ABN001 优先 A	23,299	2,329,867.80
中国银行股份有限公司	092280003	22 中国信达债 01	4,800	485,592.64
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	6,130	630,749.07
中国银行股份有限公司	102100194	21 中航租赁 MTN001	14,000	1,445,050.60
中国银行股份有限公司	102100408	21 豫交运 MTN001	7,000	718,952.87
中国银行股份有限公司	102100952	21 中建投租 MTN001	2,360	240,849.23
中国银行股份有限公司	102101617	21 陕延油 MTN003	4,012	419,153.93
中国银行股份有限公司	102101876	21 环球租赁 MTN002	2,360	243,319.23
中国银行股份有限公司	102101898	21 京住总集 MTN003A	5,900	608,959.65
中国银行股份有限公司	102101908	21 云能投 MTN003	10,670	1,101,086.09
中国银行股份有限公司	102101908	21 云能投 MTN003	335	35,003.45
中国银行股份有限公司	102101908	21 云能投 MTN003	42,680	4,404,344.36
中国银行股份有限公司	102102007	21 晋能装备 MTN005	5,900	617,549.82

中国银行股份有限公司	102280945	22 温州交运 MTN001	7,580	768,741.56
中国银行股份有限公司	102281062	22 西安高新 MTN002	28,941	3,074,339.06
中国银行股份有限公司	102281464	22 山西建投 MTN003(科创 票据)	21,340	2,172,471.63
中国银行股份有限公司	102281690	22 鲁钢铁 MTN003	17,072	1,710,259.40
中国银行股份有限公司	102281690	22 鲁钢铁 MTN003	18,139	1,817,150.61
中国银行股份有限公司	102282276	22 高速路桥 MTN001	37,100	3,818,597.44
中国银行股份有限公司	102282317	22 水电八局 MTN003	15,160	1,555,317.46
中国银行股份有限公司	102300375	23 粤珠江 MTN001	600	60,006.15
中国银行股份有限公司	102300441	23 华能 MTN013	247,620	24,763,860.53
中国银行股份有限公司	102300571	23 金辉集团 MTN002	9,917	991,801.41
中国银行股份有限公司	102380306	23 甘肃农垦 MTN001(乡村 振兴)	1,380	138,050.90
中国银行股份有限公司	102380345	23 联发集 MTN002	690	69,009.39
中国银行股份有限公司	102380398	23 中船租 MTN001BC( 可持续挂钩)	5,520	552,049.77
中国银行股份有限公司	102380416	23 中原高速 MTN001	50,200	5,020,000.00
中国银行股份有限公司	102380416	23 中原高速 MTN001	690	69,000.00
中国银行股份有限公司	102380455	23 成都环境 MTN002	690	69,000.00
中国银行股份有限公司	102380568	23 云能投 MTN001	3,450	345,000.00
中国银行股份有限公司	102380652	23 珠海华发 MTN001	690	69,000.00
中国银行股份有限公司	102380686	23 宁夏国资 MTN001	10,040	1,004,101.22
中国银行股份有限公司	102380686	23 宁夏国资 MTN001	690	69,006.96

中国银行股份有限公司	102380738	23 临沂城投 MTN001	414	41,404.69
中国银行股份有限公司	102380843	23 水电八局 MTN001	4,690	469,050.87
中国银行股份有限公司	102381054	23 郑州公用 MTN001	26,880	2,688,227.67
中国银行股份有限公司	102381090	23 水电八局 MTN002	30,320	3,103,828.23
中国银行股份有限公司	102381150	23 碧桂园 MTN002	360	36,003.89
中国银行股份有限公司	102381152	23 碧桂园 MTN001	360	36,003.74
中国银行股份有限公司	102381236	23 华电 MTN004A(能源保供特别 债)	6,000	600,145.57
中国银行股份有限公司	102381241	23 新创建 MTN001BC	600	60,000.00
中国银行股份有限公司	102381242	23 中铁置业 MTN001	1,800	180,000.00
中国银行股份有限公司	102381255	23 桂铁投 MTN001	600	60,006.07
中国银行股份有限公司	102381265	23 福建港口 MTN002	3,000	300,028.28
中国银行股份有限公司	102381318	23 豫水利 MTN002	4,800	480,047.48
中国银行股份有限公司	102381341	23 首农食品 MTN002	1,200	120,031.38
中国银行股份有限公司	102381341	23 首农食品 MTN002	100,320	10,034,623.12
中国银行股份有限公司	102381363	23 中化股 MTN001	3,600	360,028.72
中国银行股份有限公司	102381458	23 龙岩汇金 MTN001	600	60,000.00
中国银行股份有限公司	102381466	23 北部湾 MTN002	600	60,000.00
中国银行股份有限公司	102381892	23 武汉城建 MTN001	41,270	4,127,341.66
中国银行股份有限公司	102381955	23 中广核租 MTN003(绿色)	37,100	3,710,000.00
中国银行股份有限公司	102381956	23 越秀交通 MTN001	18,900	1,890,000.00

中国银行股份有限公司	102382056	23 厦国贸控 MTN003	18,900	1,890,000.00
中国银行股份有限公司	102382060	23 吉利汽车 MTN001	75,600	7,560,000.00
中国银行股份有限公司	102382060	23 吉利汽车 MTN001	94,880	9,488,000.00
中国银行股份有限公司	102382080	23 陕有色 MTN001	132,300	13,230,000.00
中国银行股份有限公司	102382130	23 南安市贸 MTN002	15,160	1,516,438.65
中国银行股份有限公司	102382259	23 晋能煤业 MTN004	165,080	16,509,578.64
中国银行股份有限公司	102382259	23 晋能煤业 MTN004	37,100	3,710,000.00
中国银行股份有限公司	102382270	23 贵州高速 MTN002	82,540	8,254,676.56
中国银行股份有限公司	102382322	23 京能国际 MTN001	150,800	15,081,516.24
中国银行股份有限公司	102382323	23 龙湖拓展 MTN001	56,700	5,670,000.00
中国银行股份有限公司	102382347	23 郑州公用 MTN002	41,450	4,145,345.42
中国银行股份有限公司	102382355	23 美的置业 MTN004A	59,220	5,922,000.00
中国银行股份有限公司	102382439	23 云能投 MTN002	197,400	19,740,000.00
中国银行股份有限公司	102382439	23 云能投 MTN002	289,408	30,027,383.08
中国银行股份有限公司	102382528	23 中交天航 MTN001(科创 票据)	37,700	3,770,390.39
中国银行股份有限公司	102382528	23 中交天航 MTN001(科创 票据)	41,450	4,145,429.22
中国银行股份有限公司	102382568	23 闽冶金 MTN003	82,900	8,292,242.38
中国银行股份有限公司	102382589	23 象屿股份 MTN002	37,700	3,770,448.07
中国银行股份有限公司	102382594	23 华侨城 MTN005	34,640	3,464,000.00
中国银行股份有限公司	102382594	23 华侨城 MTN005	98,700	9,871,070.60

中国银行股份有限公司	102382652	23 本钢集团 MTN001(科创 票据)	102,398	10,250,609.92
中国银行股份有限公司	102382652	23 本钢集团 MTN001(科创 票据)	59,220	5,922,000.00
中国银行股份有限公司	102382811	23 京能国际 MTN002	69,219	6,921,939.20
中国银行股份有限公司	102382856	23 北电 MTN001	173,048	17,304,848.00
中国银行股份有限公司	102382920	23 武商贸集 MTN002	37,578	3,758,140.11
中国银行股份有限公司	102382923	23 天津港 MTN001(科创 票据)	15,031	1,503,272.06
中国银行股份有限公司	102382923	23 天津港 MTN001(科创 票据)	6,954	695,374.11
中国银行股份有限公司	102382953	23 北部湾投 MTN004	39,114	3,911,836.74
中国银行股份有限公司	102383017	23 新创建 MTN002BC	23,080	2,308,036.40
中国银行股份有限公司	102383017	23 新创建 MTN002BC	84,454	8,446,335.52
中国银行股份有限公司	102383134	23 中交天航 MTN003(科创 票据)	22,162	2,226,813.74
中国银行股份有限公司	102383172	23 中铁置业 MTN002	93,398	9,339,844.00
中国银行股份有限公司	102383366	23 龙湖企业 MTN002	4,844	484,455.21
中国银行股份有限公司	102383376	23 本钢集团 MTN002(科创 票据)	30,832	3,083,211.00
中国银行股份有限公司	102383427	23 先正达 MTN002	247,921	24,798,577.89
中国银行股份有限公司	132100102	21 天成租赁 GN002(碳中和 债)	1,180	122,832.81
中国银行股份有限公司	1923001	19 中国人寿	122,400	12,508,635.83
中国银行股份有限公司	1928002	19 民生银行二 级 01	1,400	144,309.11

中国银行股份有限公司	1928026	19 兴业银行二级 02	81,270	8,586,596.88
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	150,800	15,745,924.74
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	7,580	817,492.87
中国银行股份有限公司	2122021	21 交银租赁债 02	7,000	713,801.45
中国银行股份有限公司	2122022	21 华夏租赁债 02	7,000	712,741.30
中国银行股份有限公司	2122024	21 太平石化租赁债 01	5,600	569,993.68
中国银行股份有限公司	212300002	23 江苏银行债 01	600	60,000.00
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	5,520	546,605.57
中国银行股份有限公司	222380010	23 青岛银行绿色债 01	45,508	4,551,152.42
中国银行股份有限公司	2320022	23 杭州银行 01	600	60,000.00
中国银行股份有限公司	2320041	23 南京银行 01	82,540	8,254,000.00
中国银行股份有限公司	2320044	23 湖南银行 01	41,270	4,127,000.00
中国银行股份有限公司	2320053	23 厦门银行绿色债 01	39,114	3,912,377.90
中国银行股份有限公司	2322010	23 福特汽车债 02	37,800	3,780,000.00
中国银行股份有限公司	2322016	23 农银金租绿色债	43,693	4,369,667.17
中国银行股份有限公司	2322017	23 招银金租债 01	24,091	2,409,134.00
中国银行股份有限公司	2322019	23 招银金租债 02	45,943	4,594,656.43
中国银行股份有限公司	232380063	23 创兴银行二级资本债 01BC	82,900	8,290,000.00
中国银行股份有限公司	2326015	23 渣打银行 01	41,450	4,145,338.62
中国银行股份有限公司	2389373	23 汇聚融 1A1_BC	2,515	251,457.32
中国银行股份有限公司	2389373	23 汇聚融 1A1_BC	4,636	463,677.62

中国银行股份有限公司	2389373	23 汇聚融 1A1_BC	668	66,767.50
中国银行股份有限公司	2389373	23 汇聚融 1A1_BC	7,087	708,860.47
中国银行股份有限公司	2389387	23 吉时代4 优 先_BC	13,066	1,306,646.60
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	414,500	41,453,816.57
中国银行股份有限公司	272380014	23 东方二级资 本债 01BC	207,250	20,727,265.03
中国银行股份有限公司	292380007	23 加拿大银行 债 01BC	37,578	3,758,118.43
中国银行股份有限公司	UL457960	23 新创建 MTN001BC	39,590	3,959,000.00
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	12,260	1,245,101.30
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	96,420	9,623,462.40
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	75,400	7,692,565.39
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	188,500	19,430,002.45
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	188,500	19,430,002.45
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	15,160	1,546,172.59

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	188,500	19,254,599.24
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	22,740	2,320,151.14
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	22,800	2,327,612.62
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	7,580	773,159.07
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	188,500	19,443,517.30
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	37,700	3,888,703.46
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	37,900	4,088,246.42
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	18,390	1,922,279.37

中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	2228004	22 工商银行二级 01	12,260	1,256,501.69
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	4,140	414,000.00
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	123,810	12,382,133.23
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	213,480	21,348,000.00
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	453,970	45,397,000.00
中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司	262380002	23 交银金租绿债 01	43,693	4,369,667.17
中银国际亚洲有限公司	06030	港股通	7,986	103,259.92
中银国际证券股份有限公司	092200008	22 农行二级资本债 02A	24,520	2,505,664.47
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	113021	中信转债	19,720	2,186,553.02
中银国际证券股份有限公司	113021	中信转债	32,100	3,721,439.25

中银国际证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	34,050	3,548,710.37
中银国际证 券股份有限 公司	115444	23 华租 Y1	15,160	1,531,519.69
中银国际证 券股份有限 公司	115629	23 津投 13	336	35,422.91
中银国际证 券股份有限 公司	115629	23 津投 13	4,096	409,600.00
中银国际证 券股份有限 公司	115798	23 津投 17	5,433	563,475.00
中银国际证 券股份有限 公司	185137	21 大唐 Y1	11,030	1,126,584.56
中银国际证 券股份有限 公司	185991	22 新汶 Y1	600,000	61,032,156.16
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	113,100	11,514,554.05
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	64,280	6,689,733.98
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	15,160	1,554,538.84
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	15,160	1,551,065.95
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	22,740	2,331,808.26
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	37,900	3,876,463.92
中银国际证 券股份有限 公司	232380004	23 农行二级资 本债 01A	73,050	7,410,253.39

中银国际证 券股份有限 公司	2389307	23 欣荣 2 优先	7,540	754,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	300760	迈瑞医疗	134	36,378.80
中银国际证 券股份有限 公司	300760	迈瑞医疗	276	74,227.26
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	47,900	4,875,741.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	47,900	4,875,741.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	47,900	4,875,741.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	47,900	4,875,741.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	47,900	4,875,741.00
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	86,600	8,869,572.00
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	12,939	317,957.07
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	12,939	317,957.07
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	13,181	317,967.37
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	26,190	635,931.63

中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	26,621	635,980.33
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	3,382	74,342.95
中银国际证 券股份有限 公司	601808	中海油服	4,441	65,552.92
中银国际证 券股份有限 公司	601808	中海油服	7,327	112,018.62
中银国际证 券股份有限 公司	601808	中海油服	7,438	111,439.09

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 HZ5820220 815	中银证券中国 红-汇中 58 号 集合资产管理 计划	19,621,309	20,000,000.00
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	20,565,553	20,000,000.00
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	52,279,381	50,000,000.00
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	53,630,806	50,000,000.00
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	9,786,651	10,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202120	中银证券中国 红-汇中 20 号 集合资产管理 计划	275,355,668	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202128	中银证券中国 红-汇中 28 号 集合资产管理 计划	186,480,186	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	120,997,766	130,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	121,020,294	130,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	140,252,454	150,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	140,436,289	150,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	142,112,743	150,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	183,840,427	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	183,975,715	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	186,202,402	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	186,741,363	200,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	187,125,748	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	187,564,475	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	188,022,939	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	188,146,754	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	188,412,624	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	189,447,760	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	19,065,777	20,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	19,346,102	20,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	232,536,508	250,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	232,558,140	250,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	234,719,745	250,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	236,563,210	250,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	237,304,224	250,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	277,238,703	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	277,649,236	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	279,850,746	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	28,568,708	30,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	280,478,684	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	281,004,121	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	281,109,445	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	281,267,579	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	281,954,887	300,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	282,912,109	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	283,072,278	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	283,446,712	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	303,720,577	320,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	328,361,009	350,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	373,657,170	400,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	374,181,478	400,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	377,038,364	400,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	378,000,378	400,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	38,048,131	40,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	38,066,235	40,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	38,310,507	40,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	422,455,877	450,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	469,571,751	500,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	47,696,270	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	47,874,378	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	472,098,952	500,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	48,026,126	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	657,153,586	700,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	746,059,871	800,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	75,807,827	80,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	75,951,771	80,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	76,709,176	80,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	77,294,686	80,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	77,361,957	80,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	92,954,081	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	93,075,205	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	93,729,497	100,000,000.00
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	229,231,616	250,000,000.00
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	278,344,776	300,000,000.00
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	279,407,656	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	145,546,284	150,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	194,118,218	200,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	194,760,931	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	96,721,153	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220323	中银证券中国 红-汇中 53 号 集合资产管理 计划	964,320,154	1,000,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ100Q DII2023062 9	中银证券-中 银理财 100 号 QDII 单一资 产管理计划	10,000,000	10,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ100Q DII2023062 9	中银证券-中 银理财 100 号 QDII 单一资 产管理计划	188,267,935	190,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ100Q DII2023062 9	中银证券-中 银理财 100 号 QDII 单一资 产管理计划	403,959,604	404,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ100Q DII2023062 9	中银证券-中 银理财 100 号 QDII 单一资 产管理计划	69,423,783	70,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ100Q DII2023062 9	中银证券-中 银理财 100 号 QDII 单一资 产管理计划	99,147,333	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQHZ2 02260	中银证券中国 红-汇中 60 号 集合资产管理 计划	3,972,984	4,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQHZ2 02268	中银证券中国 红-汇中 68 号 集合资产管理 计划	5,000,000	5,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQHZ2 02269	中银证券中国 红-汇中 69 号 集合资产管理 计划	5,000,000	5,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQHZ2 02270	中银证券中国 红-汇中 70 号 集合资产管理 计划	5,000,000	5,000,000.00
中银基金管 理有限公司	163807	中银优选混合 A	97,521	106,200.00
中银基金管 理有限公司	ZYJJCWQ D08	中银基金-财 稳 8 号 QDII 集合资产管理 计划	10,000,000	10,000,000.00
中银基金管 理有限公司	ZYJJCWQ D08	中银基金-财 稳 8 号 QDII 集合资产管理 计划	17,996,401	18,000,000.00
中银基金管 理有限公司	ZYJJZLJC0 120230314	中银基金-战 略基础 1 号集 合资产管理计 划	3,100,455	3,000,000.00
中银基金管 理有限公司	ZYJJZLJC0 120230314	中银基金-战 略基础 1 号集 合资产管理计 划	3,413,358	3,000,000.00

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	26,779,280.30
产品托管费	中国银行股份有限公司	2,300,252.76
14 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	24,653,700.00
20 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	6,300,000.00
21 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	7,425,000.00
7 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	56,117,700.00
现券买入	中银国际证券股份有限公司	880,029,125.39
现券买入	中国银行股份有限公司	608,684,666.45
现券买入	中银资产管理有限公司	128,249,266.86
现券买入	中国银行（香港）有限公司	9,996,290.30
现券卖出	中银国际证券股份有限公司	22,110,870.12

现券卖出	中银国际控股有限公司	2,565,315.35
现券卖出	中国银行股份有限公司	1,254,618.44

## 八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市，在当前基本面复苏动能仍有待加强的背景下，预计债券市场大幅调整的可能性不大。但当前资金面难言宽松，一定程度上制约了利率再度下行空间，且叠加当前信用利差和期限利差均较为拥挤，止盈盘可能为市场带来部分扰动。若后续资金面能进一步缓解，市场或将迎来较大机会。结合本产品特点，票息策略依然有效，精选优质票息资产，控制产品的杠杆与久期，做好风险对冲，加强与投资者沟通，提前做好各种情形下的流动性安排。

中银理财-（18个月）最短持有期固收增强理财产品 2号  
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-（18个月）最短持有期固收增强理财产品 2号（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

