中银理财-稳富(90 天持有期)02 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:中国工商银行股份有限公司 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 | GH14205 |
|-------------------|--------------------|
| 理财产品名称 | 中银理财-稳富(90 天持有期)02 |
| 全国银行业理财信息登记系统登记编码 | Z7001022000193 |
| 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 | 2022-11-10 |
| 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 |
|----------|-------------------|----------|----------------|-------------------|-----------------------|
| GH14205A | 16,778,542,215.96 | 1.053024 | 1.053024 | 17,668,213,612.58 | 1.52% |
| GH14205B | 8,449,754,578.33 | 1.053908 | 1.053908 | 8,905,270,431.51 | 1.54% |

(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

| 次立米則 | 穿透前金额 | 占全部产品总资 | 穿透后金额 | 占全部产品总资 |
|----------------|------------|---------|------------|---------|
| 。 资产类别 。 | (万元) | 产的比例 | (万元) | 产的比例 |
| 现金及银行存款 | 302,615.33 | 11.38% | 403,156.84 | 14.05% |

| 同业存单 | - | 0.00% | 212,628.27 | 7.41% |
|---------|--------------|--------|---|--------|
| 拆放同业及买入 | - | 0.00% | 5,501.18 | 0.19% |
| 返售 | | | ,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,, | |
| 债券 | - | 0.00% | 1,998,014.09 | 69.63% |
| 非标准化债权类 | | 0.00% | | 0.00% |
| 资产 | - | 0.0076 | - | 0.0070 |
| 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% | 250,340.34 | 8.72% |
| 私募基金 | - | 0.00% | - | 0.00% |
| 资产管理产品 | 2,355,732.81 | 88.62% | - | 0.00% |
| 合计 | 2,658,348.13 | 100% | 2,869,640.73 | 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 | 336,493.30 | 11.73% |
| 2 | 112403064: 24 农业银行 CD064 | 28,086.08 | 0.98% |
| 3 | 112409110: 24 浦发银行 CD110 | 28,071.76 | 0.98% |
| 4 | 112406080: 24 交通银行 CD080 | 28,066.04 | 0.98% |
| 5 | 180335: 工鑫 12A | 26,137.89 | 0.91% |
| 6 | 102281906: 22 晋能装备 MTN008(科创票据) | 21,560.54 | 0.75% |
| 7 | 000186: 华泰柏瑞季季红债券 A | 19,274.95 | 0.67% |
| 8 | 006797:嘉实中短债债券 A | 19,197.58 | 0.67% |
| 9 | 006436: 浦银中短债债券 A | 19,133.41 | 0.67% |
| 10 | 000141: 富国国有企业债债券 C | 19,108.79 | 0.67% |

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 | 工商银行托管专户一中银理财稳富 90 天持有期 02 |
|-----|----------------------------|
| 账号 | 1001252429200322924 |
| 开户行 | 中国工商银行股份有限公司上海市虹口支行 |

六、产品组合流动性风险分析

产品在报告期内所持有资产结构合理,持有合适比例的流动性资产,如大行 CD 和 1 年 内大行二级资本债,均可及时变现,同时产品端还有部分现金,均可满足客户赎回需求, 另外产品杠杆较低,风险较为可控。

七、本运作期主要操作回顾

(一) 主要投资策略及操作

该产品在 2024 年第二季度主要操作是加仓了 3-5 年信用债并且买入部分仓位纯债基金增强收益和杠杆,在信用债方面主要采取了轮动策略,即对各个信用品种一级买入二级卖出,赚取利率下行的收益。回顾二季度债券市场,收益率整体呈现出平稳下行的态势,尤其是短端表现更为稳定,9M的CD和1年的CD收益率纷纷下破2%,长端利率债在央行喊话的效应下波动较大,信用债整体表现优于利率债。

(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

| 美联方名称 | 证券代码 | 证券简称 | 报告期内买入证券 | |
|--------------|-----------|----------|----------|-----------|
| 大联刀石柳 | 近分10円 | 近分則你 | 数量(单位:张) | 总金额(单位:元) |

| 中国工商银 行股份有限 公司 | 112302053 | 23 工商银行 CD053 | 34,458 | 3,367,751.39 |
|----------------------|-----------|-------------------|---------|---------------|
| 中国工商银 行股份有限 公司 | 112402020 | 24 工商银行 CD020 | 59,445 | 5,925,329.07 |
| 中国工商银 行股份有限 公司 | 112402021 | 24 工商银行 CD021 | 59,445 | 5,925,329.07 |
| 中国工商银 行股份有限 公司 | 112402040 | 24 工商银行 CD040 | 34,458 | 3,411,650.46 |
| 中国工商银 行股份有限 公司 | 112402046 | 24 工商银行 CD046 | 59,445 | 5,853,324.24 |
| 中国工商银 行股份有限 公司 | 112402050 | 24 工商银行 CD050 | 59,445 | 5,852,016.45 |
| 中国工商银 行股份有限 公司 | 2128002 | 21 工商银行二 级 01 | 22,596 | 2,358,875.39 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 262532 | 24 核 1A2 | 2,027 | 202,689.50 |
| 中银消费金融有限公司 | 2422035 | 24 中银消费金 融债 02 | 190,491 | 19,049,147.20 |

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

| | 证券代码 | 证券简称 | 报告期 | 为买入证券 |
|-------|--------------|-------------------|----------|---------------|
| 大联刀石阶 | 业分 代码 | 近分則你 | 数量(单位:张) | 总金额(单位:元) |
| 中国工商银 | | 24 天津港 | | |
| 行股份有限 | 012481805 | SCP003(科创 | 393,575 | 39,357,524.80 |
| 公司 | | 票据) | | |
| 中国工商银 | | 24 湘高速 | | |
| 行股份有限 | 102481206 | MTN003 | 93,833 | 9,383,322.50 |
| 公司 | | WITNOOS | | |
| 中国工商银 | | 24 天津轨交 | | |
| 行股份有限 | 102481635 | 24 八年初文 MTN004 | 686,068 | 68,606,792.10 |
| 公司 | | WH I INOU4 | | |
| 中国工商银 | | 20 浦发银行永 | | |
| 行股份有限 | 2028051 | 20 佣及银门水 续债 | 2,468 | 255,847.56 |
| 公司 | | | | |

| | I | I | I | |
|-------|-----------|-----------------|---------|---------------|
| 中国工商银 | | 20 浦发银行永 | | |
| 行股份有限 | 2028051 | 续债 | 4,935 | 511,695.12 |
| 公司 | | 30 | | |
| 中国工商银 | | | | |
| 行股份有限 | | 24 相城城建 | | |
| 公司,中国 | 102481279 | MTN003 | 31,471 | 3,147,070.70 |
| 银行股份有 | | WIIIVOOS | | |
| 限公司 | | | | |
| 中国工商银 | | | | |
| 行股份有限 | | 19 平安银行永 | | |
| 公司,中国 | 1928038 | | 158,270 | 16,129,095.30 |
| 银行股份有 | | ── | | |
| 限公司 | | | | |
| 中国工商银 | | | | |
| 行股份有限 | | 20 1/ 1/19/21 3 | | |
| 公司,中国 | 2028037 | 20 光大银行永 | 1,234 | 127,218.28 |
| 银行股份有 | | 续债 | | |
| 限公司 | | | | |
| 中国工商银 | | | | |
| 行股份有限 | | 24 W. H. 60 47 | | |
| 公司,中国 | 232480020 | 24 兴业银行二 | 11,877 | 1,187,667.50 |
| 银行股份有 | | 级资本债 01 | | |
| 限公司 | | | | |
| 中国工商银 | | | | |
| 行股份有限 | | 24 W. H. 60 47 | | |
| 公司,中国 | 232480020 | 24 兴业银行二 | 5,775 | 577,502.80 |
| 银行股份有 | | 级资本债 01 | | |
| 限公司 | | | | |
| 中国工商银 | | | | |
| 行股份有限 | | | | |
| 公司,中国 | 232480020 | 24 兴业银行二 | 99,496 | 9,949,634.60 |
| 银行股份有 | | 级资本债 01 | , | |
| 限公司 | | | | |
| 中国工商银 | | | | |
| 行股份有限 | | | | |
| 公司,中国 | 242400005 | 24 农行永续债 | 89,342 | 8,936,232.69 |
| 银行股份有 | | 01 | ĺ | , , |
| 限公司 | | | | |
| 中国工商银 | | | | |
| 行股份有限 | | | | |
| 公司,中国 | 242400009 | 24 农行永续债 | 103,997 | 10,399,724.00 |
| 银行股份有 | | 02 | ,, | ,,. |
| 限公司 | | | | |
| INA | l | | | |

| 中国工商银 行股份有限 公司,中国 银行股份有 限公司 | 242400009 | 24 农行永续债 02 | 25,144 | 2,514,354.00 |
|---|-----------|--------------------|---------|---------------|
| 中国工商银 行股份有限 公司,中国 银行股份有 限公司 | 242400009 | 24 农行永续债 | 491,861 | 49,186,100.50 |
| 中国工商银 行股份有限 公司,中国 银行股份有 限公司 | 242480005 | 24 杭州银行永 续债 01 | 6,861 | 686,135.20 |
| 中国工商银 行股份有限 公司,中国 银行股份有 限公司 | 282400001 | 24 太保寿险永 续债 01 | 18,745 | 1,874,472.80 |
| 中国工商银 行股份有限 公司,中国 银行股份有 限公司 | 282400001 | 24 太保寿险永 续债 01 | 387,155 | 38,715,472.40 |
| 中国工商银 行股份有限 公司,中国 银行股份有 限公司 | 292480007 | 24 加拿大银行 债 01BC | 343,948 | 34,394,770.40 |
| 中国工商银 行股份有限 公司,中国 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 | 1928013 | 19 民生银行永续债 | 158,270 | 16,453,139.76 |

| 中国工商银 行股份 中国 银行股份 中国 银行股份 中国 银行股 司, 中银国际证券 股份有限公司 | 1928013 | 19 民生银行永续债 | 395,675 | 41,132,849.41 |
|--|---------|----------------|---------|---------------|
| 中国工商银行股份 中国工商银公司,中国工商银公司,中国银行股份司,股份司限公司际证银国际证券股份有限公司 | 1928013 | 19 民生银行永续债 | 395,675 | 41,194,180.17 |
| 中国工商银 行股份 中国工商银 公司,中国不 银行股份 中国 银行股 司,中 银国际证券 股份有限公司 | 1928013 | 19 民生银行永续债 | 791,351 | 82,352,462.29 |
| 中国工商银行股份有限公司,中国保行股份有限。 中银行股份有限。 中银国际证券股份有限公司,可以 | 2028006 | 20 邮储银行永 续债 | 237,405 | 24,840,583.04 |
| 中国工商银行股份有限公司,中国份价有限公司,中银公司,中银公司,中银国际证券股份有限公司 | 2028006 | 20 邮储银行永 续债 | 237,405 | 24,839,324.79 |

| 中国工商银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国所证券股份有限公司,中银国所证券股份有限公司,中银国所证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中国国际行股份有限公司,中国国际行股份有限公司,并将第124年第124年第124年第124年第124年第124年第124年第124年 | | I | I | | |
|--|-------|---------|------------|---------|---|
| 公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司。2028017 | 中国工商银 | | | | |
| 银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国际证券股份有限公司。2028017 | 行股份有限 | | | | |
| 限公司,中 银国际证券 股份有限公司,中国 银行股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国国际证券 | 公司,中国 | | | | |
| 限公司, 中 银国际证券 股份有限公司, 中国 银行股份有限公司, 中国工商银 行股份有限公司, 中国工商银 行股份有限公司, 中国银石市联合司。 中国工商银 行股份有限公司,中 银国际证券 股份有限公司,中 银国际证券 股份有限公司,中国工商银 行股份有限公司,中国工商银 行股份有限公司,中国工商银 行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国工商银 行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国工商银 行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国工商银 行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国国银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国国际证券 股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行政份有限公司,中国银行政份有限公司,中国银行政份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国银行政份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,由于国际证券保险公司,由于国际证券保险公司,由于国际证券公司,由于国际证债证债金司,由于国际证券公司,由于国际证券公司,由于国际证券公司,由于国际证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债证债 | 银行股份有 | 2020006 | 20 邮储银行永 | 204.020 | 20.004.460.15 |
| 股份有限公司 中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国国市银行股份有限公司,中国国市银行股份有限公司,中国国市银行股份有限公司,中国国市银行股份有限公司,中国国市银行股份有限公司,中国国市银行股份有限公司,中国国市银行股份有限公司,中国国市银行股份有限公司,中国国市银行股份有限公司,中国国市银行股份有限公司,中国国市银行股份有限公司,中国国市银行股份有限公司,中国国市银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国银行政份有限公司,中国银行政份有限公司,中国银行政份有限公司,中国银行政份有限公司,中国银行政份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国公司和公司,中国公司和公司和公司和公司和公司和公司和公司和公司和公司和公司和公司和公司和公司和公 | 限公司,中 | 2028006 | 续债 | 294,029 | 29,884,468.15 |
| 中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银河股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行政份有限公司,中国银行政份有限公司,中国银际证券股份有限公司,中国银际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国银际证券股份有限公司,中国银际证券股份有限公司,中国银际证券股份有限公司,中国银际证券股份有限公司,中国银际证券保险公司,中国国际证券保险公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券保险公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,101,306,718.82 | 银国际证券 | | | | |
| 中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银河股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国国商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行政份有限公司,中国银行政份有限公司,中国银际证券股份有限公司,中国银际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国银际证券股份有限公司,中国银际证券股份有限公司,中国银际证券股份有限公司,中国银际证券股份有限公司,中国银际证券保险公司,中国国际证券保险公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券保险公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,101,306,718.82 | 股份有限公 | | | | |
| 行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银际证券股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银际证券股份有限公司,中国银际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国银行股份和银行股份有限公司,中国银行股份和银行股份和银行股份有限公司,中国银行股份和银行股份和银行股份和银行股份和银行股份和银行股份和银行股份和银行股份和 | 司 | | | | |
| 行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银际证券股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国银行股份有限公司,中国国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国银行股份和公司,中国银行股份和公司,中国银行股份和公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份和公司,由国国国的公司,由国国公司,由国国的公司,由国国国的公司,由国国国的公司,由国国国的公司,由国国国的公司,由国国国的公司,由国国国的公司,由国国国的公司,由国国国的公司,由国国国的公司,由国国国的公司,由国国国国的公司,由国国国国国的公司,由国国国国国国国国国国国国国国国国国国国国国国国国国国国国国国国国国国国国 | 中国工商银 | | | | |
| 公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份和公司,由于100元,100元,100元,100元,100元,100元,100元,100元 | 1 | | | | |
| 银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司。2028017 | | | | | |
| 限公司,中银国际证券股份有限公司 2028006 续债 994,963 101,306,718.82 中国工商银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司 2028017 20 农业银行永续债 01 1,234 124,908.58 中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司 2028017 20 农业银行永续债 01 4,937 499,255.27 | | | 20 邮储银行永 | | |
| 根国际证券 股份有限公司 | | 2028006 | | 994,963 | 101,306,718.82 |
| 股份有限公司 中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司 2028017 中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中银国际证券股份有限公 20 农业银行永续债 01 | | | 安 顶 | | |
| 中国工商银 | | | | | |
| 中国工商银 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,中国工商银 行股份有限公司,中国工商银 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,中银国际证券 股份有限公司,中国工商银 行股份有限公司,中国工商银 行股份有限公司,中国工商银 行股份有限公司,中国国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券 股份有限公 | | | | | |
| 行股份有限 公司,中国 银行股份有限 保公司,中国 国际证券 股份有限公司 コー 中国工商银行股份有限 公司,中国 银行股份有限 公司,中国 银行股份有限 公司,中国 银行股份有限公司 コー 中国工商银行股份有限公司 コー 中国工商银行股份有限公司 コー 中国工商银行股份有限公司,中国 银行股份有限公司,中国 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 | | | | | |
| 公司,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 1,234 124,908.58 中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司 2028017 20 农业银行永续债 01 2,468 249,908.97 中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公 20028017 20 农业银行永续债 01 4,937 499,255.27 | 1 | | | | |
| 银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券股份有限公司,中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国国际证券股份有限公 | | | | | |
| 限公司,中银国际证券股份有限公司 2028017 续债 01 1,234 124,908.58 股份有限公司 中国工商银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司 20 农业银行永续债 01 2,468 249,908.97 中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公 20 农业银行永续债 01 4,937 499,255.27 | | | 20 枕地组织表 | | |
| 根国际证券 股份有限公司 中国工商银 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,中国 银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券 股份有限公司,中银国际证券 | | 2028017 | | 1,234 | 124,908.58 |
| 股份有限公司 中国工商银行股份有限公司,中国银际证券股份有限公司 2028017 中国工商银行股份有限公司 2028017 中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公 2028017 20 农业银行永续债 01 4,937 4,937 499,255.27 | | | | | |
| 司 | | | | | |
| 中国工商银 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 中国工商银 行股份有限 公司,中国 银行股份有限 公司,中国 银行股份有限 公司,中国银行股份有限 公司,中国银行股份有限公司,中 银国际证券 股份有限公 | | | | | |
| 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 2028017 20 农业银行永续债 01 2,468 249,908.97 中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公 20 农业银行永续债 01 4,937 499,255.27 | | | | | |
| 公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司202801720 农业银行永续债 012,468249,908.97中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公20 农业银行永续债 014,937499,255.27 | | | | | |
| 银行股份有 限公司,中 银国际证券 股份有限公司202801720 农业银行永 续债 012,468249,908.97中国工商银 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20 农业银行永 续债 014,937499,255.27 | | | | | |
| 限公司,中银国际证券股份有限公司 (499,255.27) 中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公 (2028017) (499,255.27) | | | | | |
| 限公司, 中 续债 01 银国际证券 股份有限公司 中国工商银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司, 中银国际证券 20 农业银行永续债 01 投份有限公司, 中银国际证券 2028017 | | 2028017 | | 2.468 | 249.908.97 |
| 股份有限公司 中国工商银 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 | | | 续债 01 | , | ,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,, |
| 司 中国工商银 行股份有限 公司,中国 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 | | | | | |
| 中国工商银 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 | 股份有限公 | | | | |
| 行股份有限 公司,中国 银行股份有 R 2028017 | | | | | |
| 公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司 | 中国工商银 | | | | |
| 银行股份有 限公司,中 银国际证券 股份有限公 | 行股份有限 | | | | |
| 限公司,中 2028017 续债 01 银国际证券 股份有限公 | 公司,中国 | | | | |
| 限公司,中 续债 01 银国际证券 股份有限公 | 银行股份有 | 2029017 | 20 农业银行永 | 4 027 | 400 255 27 |
| 股份有限公 | 限公司,中 | 2028017 | 续债 01 | 4,937 | 4 77,433.4 <i>1</i> |
| | 银国际证券 | | | | |
| 司 | 股份有限公 | | | | |
| | 司 | | | | |

| 中国工商银 行股份有限 公司,中国银行股份有 限公司,中银公司,中银国际证券 股份有限公司 | 2028017 | 20 农业银行永 续债 01 | 6,171 | 623,982.59 |
|---|-----------|-------------------|---------|---------------|
| 中国工商银 行股份有限 公司,中国 银行股份有 限公司,中 银口,中 银国际证券 股份有限公司 | 2028017 | 20 农业银行永 续债 01 | 9,871 | 1,000,375.47 |
| 中国工商银 行股份有限 公司,中国工商银 公司,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 | 2,468 | 253,570.95 |
| 中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司,可 | 242400004 | 24 邮储永续债 01 | 178,685 | 17,868,456.00 |
| 中国工商银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司 | 242400007 | 24 中信银行永 续债 01 | 103,105 | 10,310,467.00 |

| 中国工商银 | | | | |
|--------|-----------|----------|-----------|----------------|
| 行股份有限 | | | | |
| 公司,中国 | | | | |
| 银行股份有 | 242400007 | 24 中信银行永 | 14,571 | 1,457,111.60 |
| 限公司,中 | 212100007 | 续债 01 | 11,571 | 1,137,111.00 |
| 银国际证券 | | | | |
| 股份有限公 | | | | |
| 司 | | | | |
| 中国工商银 | | | | |
| 行股份有限 | | | | |
| 公司,中国 | | | | |
| 银行股份有 | | 24 中信银行永 | 400 404 | 40.040.400.00 |
| 限公司,中 | 242400007 | 续债 01 | 498,424 | 49,842,422.00 |
| 银国际证券 | | | | |
| 股份有限公 | | | | |
| 司 | | | | |
| 中国工商银 | | | | |
| 行股份有限 | | | | |
| 公司,中国 | | | | |
| 银行股份有 | | 24 中信银行永 | | |
| 限公司,中 | 242400007 | 续债 01 | 53,529 | 5,352,906.50 |
| 银国际证券 | | 之版 01 | | |
| 股份有限公 | | | | |
| 司 | | | | |
| 中国工商银 | | | | |
| 行股份有限 | | | | |
| 公司,中国 | | | | |
| | | 24 交银金租绿 | | |
| 银行股份有 | 262400001 | | 95,246 | 9,524,573.60 |
| 限公司,中 | | 债 01 | | |
| 银国际证券 | | | | |
| 股份有限公 | | | | |
| 司 | | | | |
| 中国工商银 | | | | |
| 行股份有限 | | 19 交通银行永 | | |
| 公司,中银 | 1928025 | 续债 | 1,582,701 | 162,580,532.78 |
| 国际证券股 | | 人 IX | | |
| 份有限公司 | | | | |
| 中国工商银 | | | | |
| 行股份有限 | | 20 昆火组织一 | | |
| 公司,中银 | 2028022 | 20 民生银行二 | 79,135 | 8,211,813.47 |
| 国际证券股 | | 级 | | |
| 份有限公司 | | | | |
| 中国银行股 | | 24 临空港投 | | |
| 份有限公司 | 012481215 | SCP001 | 37,533 | 3,753,329.00 |
| MININA | <u> </u> | 201001 | | |

| 4. 日 . 日. 仁 田 | <u> </u> | 0.4 1.)4n = 14n | | 1 |
|----------------------|-----------|----------------------|---------|---------------|
| 中国银行股 份有限公司 | 012481347 | 24 太湖国投 SCP001 | 98,010 | 9,800,970.30 |
| 中国银行股 份有限公司 | 012481363 | 24 吴中经发 SCP007 | 98,083 | 9,808,333.40 |
| 中国银行股份有限公司 | 032400569 | 24 淮安城资 | 12,837 | 1,283,665.70 |
| 中国银行股 | 032480668 | PPN001 24 许昌投资 | 19,417 | 1,941,741.60 |
| 份有限公司 中国银行股 | 082480075 | PPN003 24 同煤漳泽 | 79,135 | 7,913,507.20 |
| 份有限公司 中国银行股 | | ABN001 优先 24 广能莱州 | , | |
| 份有限公司 中国银行股 | 082480415 | ABN001 优先 24 铁物资 | 1,715 | 171,533.80 |
| 份有限公司 | 102400809 | MTN001 | 190,491 | 19,049,147.20 |
| 中国银行股 份有限公司 | 102480045 | 24 光大水务 MTN001 | 12,484 | 1,248,395.30 |
| 中国银行股 份有限公司 | 102480337 | 24 邯郸交投 MTN001 | 114,077 | 11,407,664.00 |
| 中国银行股 份有限公司 | 102480559 | 24 中建投资 MTN001 | 119,264 | 11,926,418.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102480753 | 24 沈阳地铁 MTN002 | 25,577 | 2,557,650.80 |
| 中国银行股份有限公司 | 102480868 | 24 河南资产 MTN001 | 2,978 | 297,829.47 |
| 中国银行股 | 102480985 | 24 兴业资产 | 3,147 | 314,671.10 |
| 份有限公司 中国银行股 | 102481024 | MTN001 24 扬州经开 | 3,147 | 314,671.10 |
| 份有限公司 中国银行股 | 102481215 | MTN001 24 保利发展 | 256,936 | 25,693,564.50 |
| 份有限公司 中国银行股 | 102481319 | MTN003 24 苏新国资 | | |
| 份有限公司 中国银行股 | | MTN007 24 厦国贸控 | 62,027 | 6,202,725.80 |
| 份有限公司 中国银行股 | 102481323 | MTN005 24 中飞租赁 | 16,392 | 1,639,151.70 |
| 份有限公司 | 102481402 | MTN001A | 63,159 | 6,315,878.70 |
| 中国银行股 份有限公司 | 102481495 | 24 沪国际 MTN001 | 99,222 | 9,922,232.30 |
| 中国银行股 份有限公司 | 102481663 | 24 东方国际 MTN001 | 13,468 | 1,346,769.20 |
| 中国银行股 份有限公司 | 102481759 | 24 云建投 MTN009 | 94,712 | 9,471,225.40 |
| 中国银行股份有限公司 | 102481841 | 24 厦国贸控 MTN007 | 66,429 | 6,642,945.60 |
| MHMAN | | 17111100/ | | 12 |

| 1 = 7 = 7 = 8 | | | | |
|----------------|-----------|-----------------------------|-----------|----------------|
| 中国银行股 份有限公司 | 102481903 | 24 山东海洋 MTN001 | 117,231 | 11,723,055.60 |
| 中国银行股 份有限公司 | 102481975 | 24 津城建 MTN019A | 696,474 | 69,647,442.20 |
| 中国银行股份有限公司 | 102481976 | 24 津城建 MTN019B | 795,971 | 79,597,076.80 |
| 中国银行股 | 102482024 | 24 鲁高速 | 54,802 | 5,480,217.00 |
| 份有限公司 中国银行股 | 102482061 | MTN005 24 山西文旅 | 11,230 | 1,123,001.00 |
| 份有限公司 中国银行股 | 102482061 | MTN006 24 山西文旅 | 32,881 | 3,288,130.20 |
| 份有限公司 中国银行股 | | MTN006 24 青岛华通 | | |
| 份有限公司 中国银行股 | 102482130 | MTN001 24 巴斯夫 | 10,643 | 1,064,383.68 |
| 份有限公司 | 102482183 | MTN001BC 24 电建市政 | 263,902 | 26,390,227.80 |
| 中国银行股 份有限公司 | 102482262 | 24 电延用政 MTN001(科创 票据) | 483,943 | 48,394,340.50 |
| 中国银行股 份有限公司 | 102482273 | 24 厦国贸控 MTN008 | 40,822 | 4,082,174.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 102482300 | 24 湘建工 MTN002(科创 票据) | 9,372 | 937,236.40 |
| 中国银行股 份有限公司 | 102482363 | 24 云建投 MTN012 | 761,072 | 76,107,189.60 |
| 中国银行股 份有限公司 | 102482384 | 24 拜耳 MTN001BC | 952,457 | 95,245,736.00 |
| 中国银行股 份有限公司 | 102482413 | 24 中陕核工 MTN001 | 3,819 | 381,864.00 |
| 中国银行股 份有限公司 | 102482743 | 24 广州控股 MTN002B | 476,229 | 47,622,868.00 |
| 中国银行股 份有限公司 | 132480056 | 24 河钢集 GN005 | 8,108 | 810,758.00 |
| 中国银行股份有限公司 | 1920076 | 19 徽商银行永 续债 | 395,675 | 40,695,784.62 |
| 中国银行股份有限公司 | 1928031 | 19 广发银行永续债 | 1,582,701 | 163,056,007.68 |
| 中国银行股份有限公司 | 1928031 | 19 广发银行永续债 | 3,956,754 | 407,418,213.33 |
| 中国银行股份有限公司 | 212480009 | 24 上海银行债 | 99,222 | 9,922,232.30 |
| 中国银行股 | 2420029 | 24 威海银行小 | 19,417 | 1,941,741.60 |
| 份有限公司 | | 微债 | | 13 |

| 中国银行股 份有限公司 | 2422005 | 24 农银金租债 01 | 23,853 | 2,385,283.60 |
|---|---------|--------------------------|---------|---------------|
| 中国银行股份有限公司 | 2422029 | 24 民生租赁货 运物流主题债 01 | 990,309 | 99,030,852.00 |
| 中国银行股 份有限公司 | 2422036 | 24 兴业消费金 融债 04 | 476,229 | 47,622,868.00 |
| 中国银行股 份有限公 司,中银国 际证券股份 有限公司 | 2128002 | 21 工商银行二 级 01 | 22,596 | 2,358,875.39 |
| 中国银行股 份有限公 司,中银国 际证券股份 有限公司 | 2422035 | 24 中银消费金 融债 02 | 190,491 | 19,049,147.20 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2028023 | 20 招商银行永 续债 01 | 14,067 | 1,478,452.75 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2028023 | 20 招商银行永 续债 01 | 2,468 | 251,740.80 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2028023 | 20 招商银行永 续债 01 | 28,133 | 2,956,905.51 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2028023 | 20 招商银行永 续债 01 | 3,701 | 377,427.74 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2028023 | 20 招商银行永 续债 01 | 3,701 | 377,427.74 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2028023 | 20 招商银行永 续债 01 | 3,702 | 377,775.71 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2028023 | 20 招商银行永 续债 01 | 4,936 | 503,502.34 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2028023 | 20 招商银行永 续债 01 | 549,690 | 57,654,207.73 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2028023 | 20 招商银行永 续债 01 | 56,490 | 5,944,984.28 |

| 中银国际证 券股份有限 公司 | 2028033 | 20 建设银行二级 | 33,894 | 3,569,653.67 |
|----------------------|-----------|---------------------|-----------|----------------|
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 212480015 | 24 天津银行债 01 | 952,457 | 95,245,736.00 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 232400013 | 24 渤海银行二 级资本债 01 | 2,942,500 | 294,250,002.00 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 242480004 | 24 华夏银行永 续债 01 | 24,417 | 2,441,735.50 |
| 中银国际证 券股份有限 公司 | 242480004 | 24 华夏银行永 续债 01 | 51,752 | 5,175,218.00 |

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

| 学 | 资产管理 | 资产管理产品 | 报告期内买入资产管理产品 | |
|----------------------|--------|-------------|--------------|--------------|
| 关联方名称 | 产品代码 | 筒称 | 数量(单位:份) | 总金额(单位:元) |
| 工银瑞信基 金管理有限 公司 | 000716 | 工银薪金货币 B | 3,123,534 | 3,123,533.50 |

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) |
|------|--------------|------------------|
| 分销买入 | 中国银行股份有限公司 | 1,055,207,180.14 |
| 分销买入 | 中银国际证券股份有限公司 | 103,065,379.00 |
| 分销买入 | 中国工商银行股份有限公司 | 11,705,340.69 |
| 现券买入 | 中国银行股份有限公司 | 15,301,938.15 |
| 现券卖出 | 工银瑞信基金管理有限公司 | 1,064,519.16 |

八、后市展望及下阶段投资策略

综合来看,短期来看,央行对长端利率的控制己箭在弦上,10Y国债或将逐步回到央

行的合意区间。长期来看,当前就业、收入增长预期、地产等一系列问题催生的需求不足,对于政策合力的要求极高,政策奏效和信心的扭转之间也可能存在摩擦。政策组合拳中,切实降低实际利率水平的货币政策将是重要一环,短期内比价效应也是债券市场最基本的反应路径,基本面环境对债市仍然有利。

中银理财-稳富(90天持有期)02 2024年半年度托管报告

(报告期间: 2024年01月01日-2024年6月30日)

本托管人依据中银理财有限责任公司与我行签署的《中银理财理财产品托管协议》履行托管人责任,现将本报告期间托管情况报告如下:

- 一、本托管人在报告期间,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在损害资产委托人利益的行为。
- (一)本托管人以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责,安全保管托管 专户内委托资产;非依法律规定、行政法规或托管协议约定,不得擅自动用或处 分托管资产;
- (二)根据托管协议约定,执行管理人划款指令,办理托管专户项下资金往来;
- (三)根据《托管协议》约定,对资产管理人运用投资组合资产进行投资的 行为进行了监督;
- (四)为投资组合单独设立托管专户,与自有账户以及所托管的其他非本投资组合的托管专户分别保管,实行了严格的分账管理,维护投资组合资产的独立性。
- 二、本计划托管人复核了管理人编制的《中银理财-稳富(90天持有期)02 2024年半年度投资运作情况报告》中最后一个交易日的产品总份额、份额净值, 核对无误。

