

中银理财-（14 天）最短持有期纯债理财产品 2024 年半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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

一、理财产品基本情况

理财产品代码	CYQCZ14D
理财产品名称	中银理财-（14天）最短持有期纯债理财产品
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000465
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	2022-09-28
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
CYQCZ14DA	20,880,025,806.31	1.049355	1.049355	21,910,574,219.90	1.26%
CYQCZ14DB	16,565,901,714.14	1.051076	1.051076	17,412,022,206.70	1.30%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：103.62%

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	197,009.23	5.01%	1,433,637.38	36.08%
同业存单	-	0.00%	617,540.37	15.54%
拆放同业及买入返售	60,000.00	1.53%	81,434.91	2.05%
债券	148,074.47	3.77%	1,571,432.06	39.55%
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%	269,576.21	6.78%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	3,526,147.38	89.70%	-	0.00%
合计	3,931,231.08	100%	3,973,620.93	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	210,185.95	5.29%
2	23060705：存放同业	179,834.83	4.53%
3	23060704：存放同业	143,867.86	3.62%
4	23060701：存放同业	143,867.86	3.62%
5	23060702：存放同业	143,867.86	3.62%
6	1928018：19 工商银行永续债	137,019.19	3.45%
7	2028006：20 邮储银行永续债	107,749.54	2.71%
8	1928021：19 农业银行永续债 01	96,541.55	2.43%
9	1928031：19 广发银行永续债	63,652.05	1.60%
10	1928023：19 农业银行永续债 02	62,157.66	1.56%

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（14天最短持有期纯债）
账号	748476208849
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，努力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，机构欠配状态与央行对收益率水平的表态成为市场交易的主线，市场收益率水平波动加大，但整体震荡下行。在资产配置上，一方面，抓住市场调整机会，捕捉波段交易机会，以期获得后续收益率下行带来的资本利得收益；另一方面，积极拓展优质资产，并根据市场变化对组合久期、杠杆、资产配置进行灵活调整，力争提升产品业绩表现并努力控制产品净值回撤。

（二）非标资产投资情况

无

（三）关联交易情况

本产品于2024年1月1日至2024年6月30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	112404004	24 中国银行 CD004	43,526	4,259,376.47
中国银行股份有限公司	112404029	24 中国银行 CD029	870,528	85,750,761.12
中银国际证券股份有限公司	262298	工瑞 8A1	9,016	901,626.75

本产品于 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	082101446	21 西电电力 ABN001 优先	500,000	49,625,070.71
中国银行股份有限公司	082480054	24 晋租 1 号 ABN001 优先 (绿色)	76,571	7,657,102.40
中国银行股份有限公司	082480075	24 同煤漳泽 ABN001 优先	40,719	4,071,866.70
中国银行股份有限公司	082480307	24 澄熙 ABN006 优先	10,857	1,085,757.80
中国银行股份有限公司	082480316	24 星澜 ABN002 优先	11,455	1,145,675.49
中国银行股份有限公司	082480333	24 澄熙 ABN009 优先	12,022	1,202,395.25
中国银行股份有限公司	082480400	24 中建新疆 2ABN001 优先(乡村振兴)	5,068	506,948.08
中国银行股份有限公司	091900029	19 东方二级资本债 01BC	24,837	2,528,165.82
中国银行股份有限公司	091900029	19 东方二级资本债 01BC	73,515	7,501,492.93
中国银行股份有限公司	092280080	22 光大银行二级资本债 01A	47,917	5,013,472.21
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	30,357	3,184,800.60
中国银行股份有限公司	092280139	22 交行二级资本债 02A	13,551	1,404,675.53
中国银行股份有限公司	102100597	21 陕有色 MTN002	11,825	1,250,016.10
中国银行股份有限公司	102100780	21 中电国际 MTN001	19,413	2,009,229.82

中国银行股份有限公司	102380743	23 象屿 MTN001	26,004	2,733,850.70
中国银行股份有限公司	102380743	23 象屿 MTN001	45,264	4,754,019.51
中国银行股份有限公司	102400690	24 云能投 MTN007	59,405	5,940,474.00
中国银行股份有限公司	102480390	24 象屿 MTN001	21,457	2,160,326.75
中国银行股份有限公司	102480721	24 合高建设 MTN001	10,493	1,058,253.05
中国银行股份有限公司	102481117	24 光大环境 MTN001	13,500	1,358,178.25
中国银行股份有限公司	102481117	24 光大环境 MTN001	27,000	2,716,356.49
中国银行股份有限公司	102481117	24 光大环境 MTN001	40,501	4,074,534.74
中国银行股份有限公司	102481237	24 象屿 MTN002A	59,405	5,940,474.00
中国银行股份有限公司	102482130	24 青岛华通 MTN001	128,020	12,802,814.01
中国银行股份有限公司	1920059	19 江苏银行二 级	1,446	149,331.50
中国银行股份有限公司	1920059	19 江苏银行二 级	14,459	1,493,314.98
中国银行股份有限公司	1920059	19 江苏银行二 级	35,765	3,607,408.79
中国银行股份有限公司	1920059	19 江苏银行二 级	7,230	746,657.49
中国银行股份有限公司	1920091	19 南京银行二 级	17,883	1,810,006.22
中国银行股份有限公司	1920091	19 南京银行二 级	17,883	1,810,176.10
中国银行股份有限公司	1920091	19 南京银行二 级	35,715	3,610,014.52
中国银行股份有限公司	1928022	19 兴业银行二 级 01	89,405	9,006,272.62
中国银行股份有限公司	1928026	19 兴业银行二 级 02	17,881	1,802,565.80
中国银行股份有限公司	1928026	19 兴业银行二 级 02	35,762	3,605,606.02
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	1,400,000	143,425,587.13
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	12,762	1,321,729.96

中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	14,459	1,498,076.47
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	196,170	20,318,187.39
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	246,544	25,428,924.85
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	246,544	25,428,924.85
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	248,566	25,660,455.49
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	296,528	30,737,823.67
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	395,371	40,983,764.89
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	4,338	449,403.86
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	457,730	47,409,103.92
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	821,812	84,772,135.15
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	1,600,000	164,835,978.08
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	100,000	10,302,232.47
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	200,000	20,503,796.16
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	300,000	30,908,455.89
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	1,000,000	102,838,631.51
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	1,000,000	102,331,682.19
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	100,000	10,283,863.15
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	100,000	10,237,201.64
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	200,000	20,567,726.30
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	500,000	51,422,515.75
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	500,000	51,186,008.22
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	954	97,227.38

中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	100,000	10,133,269.59
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	203,912	20,923,679.50
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	248,566	25,403,035.29
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	400,000	40,533,078.36
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	475,794	48,821,918.83
中国银行股份有限公司	2020022	20 南京银行二级 01	100,000	10,413,846.72
中国银行股份有限公司	2020022	20 南京银行二级 01	23,603	2,394,449.83
中国银行股份有限公司	2020022	20 南京银行二级 01	35,722	3,614,911.63
中国银行股份有限公司	2020022	20 南京银行二级 01	35,765	3,618,885.84
中国银行股份有限公司	2020022	20 南京银行二级 01	35,765	3,614,440.22
中国银行股份有限公司	2020022	20 南京银行二级 01	500,000	52,069,233.61
中国银行股份有限公司	2020044	20 宁波银行二级	23,566	2,490,868.58
中国银行股份有限公司	2020044	20 宁波银行二级	25,549	2,683,482.32
中国银行股份有限公司	2023001	20 人民财险	1,500,000	151,957,904.79
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	109,831	11,471,050.04
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	118,536	12,378,555.73
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	122,525	12,786,887.36
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	200,000	20,212,081.64
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	300,000	30,315,182.47
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	6,471	656,007.31
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	64,372	6,725,959.46
中国银行股份有限公司	2023016	20 中财再保险	11,836	1,242,587.46

中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	1,000,000	101,409,983.56
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	1,500,000	156,648,766.44
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	135,985	14,264,839.51
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	142,244	14,550,834.08
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	200,000	20,491,479.45
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	246,544	25,030,414.29
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	331,422	33,649,979.89
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	400,000	40,973,459.73
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	600,000	61,027,868.22
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	700,000	71,113,334.66
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	795	83,337.74
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	80,449	8,154,300.73
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	82,181	8,334,223.12
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	828,555	84,124,910.00
中国银行股份有限公司	2028024	20 中信银行二级	100,000	10,407,002.60
中国银行股份有限公司	2028024	20 中信银行二级	200,000	20,814,005.21
中国银行股份有限公司	2028024	20 中信银行二级	23,800	2,496,181.91
中国银行股份有限公司	2028024	20 中信银行二级	900,000	93,663,023.42
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	1,000,000	106,513,558.90
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	19,413	2,055,351.13
中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永续债	133,196	13,963,675.51
中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永续债	410,906	43,149,833.60

中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	22,034	2,353,522.93
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	44,068	4,706,129.26
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永续债	65,018	7,013,869.93
中国银行股份有限公司	2128025	21 建设银行二级 01	200,000	20,725,032.33
中国银行股份有限公司	2128025	21 建设银行二级 01	300,000	31,087,548.49
中国银行股份有限公司	2292059	22 浙江债 62	1,000,000	103,810,313.66
中国银行股份有限公司	2305350	23 广东债 23	1,000,000	104,040,662.30
中国银行股份有限公司	231814	24 湖南 16	13,109	1,311,106.39
中国银行股份有限公司	231814	24 湖南 16	13,109	1,311,106.39
中国银行股份有限公司	231814	24 湖南 16	13,109	1,311,106.39
中国银行股份有限公司	232480014	24 交行二级资本债 01A	11,801	1,185,272.48
中国银行股份有限公司	232480014	24 交行二级资本债 01A	11,801	1,185,272.48
中国银行股份有限公司	232480014	24 交行二级资本债 01A	23,612	2,378,197.17
中国银行股份有限公司	2371263	23 重庆债 58	500,000	51,840,186.07
中国银行股份有限公司	2371363	23 山西债 63	100,000	10,234,327.98
中国银行股份有限公司	2405005	24 山东债 01	1,000,000	100,322,984.70
中国银行股份有限公司	2405005	24 山东债 01	200,000	20,067,756.94
中国银行股份有限公司	2405005	24 山东债 01	300,000	30,101,635.41
中国银行股份有限公司	2405005	24 山东债 01	500,000	50,165,913.11
中国银行股份有限公司	2405005	24 山东债 01	500,000	50,173,813.11
中国银行股份有限公司	2405005	24 山东债 01	500,000	50,161,492.35
中国银行股份有限公司	2420017	24 杭州银行小微债	79,861	7,987,539.20

中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	10,888	1,146,203.91
中国银行股份有限公司	UL536164	24 美团美月 ABN003 优先 A	34,942	3,494,376.49
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	13,342	1,365,991.12
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	33,587	3,429,048.82
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	293,564	30,526,618.36
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	500,000	52,114,786.89
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	1,000,000	104,598,417.81
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	100,000	10,460,699.32
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	100,000	10,460,730.55

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	108,788	11,303,307.77
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	165,711	17,292,098.10
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	248,566	25,938,147.14
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	323,586	33,724,060.02
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	500,000	52,316,621.92
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	500,000	52,316,621.92
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	700,000	73,228,316.58
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	82,855	8,646,049.05

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	900,000	94,146,124.93
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	1,000,000	103,985,541.10
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	1,100,000	114,274,908.90
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	1,975	203,562.49
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	100,000	10,388,168.90
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	200,000	20,696,280.00
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	21,673	2,250,559.68
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	23,671	2,461,454.08

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	32,355	3,358,697.86
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	400,000	41,442,087.67
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	400,000	41,704,145.21
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	400,000	41,555,032.33
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	400,000	41,554,512.33
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	42,630	4,428,287.56
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	49,421	5,137,936.89
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	52,046	5,406,670.59

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	800,000	82,785,120.00
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	100,000	10,503,274.52
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	100,000	10,142,617.67
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	12,942	1,315,023.62
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	196,671	20,092,645.91
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	6,471	657,511.81
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	81,591	8,531,534.44
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	900,000	91,959,078.08

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	1,000,000	101,317,534.25
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	11,836	1,205,091.21
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	19,350	1,964,513.54
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	2,000,000	202,945,002.74
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	23,671	2,410,182.42
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	246,544	24,943,004.14
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	25,884	2,631,413.92
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	32,509	3,306,888.11

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	331,422	33,559,315.55
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	410,906	41,590,661.36
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	497,133	50,338,973.34
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	500,000	50,748,505.48
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	575,268	58,206,038.15
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	583,438	59,350,894.42
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	700,000	70,881,003.70
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	745,699	75,513,463.34

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	80,449	8,145,861.63
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	82,855	8,390,384.82
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	100,000	10,464,105.48
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	100,000	10,463,075.48
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	100,000	10,468,208.90
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	164,362	17,108,352.81
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	200,000	20,832,591.78
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	200,000	20,841,439.18

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	246,544	25,652,412.49
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	300,000	31,270,378.77
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	300,000	31,404,646.44
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	300,000	31,404,646.44
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	400,000	41,868,741.92
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	400,000	41,458,043.84
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	500,000	51,568,908.22
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	500,000	52,335,927.40

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	700,000	72,914,071.23
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	800,000	83,349,194.52
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2028041	20 工商银行二级 01	42,582	4,468,515.81
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	10,119	1,085,184.19
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	20,238	2,170,368.37
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	43,345	4,643,707.79
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	9,406	1,009,197.41
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2228024	22 工商银行二级 03	79,861	8,298,095.37

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	232380036	23 工行二级资本债 02A	67,753	7,098,502.10
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	27,061	2,854,617.04
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242400004	24 邮储永续债 01	10,888	1,097,007.69
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242400004	24 邮储永续债 01	10,888	1,097,507.44
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242400004	24 邮储永续债 01	10,888	1,097,507.44
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242400007	24 中信银行永续债 01	67,501	6,717,031.41
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242400007	24 中信银行永续债 01	81,001	8,067,930.32
中银国际证券股份有限公司	1928006	19 工商银行二级 01	47,019	4,957,942.13
中银国际证券股份有限公司	1928011	19 工商银行二级 03	32,355	3,375,852.44
中银国际证券股份有限公司	1928014	19 华夏银行永续债	21,315	2,226,811.19

中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	500,000	52,245,126.03
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	500,000	52,116,604.79
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	500,000	52,245,126.03
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	821,812	85,617,582.38
中银国际证 券股份有限 公司	1928019	19 交通银行二 级 01	17,881	1,799,508.16
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	1,000,000	103,701,221.92
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	1,643,623	169,818,271.32
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	1,975	203,145.62
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	200,000	20,658,535.90
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	200,000	20,740,244.38
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	237,936	24,505,269.72
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	400,000	41,480,488.77
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	400,000	41,480,488.77
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	410,906	42,445,154.15

中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	500,000	51,646,339.73
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	792	81,489.27
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	1,400,000	144,186,914.79
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	1,975	202,548.36
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	100,000	10,231,902.88
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	135,941	14,059,302.37
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	200,000	20,463,805.75
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	328,725	33,858,642.49
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	410,906	42,337,205.80
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	414,277	42,709,967.81
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	500,000	51,162,864.38
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	792	81,249.68
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	82,855	8,541,993.57
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	100,000	10,221,049.34

中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	100,000	10,221,049.34
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	13,012	1,344,500.86
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	2,000,000	205,785,888.52
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	2,376	243,486.88
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	20,238	2,091,283.54
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	316,222	32,447,169.07
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	331,422	34,137,937.11
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	47,030	4,859,785.30
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	59,499	6,152,158.04
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	79,055	8,111,792.27
中银国际证 券股份有限 公司	2028013	20 农业银行二 级 01	100,000	10,320,935.41
中银国际证 券股份有限 公司	2028013	20 农业银行二 级 01	17,858	1,802,097.48
中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	100,000	10,343,034.93
中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	200,000	20,677,354.52

中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	23,603	2,387,383.16
中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	35,404	3,580,200.26
中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二 级	118,536	12,334,971.58
中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二 级	164,362	17,115,700.48
中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二 级	23,707	2,466,824.24
中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二 级	23,707	2,466,824.24
中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二 级	500,000	52,672,026.03
中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二 级	71,121	7,400,472.73
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	100,000	10,569,401.51
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	100,000	10,462,664.25
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	2,500,000	262,191,458.90
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	200,000	21,153,551.78
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	37,624	3,959,746.75
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	414,277	43,344,159.04

中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	600,000	62,725,610.96
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	9,406	989,936.69
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	900,000	94,088,416.44
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	11,892	1,252,876.65
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	11,892	1,252,876.65
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	38,287	4,025,626.62
中银国际证 券股份有限 公司	212480013	24 交行债 01	79,861	7,994,962.35
中银国际证 券股份有限 公司	232480011	24 农行二级资 本债 02A	11,800	1,179,553.68
中银国际证 券股份有限 公司	240137	23 吉高 03	25,835	2,699,212.71
中银国际证 券股份有限 公司	240951	24 建工 K2	141,179	14,117,941.80
中银国际证 券股份有限 公司	240951	24 建工 K2	220,431	22,108,783.75
中银国际证 券股份有限 公司	240981	24 中化 05	889,970	88,996,976.00
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	491,677	49,167,655.00
中银国际证 券股份有限 公司	254165	24 厦国 K1	2,455	245,538.00

本产品于 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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）
中银基金管理 有限公司	018581	中银纯债债券 D	11,855,360	13,530,522.69
中银基金管理 有限公司	018581	中银纯债债券 D	2,274,064	2,583,336.83

本产品于 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	54,913,909.54
产品托管费	中国银行股份有限公司	4,497,022.45
1 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	27,682,793.58
28 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	10,487,320.00
7 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	33,035,058.00
分销买入	中银国际证券股份有限公司	50,069,281.75
分销买入	中国银行股份有限公司	11,880,948.00
现券买入	中国银行股份有限公司	35,592,650.62

八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市，在国内经济处于新旧动能转换、高质量发展的背景下，预计债券市场仍将处于震荡下行区间。但当前利率绝对水平和相对利差水平已达到近年较低点位，后续可能波动加大，操作难度有所增加。投资策略方面，在波动水平增加的市场环境下，产品管理人将视机会调整投资组合的久期和杠杆，债券以票息策略为主，交易策略为辅，尽力提升组合业绩。做好风险对冲，提前做好各种情形下的流动性安排。

中银理财-（14天）最短持有期纯债理财产品

2024年半年度托管人报告

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-（14天）最短持有期纯债理财产品（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2024年半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08月08日

