

# 中银理财-（2年）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	CYQZQ2Y
理财产品名称	中银理财-（2年）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	Z7001021000533
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	2021-10-09
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
CYQZQ2YA	1,489,467,401.50	1.056761	1.056761	1,574,012,391.95	3.67%
CYQZQ2YB	1,202,503,944.80	1.059249	1.059249	1,273,752,189.18	3.78%
CYQZQ2YC	4,050,494.07	1.059024	1.059024	4,289,573.62	3.78%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：105.78%

### 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	21,553.08	7.81%	31,116.57	10.79%
同业存单	-	0.00%	4,274.23	1.48%
拆放同业及买入返售	-	0.00%	-	0.00%
债券	18,207.62	6.60%	225,854.13	78.33%
非标准化债权类资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	22,108.65	7.67%
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%	4,974.29	1.73%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	236,038.86	85.58%	-	0.00%
合计	275,799.56	100%	288,327.87	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	31,116.57	10.79%
2	155950: 19CHNG1Y	12,047.65	4.18%
3	2228031: 22 恒丰银行永续债	6,524.86	2.26%
4	2228004: 22 工商银行二级 01	5,060.50	1.76%
5	166204: 20 国君 Y1	5,059.86	1.75%
6	092280003: 22 中国信达债 01	4,084.70	1.42%
7	183115: PR 航租 2C	3,159.20	1.10%
8	360036: 工行优 2	2,615.27	0.91%

9	360034: 光大优 3	2,610.33	0.91%
10	360028: 招银优 1	2,603.22	0.90%

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 年最短持有期固收增强）
账号	767975223814
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）
中银国际证券股份有限公司	183008	工鑫 10A	127,635	13,124,119.58

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	86,000	8,666,817.49
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	2,600	260,000.00
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	012382234	23 闽能源 SCP002(碳资产)	150	15,002.78
中国银行股份有限公司	012382241	23 津城建 SCP037	2,580	258,000.00
中国银行股份有限公司	012383899	23 南通高新 SCP010	196	19,558.52
中国银行股份有限公司	012383899	23 南通高新 SCP010	24,105	2,410,733.61

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	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	14,490	1,449,213.79
中国银行股份有限公司	042380292	23 广西金控 CP001	3,900	390,057.54
中国银行股份有限公司	082280208	22 前海河钢 ABN001 优先	12,660	1,294,524.04
中国银行股份有限公司	082280280	22 鲁黄金 ABN001 优先	6,330	645,135.10
中国银行股份有限公司	082380336	23 同煤漳泽 ABN002 优先	250	25,016.06
中国银行股份有限公司	082380667	23 华能罗源 ABN001 优先	44,092	4,409,583.10
中国银行股份有限公司	082380675	23 华能安源 ABN001 优先	87,818	8,782,674.18
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	102001484	20 中建材集 MTN004	200	20,645.12
中国银行股份有限公司	102001539	20 中煤集团 MTN001	350	36,100.75
中国银行股份有限公司	102001539	20 中煤集团 MTN001	350	36,100.75
中国银行股份有限公司	102101282	21 华电股 MTN001	500	51,295.33
中国银行股份有限公司	102101908	21 云能投 MTN003	20,650	2,130,967.92
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	82,600	8,523,871.70
中国银行股份有限公司	102281464	22 山西建投 MTN003(科创 票据)	41,300	4,204,455.41
中国银行股份有限公司	102281566	22 浙报 MTN001	200	20,423.65

中国银行股份有限公司	102281690	22 鲁钢铁 MTN003	33,040	3,309,920.95
中国银行股份有限公司	102281690	22 鲁钢铁 MTN003	35,105	3,516,791.01
中国银行股份有限公司	102282276	22 高速路桥 MTN001	2,020	207,912.85
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	102300393	23 京津冀 MTN001B	1,280	128,039.87
中国银行股份有限公司	102300394	23 晋路桥 MTN001(乡村 振兴)	5,120	512,000.00
中国银行股份有限公司	102300425	23 龙城发展 MTN002	1,280	128,000.00
中国银行股份有限公司	102300441	23 华能 MTN013	41,460	4,146,311.52
中国银行股份有限公司	102300571	23 金辉集团 MTN002	1,237	123,736.35
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	690	69,000.00
中国银行股份有限公司	102380416	23 中原高速 MTN001	73,650	7,365,000.00
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	14,730	1,473,148.51
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	11,400	1,140,096.56
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	18,320	1,832,479.02
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	102381573	23 南昌轨交 MTN003(绿色)	640	64,000.00
中国银行股份有限公司	102381612	23 华电股 MTN007A	3,840	384,000.00
中国银行股份有限公司	102381781	23 长沙水业 MTN003	640	64,000.00
中国银行股份有限公司	102381892	23 武汉城建 MTN001	6,910	691,057.21
中国银行股份有限公司	102381892	23 武汉城建 MTN001	640	64,000.00

中国银行股份有限公司	102381955	23 中广核租 MTN003(绿色)	2,020	202,000.00
中国银行股份有限公司	102381956	23 越秀交通 MTN001	2,580	258,000.00
中国银行股份有限公司	102382056	23 厦国贸控 MTN003	2,580	258,000.00
中国银行股份有限公司	102382060	23 吉利汽车 MTN001	10,320	1,032,000.00
中国银行股份有限公司	102382060	23 吉利汽车 MTN001	75,920	7,592,000.00
中国银行股份有限公司	102382080	23 陕有色 MTN001	18,060	1,806,000.00
中国银行股份有限公司	102382259	23 晋能煤业 MTN004	2,020	202,000.00
中国银行股份有限公司	102382259	23 晋能煤业 MTN004	27,640	2,764,264.32
中国银行股份有限公司	102382270	23 贵州高速 MTN002	13,820	1,382,113.28
中国银行股份有限公司	102382322	23 京能国际 MTN001	33,880	3,388,340.65
中国银行股份有限公司	102382323	23 龙湖拓展 MTN001	7,740	774,000.00
中国银行股份有限公司	102382347	23 郑州公用 MTN002	15,280	1,528,127.33
中国银行股份有限公司	102382355	23 美的置业 MTN004A	7,950	795,000.00
中国银行股份有限公司	102382439	23 云能投 MTN002	26,500	2,650,000.00
中国银行股份有限公司	102382528	23 中交天航 MTN001(科创 票据)	15,280	1,528,158.23
中国银行股份有限公司	102382528	23 中交天航 MTN001(科创 票据)	8,470	847,087.71
中国银行股份有限公司	102382568	23 闽冶金 MTN003	30,560	3,056,826.62
中国银行股份有限公司	102382589	23 象屿股份 MTN002	8,470	847,100.67
中国银行股份有限公司	102382594	23 华侨城 MTN005	1,860	186,000.00
中国银行股份有限公司	102382594	23 华侨城 MTN005	13,250	1,325,143.72

中国银行股份有限公司	102382652	23 本钢集团 MTN001(科创 票据)	5,508	551,404.02
中国银行股份有限公司	102382652	23 本钢集团 MTN001(科创 票据)	7,950	795,000.00
中国银行股份有限公司	102382920	23 武商贸集 MTN002	8,521	852,168.09
中国银行股份有限公司	102382923	23 天津港 MTN001(科创 票据)	1,014	101,379.63
中国银行股份有限公司	102382923	23 天津港 MTN001(科创 票据)	3,408	340,870.87
中国银行股份有限公司	102382953	23 北部湾投 MTN004	7,966	796,658.10
中国银行股份有限公司	102383017	23 新创建 MTN002BC	31,134	3,113,737.56
中国银行股份有限公司	102383366	23 龙湖企业 MTN002	604	60,440.24
中国银行股份有限公司	102383427	23 先正达 MTN002	30,930	3,093,850.69
中国银行股份有限公司	1928026	19 兴业银行二 级 02	4,060	428,960.05
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	150	15,703.19
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	250	26,131.93
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	1,500	156,621.26
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	200	20,785.90
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永 续债 01	33,880	3,537,612.27
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	150	15,891.34
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	2128022	21 交通银行永 续债	80	8,508.61
中国银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永 续债	80	8,508.96

中国银行股份有限公司	2128036	21 平安银行二级	120	12,390.76
中国银行股份有限公司	2128036	21 平安银行二级	200	20,651.26
中国银行股份有限公司	222380010	23 青岛银行绿色债 01	7,930	793,086.24
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	2320028	23 威海银行绿色债	1,920	192,000.00
中国银行股份有限公司	2320031	23 华润银行小微债 01	640	64,000.00
中国银行股份有限公司	2320041	23 南京银行 01	13,820	1,382,000.00
中国银行股份有限公司	2320044	23 湖南银行 01	6,910	691,000.00
中国银行股份有限公司	2320053	23 厦门银行绿色债 01	7,966	796,768.31
中国银行股份有限公司	2322010	23 福特汽车债 02	5,160	516,000.00
中国银行股份有限公司	2322016	23 农银金租绿色债	7,998	799,869.79
中国银行股份有限公司	2322019	23 招银金租债 02	7,081	708,169.41
中国银行股份有限公司	232380026	23 厦门国际二级资本债 01	31,610	3,161,000.00
中国银行股份有限公司	232380026	23 厦门国际二级资本债 01	640	64,000.00
中国银行股份有限公司	232380063	23 创兴银行二级资本债 01BC	30,560	3,056,000.00
中国银行股份有限公司	2326015	23 渣打银行 01	15,280	1,528,124.83
中国银行股份有限公司	2389373	23 汇聚融 1A1_BC	1,607	160,735.95
中国银行股份有限公司	2389373	23 汇聚融 1A1_BC	13	1,303.80
中国银行股份有限公司	2389373	23 汇聚融 1A1_BC	676	67,600.25
中国银行股份有限公司	242300001	23 宁波银行永续债 01	1,920	192,000.00
中国银行股份有限公司	242300001	23 宁波银行永续债 01	126,440	12,644,000.00

中国银行股份有限公司	242380014	23 富邦华一永续债 01	12,644	1,264,605.90
中国银行股份有限公司	242380014	23 富邦华一永续债 01	256	25,600.00
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	152,800	15,281,406.93
中国银行股份有限公司	272380014	23 东方二级资本债 01BC	76,400	7,640,834.97
中国银行股份有限公司	292380007	23 加拿大银行债 01BC	8,521	852,163.17
中国银行股份有限公司	UL457960	23 新创建 MTN001BC	9,660	966,000.00
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	1,000	105,794.14
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	16,940	1,728,276.63
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	400	42,130.59
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	400	40,713.10
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	42,350	4,365,308.24
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	42,350	4,365,308.24

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	150	15,592.50
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	42,350	4,325,900.68
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	42,350	4,368,344.60
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	8,470	873,668.92
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	10,800	1,084,732.16
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	21,600	2,168,878.22
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	20,730	2,073,189.74

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	170,820	17,082,000.00
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	76,010	7,601,000.00
中国银行股份有限公司; 中银国际证券股份有限公司	1928013	19 民生银行永续债	148,258	15,266,767.34
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	7,998	799,869.79
中银国际亚洲有限公司	00390	港股通	30,921	114,016.54
中银国际亚洲有限公司	00390	港股通	32,584	143,288.53
中银国际亚洲有限公司	00390	港股通	34,540	143,397.25
中银国际亚洲有限公司	00836	港股通	16,626	256,122.00
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	14,152	269,956.03
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	18,921	419,565.85
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	21,163	390,851.93
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	37,115	571,896.22
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	42,596	646,926.00
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	5,868	85,531.69
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	53,912	859,703.83
中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	7,755	132,225.49

中银国际亚洲有限公司	00981	港股通	9,715	208,944.36
中银国际亚洲有限公司	01339	港股通	31,149	71,406.03
中银国际亚洲有限公司	01800	港股通	20,212	71,264.52
中银国际亚洲有限公司	01800	港股通	35,876	143,384.92
中银国际亚洲有限公司	01816	港股通	71,378	114,049.90
中银国际亚洲有限公司	01816	港股通	86,211	143,423.22
中银国际亚洲有限公司	03958	港股通	13,438	53,184.70
中银国际亚洲有限公司	03958	港股通	13,555	49,118.05
中银国际亚洲有限公司	06030	港股通	18,253	236,022.68
中银国际证券股份有限公司	110053	苏银转债	760	95,288.22
中银国际证券股份有限公司	113021	中信转债	20,380	2,362,708.16
中银国际证券股份有限公司	113021	中信转债	23,250	2,577,959.32
中银国际证券股份有限公司	113052	兴业转债	17,780	1,853,041.72
中银国际证券股份有限公司	113052	兴业转债	5,400	552,155.40
中银国际证券股份有限公司	113052	兴业转债	5,400	549,705.11
中银国际证券股份有限公司	115629	23 津投 13	512	51,200.00
中银国际证券股份有限公司	115798	23 津投 17	798	82,801.69

中银国际证 券股份有限 公司	183008	工鑫 10A	127,635	13,124,119.58
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	1,200	128,198.20
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	400	42,551.28
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	1,500	158,248.61
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	25,410	2,586,956.84
中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	200	20,787.97
中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	400	41,569.24
中银国际证 券股份有限 公司	2389307	23 欣荣 2 优先	1,694	169,400.00
中银国际证 券股份有限 公司	360025	中信优 1	45,010	4,618,503.19
中银国际证 券股份有限 公司	360025	中信优 1	80,000	8,177,600.00
中银国际证 券股份有限 公司	360025	中信优 1	90,021	9,237,006.38
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	15,200	1,556,784.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	15,200	1,556,784.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	16,800	1,710,072.00

中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	16,800	1,710,072.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	16,800	1,710,072.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	16,800	1,710,072.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	16,800	1,710,072.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	160,000	16,595,200.00
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	45,010	4,681,067.46
中银国际证 券股份有限 公司	360034	光大优 3	160,000	16,865,600.00
中银国际证 券股份有限 公司	360034	光大优 3	45,010	4,754,434.19
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	225,051	22,916,975.92
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	4,842	118,983.94
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	4,842	118,983.94
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	4,933	118,987.79
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	9,801	237,974.42
中银国际证 券股份有限 公司	600030	中信证券	9,962	237,992.64

中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	7,783	162,977.93
中银国际证 券股份有限 公司	601669	中国电建	21,286	162,996.19
中银国际证 券股份有限 公司	601669	中国电建	68	475.11
中银国际证 券股份有限 公司	688009	中国通号	26,662	158,997.58

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	ZYLCZYZ Q202128	中银证券中国 红-汇中 28 号 集合资产管理 计划	9,324,009	10,000,000.00
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	119,727,390	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	18,709,074	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	19,113,150	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	190,785,081	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	37,237,014	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	37,551,634	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	91,449,474	100,000,000.00
中银国际证券股份有限公司	ZYZQZYL C202124	中银证券-中银理财 24 号单一资产管理计划	19,837,334	20,000,000.00

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	11,599,186.92
产品托管费	中国银行股份有限公司	919,202.19
14 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	84,518,100.00
20 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	42,000,000.00
21 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	50,251,500.00
7 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	116,368,100.00
现券买入	中国银行股份有限公司	153,847,969.66
现券买入	中银国际证券股份有限公司	122,354,414.93
现券买入	中银资产管理有限公司	43,771,615.03
现券卖出	中银国际证券股份有限公司	33,190,543.31
证券交易佣金	中银国际证券股份有限公司	3,319.08

## 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-（2年）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年）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

