

中银理财-悦享天添  
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：招商银行股份有限公司

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	YXTT01
理财产品名称	中银理财-悦享天添
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001021000462
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	2021-08-19
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
YXTT01A	34,105,399,980.58	1.072326	1.072326	36,572,119,310.20	2.97%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：106.41%

### 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	88,298.01	2.36%	1,748,129.42	46.50%
同业存单	-	0.00%	366,612.15	9.75%

拆放同业及买入返售	-	0.00%	1,155.60	0.03%
债券	289,236.68	7.72%	1,592,402.11	42.36%
非标准化债权类资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	-	0.00%
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%	50,947.44	1.36%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	3,368,981.03	89.92%	-	0.00%
合计	3,746,515.71	100%	3,759,246.71	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	DQ000111：存放同业	238,085.47	6.33%
2	TI-000002384：存放同业	157,520.81	4.19%
3	CNY：现金及银行存款	104,340.08	2.78%
4	DQ001579：存放同业	87,172.58	2.32%
5	TI-000002467：存放同业	81,280.81	2.16%
6	DQ007788：存放同业	79,361.82	2.11%
7	019678：22 国债 13	70,029.47	1.86%
8	TD20220331：存放同业	65,785.54	1.75%
9	NJJB5633：存放同业	53,370.97	1.42%
10	TI-000002370：存放同业	47,256.22	1.26%

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-悦享天添
账号	755953000310808
开户行	招商银行股份有限公司北京月坛支行

## 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，经济基本面处于温和修复中，债券市场呈现年初震荡调整、年中走牛、年末震荡回调的波浪形态，其中，信用债受上半年资产荒驱动和下半年化债政策利好，利差大幅收窄。

操作上，产品管理人围绕产品定位、顺应市场走势，灵活调整产品杠杆、久期和资产配置，积极优化组合资产结构。上半年加大信用债配置力度、增配性价比较高资产，在年中前瞻性降低市价法资产仓位，处置短久期资产，在锁定收益的同时有效把控组合的杠杆水平。

### （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）

招商局集团有限公司	012380386	23 招商局 SCP002	100,980	10,137,240.83
招商银行股份有限公司	1828015	18 招商银行二级 01	19,820	2,005,466.88
招商银行股份有限公司	1828015	18 招商银行二级 01	79,280	8,021,812.02
中国银行股份有限公司	1928028	19 中国银行二级 01	1,060	110,093.91
中国银行股份有限公司	1928028	19 中国银行二级 01	1,590	165,052.13
中国银行股份有限公司	1928028	19 中国银行二级 01	13,730	1,425,754.44
中国银行股份有限公司	1928028	19 中国银行二级 01	13,730	1,425,740.71
中国银行股份有限公司	1928028	19 中国银行二级 01	41,190	4,277,469.27
中国银行股份有限公司	1928033	19 中国银行二级 03	18,940	1,970,140.38

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）
招商银行股份有限公司	012380264	23 华润置地 SCP001	1,060	106,280.37
招商银行股份有限公司	012381577	23 中国信科 SCP001	200,000	20,013,509.51
招商银行股份有限公司	012382108	23 粤交投 SCP001	9,470	945,763.65
招商银行股份有限公司	102001422	20 合肥滨湖 MTN001	33,660	3,462,769.13
招商银行股份有限公司	102100285	21 渝富 MTN003	196,080	20,180,906.54
招商银行股份有限公司	102100703	21 招商局港 MTN001	9,470	960,156.14
招商银行股份有限公司	102100777	21 泸州窖 MTN002	18,940	1,920,024.37
招商银行股份有限公司	102101011	21 国家能源 MTN001	18,940	1,909,613.73
招商银行股份有限公司	102101011	21 国家能源 MTN001	18,940	1,910,103.90
招商银行股份有限公司	102101395	21 中冶 MTN001	147,060	15,335,599.12

招商银行股份有限公司	102103102	21 兖州煤业 MTN002	73,530	7,611,566.53
招商银行股份有限公司	102103339	21 京城建 MTN003	122,550	12,515,977.61
招商银行股份有限公司	102381165	23 江宁国资 MTN001	175,680	17,568,000.00
招商银行股份有限公司	102382140	23 中粮置业 MTN001	44,300	4,430,000.00
招商银行股份有限公司	132100044	21 川能投 GN001(权益出 资)	219,600	22,258,269.60
招商银行股份有限公司	132100044	21 川能投 GN001(权益出 资)	98,040	9,989,561.27
招商银行股份有限公司	1920066	19 上海银行二 级	9,470	989,418.28
中国银行股份有限公司	012382234	23 闽能源 SCP002(碳资 产)	60,180	6,019,114.81
中国银行股份有限公司	012383899	23 南通高新 SCP010	23,531	2,353,250.93
中国银行股份有限公司	082280208	22 前海河钢 ABN001 优先	1,620	165,650.00
中国银行股份有限公司	082280280	22 鲁黄金 ABN001 优先	810	82,552.83
中国银行股份有限公司	082380336	23 同煤漳泽 ABN002 优先	100,300	10,036,443.93
中国银行股份有限公司	101900254	19 华润 MTN003B	9,470	968,446.98
中国银行股份有限公司	101901191	19 紫金矿业 MTN003	18,940	1,982,364.62
中国银行股份有限公司	102001484	20 中建材集 MTN004	67,320	6,949,148.59
中国银行股份有限公司	102001539	20 中煤集团 MTN001	117,810	12,151,511.16
中国银行股份有限公司	102001539	20 中煤集团 MTN001	117,810	12,151,511.16
中国银行股份有限公司	102100194	21 中航租赁 MTN001	20,200	2,085,001.58
中国银行股份有限公司	102100952	21 中建投租 MTN001	49,020	5,002,724.31
中国银行股份有限公司	102101175	21 晋焦煤 MTN003	530	55,347.15

中国银行股份有限公司	102101282	21 华电股 MTN001	168,300	17,266,006.51
中国银行股份有限公司	102101617	21 陕延油 MTN003	83,334	8,706,324.33
中国银行股份有限公司	102101876	21 环球租赁 MTN002	49,020	5,054,029.08
中国银行股份有限公司	102101898	21 京住总集 MTN003A	122,550	12,648,814.43
中国银行股份有限公司	102102007	21 晋能装备 MTN005	122,550	12,827,242.52
中国银行股份有限公司	102281566	22 浙报 MTN001	67,320	6,874,600.08
中国银行股份有限公司	132100102	21 天成租赁 GN002(碳中和 债)	24,510	2,551,383.19
中国银行股份有限公司	1828008	18 中信银行二 级 01	29,730	3,004,064.88
中国银行股份有限公司	1828008	18 中信银行二 级 01	69,370	7,009,873.18
中国银行股份有限公司	1828012	18 中信银行二 级 02	1,000,000	103,420,427.40
中国银行股份有限公司	1923001	19 中国人寿	1,059,300	108,254,885.07
中国银行股份有限公司	1923001	19 中国人寿	500,000	50,816,444.81
中国银行股份有限公司	1928002	19 民生银行二 级 01	2,020	208,217.42
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	109,800	11,411,457.75
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	601,800	62,836,450.72
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	50,490	5,349,026.59
中国银行股份有限公司	2389373	23 汇聚融 1A1_BC	1,569	156,871.18
中国银行股份有限公司	2389387	23 吉时代 4 优 先_BC	9,713	971,329.20
中国银行股份有限公司, 中银国际证 券股份有限 公司	1928010	19 平安银行二 级	1,590	168,802.73

中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928010	19 平安银行二级	1,590	168,676.01
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928010	19 平安银行二级	109,840	11,661,189.63
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928010	19 平安银行二级	18,940	1,934,970.58
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	1928010	19 平安银行二级	18,940	1,934,970.58
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	219,600	23,129,693.68
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	401,200	42,444,607.21
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	68,650	7,214,920.90
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	99,100	10,079,688.93

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	219,600	22,351,494.60
中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司, 招商银行股份有限公司	2028017	20 农业银行永续债 01	50,490	5,248,436.40
中国银行股份有限公司, 招商银行股份有限公司	102100408	21 豫交运 MTN001	10,100	1,037,346.29
中国银行股份有限公司, 招商银行股份有限公司	1920059	19 江苏银行二级	1,000,000	104,340,008.22
中国银行股份有限公司, 招商银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	50,490	5,285,693.45
中国银行股份有限公司, 招商银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	84,150	8,796,006.99
中国银行股份有限公司, 招商银行股份有限公司	2122021	21 交银租赁债 02	10,100	1,029,913.52
中国银行股份有限公司, 招商银行股份有限公司	2122022	21 华夏租赁债 02	10,100	1,028,383.87

中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2122024	21 太平石化租赁债 01	8,080	822,419.45
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永续债	43,920	4,671,418.80
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永续债	43,920	4,671,227.18
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2128036	21 平安银行二级	109,800	11,337,542.49
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2128036	21 平安银行二级	65,880	6,802,525.49
中银国际证券股份有限公司	137838	国新 04A2	10,512	460,437.59
中银国际证券股份有限公司	138907	23 信科 K1	3,150	315,000.00
中银国际证券股份有限公司	1828013	18 建设银行二级 02	99,100	10,019,991.09
中银国际证券股份有限公司	185065	21 华电 07	38,640	3,892,593.60
中银国际证券股份有限公司	185991	22 新汶 Y1	17,520	1,778,544.48
中银国际证券股份有限公司	1928006	19 工商银行二级 01	18,940	1,937,164.52

中银国际证 券股份有限 公司	1928006	19 工商银行二 级 01	600,000	61,120,820.55
中银国际证 券股份有限 公司	1928006	19 工商银行二 级 01	68,650	6,979,396.95
中银国际证 券股份有限 公司	1928009	19 农业银行二 级 04	1,060	107,631.01
中银国际证 券股份有限 公司	1928009	19 农业银行二 级 04	1,590	161,419.24
中银国际证 券股份有限 公司	1928009	19 农业银行二 级 04	37,880	3,872,238.12
中银国际证 券股份有限 公司	1928009	19 农业银行二 级 04	9,470	967,207.31
中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	13,710	1,391,248.30
中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	13,730	1,394,370.75
中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	18,940	1,934,781.63
中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	27,420	2,782,496.60
中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	27,460	2,789,056.04
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	219,600	23,360,650.91
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	481,440	51,433,118.28
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	27,460	2,876,363.45

中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	601,800	63,489,341.89
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	99,100	10,083,573.65
中银国际证 券股份有限 公司	1928028	19 中国银行二 级 01	1,060	110,093.91
中银国际证 券股份有限 公司	1928028	19 中国银行二 级 01	1,590	165,052.13
中银国际证 券股份有限 公司	1928028	19 中国银行二 级 01	13,730	1,425,740.71
中银国际证 券股份有限 公司	1928028	19 中国银行二 级 01	13,730	1,425,754.44
中银国际证 券股份有限 公司	1928028	19 中国银行二 级 01	41,190	4,277,469.27
中银国际证 券股份有限 公司	1928033	19 中国银行二 级 03	18,940	1,970,140.38
中银国际证 券股份有限 公司	193264	21 中宏 A2	48,750	1,329,747.18
中银国际证 券股份有限 公司	2028013	20 农业银行二 级 01	19,818	1,987,138.13
中银国际证 券股份有限 公司	2028013	20 农业银行二 级 01	49,545	4,968,018.74
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	1928019	19 交通银行二 级 01	1,060	110,680.94
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	1928019	19 交通银行二 级 01	1,590	165,882.82

中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	1928019	19 交通银行二 级 01	18,940	1,989,789.67
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	1928019	19 交通银行二 级 01	18,940	1,990,015.06
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	1928019	19 交通银行二 级 01	27,460	2,867,620.83
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	1928019	19 交通银行二 级 01	41,190	4,324,330.85
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	1928019	19 交通银行二 级 01	47,350	4,975,037.65
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	1928019	19 交通银行二 级 01	530	55,326.68
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	2028018	20 交通银行二 级	109,800	11,412,594.40
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	2028018	20 交通银行二 级	219,600	22,821,513.36

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	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	141,522,785	150,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	142,925,202	150,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	169,747,265	180,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	186,933,358	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	188,093,671	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	188,235,294	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	189,250,568	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	189,609,405	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	205,953,941	220,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	271,129,394	290,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	28,248,588	30,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	281,875,411	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	285,035,629	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	285,959,394	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	331,533,580	350,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	378,787,879	400,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	47,605,446	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	474,158,369	500,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	493,218,249	520,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	65,678,364	70,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝1号单一资 产管理计划	894,959,962	950,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝 1 号单一资 产管理计划	9,467,904	10,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝 1 号单一资 产管理计划	94,286,253	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝 1 号单一资 产管理计划	95,165,588	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝 1 号单一资 产管理计划	95,310,713	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZCJ B20210818	中银证券-中 银理财招财进 宝 1 号单一资 产管理计划	95,510,984	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q035	中银证券-中 银理财 35 号 单一资产管理 计划	186,950,832	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q035	中银证券-中 银理财 35 号 单一资产管理 计划	2,152,147	2,300,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q035	中银证券-中 银理财 35 号 单一资产管理 计划	92,893,637	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q035	中银证券-中 银理财 35 号 单一资产管理 计划	93,049,223	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	115,262,703	120,000,000.00
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	145,886,014	150,000,000.00

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	173,997,100	180,000,000.00
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	191,809,725	200,000,000.00
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	193,050,193	200,000,000.00
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	195,446,106	200,000,000.00
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	241,919,876	250,000,000.00
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	244,929,950	250,000,000.00
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	28,999,517	30,000,000.00
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	291,262,136	300,000,000.00
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	291,913,983	300,000,000.00
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	295,420,975	300,000,000.00
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	298,804,781	300,000,000.00

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	388,613,621	400,000,000.00
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	48,151,002	50,000,000.00
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	481,093,043	500,000,000.00
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	484,073,966	500,000,000.00
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	484,966,052	500,000,000.00
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	49,652,433	50,000,000.00
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	59,476,606	60,000,000.00
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	9,819,324	10,000,000.00
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	95,492,743	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	98,048,828	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	98,309,084	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	98,765,432	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	99,039,319	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQZGH HZ65	中银证券中国 红-汇中 65 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	ZYZQZGH HZ66	中银证券中国 红-汇中 66 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	ZYZQZGH HZ67	中银证券中国 红-汇中 67 号 集合资产管理 计划	5,000,000	5,000,000.00

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）
1 日质押式正回购	招银理财有限责任公司	1,133,968,373.20
1 日质押式正回购	招商基金管理有限公司	131,341,130.96
1 日质押式逆回购	招银理财有限责任公司	277,817,718.00
1 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	31,468,800.00
1 日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	18,186,913.60
21 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	61,372,500.00
3 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	216,586,400.00
3 日质押式逆回购	招银理财有限责任公司	60,888,000.00
7 日质押式正回购	招商基金管理有限公司	574,768,442.50
7 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	45,316,400.00
7 日质押式正回购	招银理财有限责任公司	33,660,000.00
7 日质押式正回购	大家资产管理有限责任公司	6,930,063.00
7 日质押式逆回购	招银理财有限责任公司	10,507,924.00

9日质押式逆回购	招银理财有限责任公司	50,000,000.00
现券买入	中国银行股份有限公司	128,802,431.16
现券买入	中银国际证券股份有限公司	21,409,636.45
现券买入	招商银行股份有限公司	20,627,864.76
现券卖出	中银国际证券股份有限公司	197,633,800.78
现券卖出	招商银行股份有限公司	5,044,180.15
现券卖出	大家资产管理有限责任公司	3,540,838.79
证券交易佣金	中银国际证券股份有限公司	34,221.24

#### 八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市，经济正处于新旧动能切换的阶段，在经济内生动力得到数据验证之前，利率中枢仍处于下行通道，但资金面、政策面、机构行为的扰动或将放大短端的不确定性。

操作上，产品管理人将继续坚持产品既有策略，以净值稳健增长为主要目标，基于市场研判灵活调整产品久期和杠杆，低波部分加大资产拓展、丰富资产品类，同时积极捕捉确定性较强的交易机会，力争增厚产品收益。

关于《中银理财-悦享天添理财产品 2023 年年度报告》托管人复核  
意见的回函

中银理财有限责任公司:

托管人声明,在本报告期内,资产托管人严格遵守有关法律法规、托管合同关于托管人职责的约定,尽职尽责地履行了托管职责并安全保管托管资产。

在管理人提供的各项数据和信息真实、准确、有效的前提下,在我行能够知悉和掌握的情况范围内,我行对《中银理财-悦享天添理财产品 2023 年年度报告》报告中的截至报告期末财务数据进行了复核。

特此报告。

招商银行股份有限公司北京分行

2024 年 2 月 27 日

