

中银理财“福”（1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：中国农业银行股份有限公司

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 | FCYQZQ1Y |
| 理财产品名称 | 中银理财“福”（1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 | Z7001023000023 |
| 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 | 2023-02-28 |
| 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 |
|--------------|------------------|--------------|----------------|------------------|-----------------------|
| FCYQZQ1YA | 2,531,024,698.46 | 1.030648 | 1.030648 | 2,608,597,927.28 | 3.06% |
| FCYQZQ1YL | 162,505,153.31 | 1.031383 | 1.031383 | 167,605,188.81 | 3.14% |

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：104.69%

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 | 31,345.65 | 11.28% | 34,531.35 | 12.06% |
| 同业存单 | - | 0.00% | 2,509.53 | 0.88% |
| 拆放同业及买入返售 | - | 0.00% | 316.14 | 0.11% |
| 债券 | - | 0.00% | 245,116.51 | 85.64% |
| 非标准化债权类资产 | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 权益类投资 | - | 0.00% | 2,134.82 | 0.75% |
| 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% | 1,615.50 | 0.56% |
| 私募基金 | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 资产管理产品 | 246,454.56 | 88.72% | - | 0.00% |
| 合计 | 277,800.21 | 100% | 286,223.86 | 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 | 34,531.35 | 12.06% |
| 2 | 102100506：21 潍坊投资 MTN001 | 6,698.03 | 2.34% |
| 3 | 133052：21 桂铁 02 | 5,412.47 | 1.89% |
| 4 | 1928013：19 民生银行永续债 | 4,640.48 | 1.62% |
| 5 | 1980323：19 华发集团 01 | 4,162.14 | 1.45% |
| 6 | 082100975：21 江西铁航 ABN001 优先 | 4,146.52 | 1.45% |
| 7 | 230210：23 国开 10 | 3,370.23 | 1.18% |
| 8 | 102101942：21 厦国贸控 MTN007 | 3,323.19 | 1.16% |
| 9 | 102101908：21 云能投 MTN003 | 3,157.15 | 1.10% |

| | | | |
|----|------------------|----------|-------|
| 10 | 185942: 22 交通 G4 | 2,983.08 | 1.04% |
|----|------------------|----------|-------|

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“福”（1年）最短持有期固收增强理财产品 |
| 账号 | 11200801040023813 |
| 开户行 | 中国农业银行股份有限公司北京崇文支行 |

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） |
| 农银金融租赁有限公司 | 2322016 | 23 农银金租绿色债 | 4,407 | 440,765.42 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 1928021 | 19 农业银行永续债 01 | 33,450 | 3,405,498.08 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 2028017 | 20 农业银行永续债 01 | 55,750 | 5,694,662.64 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 2028032 | 20 农业银行永续债 02 | 11,150 | 1,150,107.26 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 2028032 | 20 农业银行永续债 02 | 55,750 | 5,750,536.28 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 242380017 | 23 农行永续债 01 | 110,070 | 11,007,000.00 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 242380017 | 23 农行永续债 01 | 83,600 | 8,360,000.00 |

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） |
| 中国农业银行股份有限公司 | 012381933 | 23 南通城建 SCP003 | 2,440 | 244,000.00 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 102381769 | 23 华润 MTN002 | 5,170 | 517,000.00 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 102382073 | 23 格力 MTN004 | 12,230 | 1,223,000.00 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 102382148 | 23 厦国贸 MTN001 | 12,230 | 1,223,000.00 |

| | | | | |
|--------------------------|-----------|----------------------|--------|--------------|
| 中国农业银行股份有限公司 | 102382434 | 23 中建新疆 MTN001(科创票据) | 11,150 | 1,115,116.68 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 102382931 | 23 铜陵有色 MTN001 | 1,468 | 146,859.72 |
| 中国农业银行股份有限公司;中国银行股份有限公司 | 102382856 | 23 北电 MTN001 | 95,939 | 9,593,949.00 |
| 中国农业银行股份有限公司;中国银行股份有限公司 | 102383366 | 23 龙湖企业 MTN002 | 128 | 12,784.08 |
| 中国农业银行股份有限公司;中国银行股份有限公司 | 2322016 | 23 农银金租绿色债 | 4,407 | 440,765.42 |
| 中国农业银行股份有限公司;中国银行股份有限公司 | 292380007 | 23 加拿大银行债 01BC | 7,342 | 734,300.37 |
| 中国农业银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司 | 012283152 | 22 招商局港 SCP005 | 9,760 | 987,725.74 |
| 中国农业银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司 | 012380883 | 23 三峡新能 SCP001 | 1,300 | 131,010.03 |
| 中国农业银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司 | 012382133 | 23 江苏核电 SCP001(科创票据) | 11,220 | 1,122,000.00 |

| | | | | |
|-------------------------|-----------|---------------------|--------|--------------|
| 中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司 | 092280003 | 22 中国信达债 01 | 19,520 | 1,974,743.42 |
| 中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司 | 102381150 | 23 碧桂园 MTN002 | 1,464 | 146,415.80 |
| 中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司 | 102381152 | 23 碧桂园 MTN001 | 1,464 | 146,415.20 |
| 中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司 | 102382270 | 23 贵州高速 MTN002 | 15,200 | 1,520,124.59 |
| 中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司 | 102382589 | 23 象屿股份 MTN002 | 11,150 | 1,115,132.52 |
| 中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司 | 1928038 | 19 平安银行永 续债 01 | 44,600 | 4,656,951.22 |
| 中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司 | 2326015 | 23 渣打银行 01 | 9,850 | 985,080.47 |
| 中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司 | 272380014 | 23 东方二级资 本债 01BC | 49,250 | 4,925,538.25 |

| | | | | |
|--|-----------|-------------------|--------|--------------|
| 中国农业银行股份有限公司, 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 | 22,300 | 2,275,122.13 |
| 中国银行股份有限公司 | 012380527 | 23 闽冶金 SCP002 | 7,320 | 735,872.20 |
| 中国银行股份有限公司 | 012381525 | 23 东方国际 SCP001 | 14,640 | 1,465,592.62 |
| 中国银行股份有限公司 | 012381961 | 23 吴中国太 SCP003 | 2,440 | 244,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 012381971 | 23 津城建 SCP032 | 14,820 | 1,482,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 012381971 | 23 津城建 SCP032 | 2,440 | 244,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 012382241 | 23 津城建 SCP037 | 14,710 | 1,471,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 012383899 | 23 南通高新 SCP010 | 36,905 | 3,690,793.78 |
| 中国银行股份有限公司 | 032280151 | 22 昆交投 PPN001 | 32,598 | 3,346,221.51 |
| 中国银行股份有限公司 | 032280151 | 22 昆交投 PPN001 | 32,598 | 3,346,221.51 |
| 中国银行股份有限公司 | 032380359 | 23 吴中经发 PPN002 | 2,970 | 297,029.94 |
| 中国银行股份有限公司 | 032380567 | 23 平潭城发 PPN001 | 3,740 | 374,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 042380292 | 23 广西金控 CP001 | 22,230 | 2,223,327.98 |
| 中国银行股份有限公司 | 082380667 | 23 华能罗源 ABN001 优先 | 989 | 98,940.20 |
| 中国银行股份有限公司 | 082380675 | 23 华能安源 ABN001 优先 | 1,970 | 197,060.90 |
| 中国银行股份有限公司 | 102101908 | 21 云能投 MTN003 | 495 | 51,721.51 |
| 中国银行股份有限公司 | 102281062 | 22 西安高新 MTN002 | 16,299 | 1,731,415.89 |
| 中国银行股份有限公司 | 102282276 | 22 高速路桥 MTN001 | 11,500 | 1,183,662.28 |
| 中国银行股份有限公司 | 102300375 | 23 粤珠江 MTN001 | 3,740 | 374,038.32 |

| | | | | |
|------------|-----------|-----------------------------------|--------|--------------|
| 中国银行股份有限公司 | 102300393 | 23 京津冀 MTN001B | 10,340 | 1,034,322.07 |
| 中国银行股份有限公司 | 102300394 | 23 晋路桥 MTN001(乡村 振兴) | 41,360 | 4,136,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102300425 | 23 龙城发展 MTN002 | 10,340 | 1,034,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102300441 | 23 华能 MTN013 | 45,600 | 4,560,342.62 |
| 中国银行股份有限公司 | 102300571 | 23 金辉集团 MTN002 | 262 | 26,172.20 |
| 中国银行股份有限公司 | 102380843 | 23 水电八局 MTN001 | 6,930 | 693,075.17 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381236 | 23 华电 MTN004A(能 源保供特别 债) | 24,400 | 2,440,592.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381241 | 23 新创建 MTN001BC | 2,440 | 244,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381242 | 23 中铁置业 MTN001 | 7,320 | 732,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381255 | 23 桂铁投 MTN001 | 2,440 | 244,024.67 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381265 | 23 福建港口 MTN002 | 12,200 | 1,220,115.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381318 | 23 豫水利 MTN002 | 29,920 | 2,992,295.93 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381341 | 23 首农食品 MTN002 | 7,480 | 748,195.58 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381363 | 23 中化股 MTN001 | 22,440 | 2,244,179.03 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381458 | 23 龙岩汇金 MTN001 | 3,740 | 374,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381466 | 23 北部湾 MTN002 | 3,740 | 374,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381573 | 23 南昌轨交 MTN003(绿 色) | 5,170 | 517,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381612 | 23 华电股 MTN007A | 31,020 | 3,102,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381781 | 23 长沙水业 MTN003 | 5,170 | 517,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381892 | 23 武汉城建 MTN001 | 5,170 | 517,000.00 |

| | | | | |
|------------|-----------|-----------------------------|---------|---------------|
| 中国银行股份有限公司 | 102381892 | 23 武汉城建 MTN001 | 7,600 | 760,062.92 |
| 中国银行股份有限公司 | 102381955 | 23 中广核租 MTN003(绿色) | 11,500 | 1,150,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382060 | 23 吉利汽车 MTN001 | 48,920 | 4,892,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382259 | 23 晋能煤业 MTN004 | 11,500 | 1,150,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382259 | 23 晋能煤业 MTN004 | 30,400 | 3,040,290.71 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382322 | 23 京能国际 MTN001 | 44,600 | 4,460,448.44 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382347 | 23 郑州公用 MTN002 | 9,850 | 985,082.08 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382439 | 23 云能投 MTN002 | 162,990 | 16,910,915.57 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382528 | 23 中交天航 MTN001(科创 票据) | 11,150 | 1,115,115.46 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382528 | 23 中交天航 MTN001(科创 票据) | 9,850 | 985,102.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382568 | 23 闽冶金 MTN003 | 19,700 | 1,970,532.87 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382594 | 23 华侨城 MTN005 | 17,920 | 1,792,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382652 | 23 本钢集团 MTN001(科创 票据) | 52,961 | 5,301,694.56 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382811 | 23 京能国际 MTN002 | 38,376 | 3,837,579.60 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382920 | 23 武商贸集 MTN002 | 7,342 | 734,304.61 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382923 | 23 天津港 MTN001(科创 票据) | 2,937 | 293,724.97 |
| 中国银行股份有限公司 | 102382953 | 23 北部湾投 MTN004 | 7,209 | 720,938.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102383017 | 23 新创建 MTN002BC | 20,066 | 2,006,787.22 |
| 中国银行股份有限公司 | 102383376 | 23 本钢集团 MTN002(科创 票据) | 53,587 | 5,358,741.00 |

| | | | | |
|-------------------------------------|-----------|--------------------------|--------|--------------|
| 中国银行股份有限公司 | 102383427 | 23 先正达 MTN002 | 6,542 | 654,398.49 |
| 中国银行股份有限公司 | 212300002 | 23 江苏银行债 01 | 3,740 | 374,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 222380010 | 23 青岛银行绿 债 01 | 194 | 19,445.11 |
| 中国银行股份有限公司 | 2320022 | 23 杭州银行 01 | 3,740 | 374,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 2320028 | 23 威海银行绿 色债 | 15,510 | 1,551,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 2320031 | 23 华润银行小 微债 01 | 5,170 | 517,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 2320041 | 23 南京银行 01 | 15,200 | 1,520,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 2320044 | 23 湖南银行 01 | 7,600 | 760,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 2320053 | 23 厦门银行绿 色债 01 | 7,209 | 721,037.73 |
| 中国银行股份有限公司 | 2322019 | 23 招银金租债 02 | 196 | 19,630.96 |
| 中国银行股份有限公司 | 232380026 | 23 厦门国际二 级资本债 01 | 5,170 | 517,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 232380063 | 23 创兴银行二 级资本债 01BC | 19,700 | 1,970,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 2389373 | 23 汇聚融 1A1_BC | 2,460 | 246,084.11 |
| 中国银行股份有限公司 | 242300001 | 23 宁波银行永 续债 01 | 15,510 | 1,551,000.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 242380014 | 23 富邦华一永 续债 01 | 2,068 | 206,800.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 242380021 | 23 建行永续债 02 | 98,500 | 9,850,906.95 |
| 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 | 55,750 | 5,746,539.19 |
| 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 | 55,750 | 5,746,539.19 |

| | | | | |
|--------------------------|-----------|-----------------|---------|---------------|
| 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 | 55,750 | 5,694,662.64 |
| 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 | 11,150 | 1,150,107.26 |
| 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 | 55,750 | 5,750,536.28 |
| 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 | 22,800 | 2,280,208.69 |
| 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 | 110,070 | 11,007,000.00 |
| 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 | 83,600 | 8,360,000.00 |
| 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 | 526,509 | 54,216,904.59 |
| 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 | 4,407 | 440,765.42 |
| 中银国际证券股份有限公司 | 113021 | 中信转债 | 540 | 62,603.65 |

| | | | | |
|----------------------|---------|-------------------|--------|--------------|
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 113052 | 兴业转债 | 570 | 59,405.72 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 115629 | 23 津投 13 | 2,918 | 291,800.00 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 115629 | 23 津投 13 | 77 | 8,127.65 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 1928021 | 19 农业银行永 续债 01 | 33,450 | 3,405,498.08 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2389307 | 23 欣荣 2 优先 | 2,230 | 223,000.00 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600030 | 中信证券 | 1,318 | 31,996.56 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600030 | 中信证券 | 1,339 | 31,999.01 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600030 | 中信证券 | 651 | 15,997.84 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600030 | 中信证券 | 651 | 15,997.84 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 600030 | 中信证券 | 663 | 15,998.36 |

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 | 10,455,876 | 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 | 110,385,429 | 120,000,000.00 |
| 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 | 139,017,609 | 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 | 185,373,992 | 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 | 23,238,520 | 25,000,000.00 |
| 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 | 23,273,133 | 25,000,000.00 |
| 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 | 232,147,832 | 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 | 27,798,369 | 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 | 27,844,812 | 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 | 274,348,423 | 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 | 28,203,441 | 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 | 30,598,053 | 33,000,000.00 |

| | | | | |
|----------------------|----------------------|-------------------------------------|-------------|----------------|
| 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 | 32,428,426 | 35,000,000.00 |
| 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 | 4,639,080 | 5,000,000.00 |
| 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 | 55,813,953 | 60,000,000.00 |
| 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 | 819,049,384 | 884,000,000.00 |
| 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 | 9,177,680 | 10,000,000.00 |
| 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 | 17,267,843 | 18,000,000.00 |
| 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 | 19,096,725 | 20,000,000.00 |
| 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 | 53,150,367 | 55,000,000.00 |
| 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 | 92,974,216 | 97,000,000.00 |
| 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 | 96,805,421 | 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 | 1,158,943.24 |
| 现券买入 | 中国银行股份有限公司 | 115,122,950.21 |
| 现券买入 | 中银国际证券股份有限公司 | 65,799,072.92 |
| 现券卖出 | 中银国际证券股份有限公司 | 4,455,331.17 |

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 2023 年年度托管人报告

一、报告期内本产品托管人合规守信情况声明

在托管本产品的过程中，本产品托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《商业银行理财业务监督管理办法》等相关法律法规的规定以及产品合同、托管协议的约定，对产品管理人中银理财有限责任公司在报告期内的投资运作，进行了独立的会计核算和投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害产品份额持有人利益的行为。

二、对本产品定期报告中财务信息等内容的意见

本托管人根据《商业银行理财业务监督管理办法》等相关法律法规的规定，以及理财管理人所提供的统计口径，对本理财产品 2023 年年度投资运作情况报告进行了复核，该报告中的财务数据真实、准确、完整，未发现有损害产品持有人利益的行为。

中国农业银行股份有限公司托管业务部

2024 年 3 月 4 日