

# 中银理财-（9 个月）最短持有期纯债理财产品 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	CYQ9M
理财产品名称	中银理财-（9个月）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	Z7001022000512
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	2022-10-13
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
CYQ9MA	5,652,612,907.92	1.044887	1.044887	5,906,341,945.30	4.65%
CYQ9MB	8,334,080,532.73	1.046180	1.046180	8,718,950,690.99	4.76%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：112.69%

### 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	25,001.60	1.71%	31,425.59	1.93%
同业存单	-	0.00%	154,251.70	9.48%
拆放同业及买入 返售	40,000.00	2.73%	40,000.00	2.46%
债券	84,855.17	5.80%	1,381,464.71	84.94%
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%	19,249.61	1.18%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	1,312,932.28	89.76%	-	0.00%
合计	1,462,789.05	100%	1,626,391.61	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	019709: 23 国债 16	79,836.56	4.91%
2	1928018: 19 工商银行永续债	47,872.73	2.94%
3	TRADE_6755569: 交易所逆回购	40,000.00	2.46%
4	CNY: 现金及银行存款	31,425.59	1.93%
5	1928021: 19 农业银行永续债 01	27,864.42	1.71%
6	1928023: 19 农业银行永续债 02	27,031.21	1.66%
7	1928025: 19 交通银行永续债	19,692.95	1.21%
8	2028006: 20 邮储银行永续债	19,434.17	1.19%
9	149360: 21 中证 C1	16,379.22	1.01%

10	102381770: 23 中电投 MTN027(能源保供特别债)	16,182.75	1.00%
----	-----------------------------------	-----------	-------

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（9 个月最短持有期纯债）
账号	773176273700
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

产品报告期内，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。产品融资渠道畅通多元，风险总体可控。

## 七、本运作期主要操作回顾

### （一） 主要投资策略及操作

2023 年经济基本面弱于预期，央行 3 月和 9 月降准，6 月和 8 月降息，推动债券收益率曲线平坦化下行。信用方面资产荒行情重现，信用利差大幅收窄。投资操作方面，产品管理人积极参与各类信用债券、资产证券化资产的配置、夯实产品票息收益，阶段性参与波段交易增厚组合净值，利用资金面相对宽松的条件，保持产品合适的杠杆率、在保障产品流动性安全的前提下获取杠杆套息收益。

### （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	260393	中恒 06A2	6,122	612,242.60

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	012383142	23 温州交运 SCP002	30,200	3,020,000.00
中国银行股份有限公司	012383142	23 温州交运 SCP002	78,118	7,835,947.66
中国银行股份有限公司	012383442	23 云建投 SCP019	37,600	3,760,000.00
中国银行股份有限公司	012384592	23 苏国信 SCP020	34,628	3,462,755.20
中国银行股份有限公司	032380214	23 常德城投 PPN003A	103,680	10,368,000.00
中国银行股份有限公司	042380569	23 云能投 CP012	56,400	5,640,000.00
中国银行股份有限公司	102300425	23 龙城发展 MTN002	81,120	8,112,000.00
中国银行股份有限公司	102300441	23 华能 MTN013	475,200	47,520,000.00
中国银行股份有限公司	102300486	23 华能 MTN015	21,070	2,107,000.00
中国银行股份有限公司	102300486	23 华能 MTN015	37,970	3,797,000.00
中国银行股份有限公司	102300486	23 华能 MTN015	74,790	7,479,000.00
中国银行股份有限公司	102381363	23 中化股 MTN001	25,400	2,540,202.65
中国银行股份有限公司	102381770	23 中电投 MTN027(能源保供特别债)	1,273,200	127,320,000.00
中国银行股份有限公司	102381824	23 南京交建 MTN001(混合型科创票据)	20,280	2,028,000.00
中国银行股份有限公司	102381892	23 武汉城建 MTN001	20,280	2,028,000.00

中国银行股份有限公司	102381960	23 深投控 MTN002	20,040	2,004,000.00
中国银行股份有限公司	102381966	23 华宝都鼎 MTN001	396,000	39,600,000.00
中国银行股份有限公司	102381991	23 川水电 MTN001	79,200	7,920,000.00
中国银行股份有限公司	102382006	23 供销 MTN002	158,400	15,840,000.00
中国银行股份有限公司	102382060	23 吉利汽车 MTN001	396,000	39,600,000.00
中国银行股份有限公司	102382092	23 大唐集 MTN009	237,600	23,760,000.00
中国银行股份有限公司	102382128	23 中铁十一 MTN002(科创 票据)	316,800	31,688,179.67
中国银行股份有限公司	102382270	23 贵州高速 MTN002	20,040	2,004,000.00
中国银行股份有限公司	102382355	23 美的置业 MTN004A	21,070	2,107,000.00
中国银行股份有限公司	102382418	23 光大控股 MTN002	42,140	4,214,000.00
中国银行股份有限公司	102382439	23 云能投 MTN002	373,950	37,400,670.56
中国银行股份有限公司	102382515	23 中建六局 MTN001(科创 票据)	21,070	2,107,000.00
中国银行股份有限公司	102382528	23 中交天航 MTN001(科创 票据)	149,580	14,958,000.00
中国银行股份有限公司	102382569	23 福瑞能源 MTN002(能源 保供特别债)	42,140	4,214,000.00
中国银行股份有限公司	102382592	23 龙岩汇金 MTN002	21,070	2,107,000.00
中国银行股份有限公司	102382701	23 沪电力 MTN001	113,763	11,376,302.50
中国银行股份有限公司	102382786	23 桂交投 MTN004	34,027	3,402,657.20
中国银行股份有限公司	102382904	23 北控集 MTN001	246,263	24,626,289.00
中国银行股份有限公司	102382953	23 北部湾投 MTN004	80,545	8,055,338.95
中国银行股份有限公司	102383017	23 新创建 MTN002BC	32,505	3,250,461.90

中国银行股份有限公司	102383017	23 新创建 MTN002BC	78,118	7,812,615.40
中国银行股份有限公司	102383067	23 先正达 MTN001	78,097	7,811,787.26
中国银行股份有限公司	102383134	23 中交天航 MTN003(科创 票据)	78,707	7,871,425.16
中国银行股份有限公司	102383250	23 闽建工 MTN003	161,741	16,175,861.99
中国银行股份有限公司	102383382	23 陕延油 MTN005A	163,308	16,330,832.20
中国银行股份有限公司	102383439	23 北部湾 MTN008	242,443	24,247,803.97
中国银行股份有限公司	132380060	23 三峡 GN001	60,120	6,012,000.00
中国银行股份有限公司	132380062	23 融和融资 GN005(乡村振 兴)	11,510	1,151,000.00
中国银行股份有限公司	132380062	23 融和融资 GN005(乡村振 兴)	20,040	2,004,000.00
中国银行股份有限公司	132380067	23 晋能电力 GN011(碳中和 债)	21,070	2,098,747.84
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	235,317	24,013,326.89
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	238,656	24,356,958.57
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	392,196	40,022,211.47
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	156,523	16,514,261.91
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	157,285	15,946,146.08
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	235,927	23,919,219.13
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永 续债 01	119,872	12,576,394.50
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永 续债 01	79,615	8,352,332.32
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永 续债 01	252,600	26,281,609.21
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永 续债	75,780	7,804,834.88

中国银行股份有限公司	2320036	23 海峡银行小微债 02	20,040	2,004,000.00
中国银行股份有限公司	2320041	23 南京银行 01	20,040	2,004,000.00
中国银行股份有限公司	2320044	23 湖南银行 01	79,200	7,920,000.00
中国银行股份有限公司	2322009	23 福特汽车债 01	79,200	7,920,000.00
中国银行股份有限公司	232380026	23 厦门国际二级资本债 01	10,140	1,014,000.00
中国银行股份有限公司	232380063	23 创兴银行二级资本债 01BC	42,140	4,214,000.00
中国银行股份有限公司	232380063	23 创兴银行二级资本债 01BC	74,790	7,479,000.00
中国银行股份有限公司	242300001	23 宁波银行永续债 01	40,560	4,056,000.00
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	163,411	16,341,091.00
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	1,495,800	149,580,000.00
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	113,910	11,391,000.00
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	210,700	21,070,000.00
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	69,500	6,950,000.00
中国银行股份有限公司	272380014	23 东方二级资本债 01BC	373,950	37,395,000.00
中国银行股份有限公司	272380014	23 东方二级资本债 01BC	63,210	6,321,000.00
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	102,686	10,268,596.80
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	242,611	24,263,415.15
中国银行股份有限公司	292380007	23 加拿大银行债 01BC	80,281	8,028,846.56
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	173,750	17,730,758.60

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	25,260	2,573,543.92
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	25,920	2,592,000.00
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	60,120	6,012,000.00
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	1,584,000	158,400,000.00
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	23,020	2,302,000.00
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	501,000	50,100,000.00
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	88,890	8,889,000.00
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	101,229	10,443,500.99

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	33,743	3,479,379.87
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	33,743	3,479,984.29
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	1,213,055	124,353,940.26
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	118,844	12,143,164.19
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	159,104	16,311,030.67
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	160,563	16,422,025.69
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	161,091	16,482,105.15
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	170,668	17,434,293.21

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	242,611	24,870,788.05
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	314,827	32,266,424.40
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	401,407	41,055,064.22
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	574,613	58,757,061.96
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	702,874	71,996,805.94
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	78,097	7,999,090.62
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	79,229	8,095,442.80
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	80,545	8,241,052.58

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	80,870	8,290,262.68
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	795,519	79,574,147.41
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	78,277	7,828,329.64
中银国际证 券股份有限 公司	115778	23 交租 Y1	712,800	71,280,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	1928004	19 农业银行二 级 02	190,980	19,591,510.79
中银国际证 券股份有限 公司	1928004	19 农业银行二 级 02	381,960	39,183,021.58
中银国际证 券股份有限 公司	1928009	19 农业银行二 级 04	173,764	17,890,631.82
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	156,523	15,987,357.54
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	161,091	16,445,216.68
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	234,784	23,981,036.31
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	235,208	24,035,342.17
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	238,656	24,412,645.12

中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	238,656	24,412,645.12
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	241,636	24,668,791.57
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	313,045	31,974,769.11
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	390,589	39,889,041.61
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	393,534	40,227,137.07
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	78,097	7,981,756.37
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	9,675	987,174.18
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	157,413	16,045,447.09
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	159,104	16,220,347.82
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	161,091	16,396,079.13
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	161,091	16,396,079.13
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	236,120	24,073,648.62
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	392,196	39,980,294.87
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	402,727	40,988,506.38

中银国际证券股份有限公司	1928023	19 农业银行永续债 02	79,552	8,112,665.51
中银国际证券股份有限公司	1928023	19 农业银行永续债 02	885,999	90,178,435.23
中银国际证券股份有限公司	1928025	19 交通银行永续债	159,104	16,204,972.00
中银国际证券股份有限公司	1928025	19 交通银行永续债	164,175	16,676,822.79
中银国际证券股份有限公司	1928025	19 交通银行永续债	234,784	23,882,433.62
中银国际证券股份有限公司	1928025	19 交通银行永续债	246,263	25,015,234.19
中银国际证券股份有限公司	1928025	19 交通银行永续债	3,870	393,244.90
中银国际证券股份有限公司	1928025	19 交通银行永续债	318,208	32,409,944.00
中银国际证券股份有限公司	1928025	19 交通银行永续债	328,351	33,358,415.28
中银国际证券股份有限公司	1928025	19 交通银行永续债	469,568	47,758,328.71

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	ZYLCZYQ202133	中银证券中国红-汇中 33 号集合资产管理计划	112,962,440	120,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202133	中银证券中国 红-汇中 33 号 集合资产管理 计划	122,387,498	130,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202133	中银证券中国 红-汇中 33 号 集合资产管理 计划	142,005,112	150,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202133	中银证券中国 红-汇中 33 号 集合资产管理 计划	189,501,611	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202133	中银证券中国 红-汇中 33 号 集合资产管理 计划	283,875,852	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202133	中银证券中国 红-汇中 33 号 集合资产管理 计划	46,891,119	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202133	中银证券中国 红-汇中 33 号 集合资产管理 计划	47,272,383	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202133	中银证券中国 红-汇中 33 号 集合资产管理 计划	66,319,280	70,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202133	中银证券中国 红-汇中 33 号 集合资产管理 计划	93,843,844	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	1,006,340	1,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	10,108,157	10,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	110,776,407	114,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	12,732,615	13,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	126,446,844	130,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	13,550,136	14,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	131,540,768	136,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	141,665,049	146,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	146,184,582	150,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	149,135,017	150,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	156,326,331	160,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	158,714,413	160,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	165,886,027	170,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	195,217,179	200,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	195,503,421	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	2,014,910	2,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	204,160,996	210,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	21,342,646	22,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	228,404,100	234,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	233,394,924	240,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	244,738,130	250,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	262,850,467	270,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	27,118,644	28,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	273,731,548	280,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	28,942,116	29,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	281,964,025	290,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	283,646,322	290,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	29,163,021	30,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	290,416,263	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	291,403,594	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	291,857,185	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	298,463,646	305,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	3,993,610	4,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	31,948,882	33,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	31,961,259	33,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	312,469,485	320,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	321,074,139	330,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	326,351,680	335,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	340,931,229	350,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	36,278,066	37,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	385,251,484	396,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	40,874,618	41,500,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	408,878,505	420,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	42,623,268	44,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	43,604,651	45,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	49,622,866	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	53,268,765	55,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	53,590,568	55,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	54,495,913	56,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	544,588,155	560,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	573,483,670	590,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	58,987,952	61,200,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	59,068,461	61,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	593,269,792	610,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	60,508,269	60,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	63,984,489	66,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	68,060,282	70,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	68,239,423	70,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	73,579,243	76,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	763,470,142	785,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	79,035,764	80,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	80,566,880	83,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	91,991,866	95,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220308	中银证券中国 红-汇中 49 号 集合资产管理 计划	97,247,885	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	14,189,016.97
产品托管费	中国银行股份有限公司	1,180,682.69
1 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	38,349,000.00
3 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	67,938,000.00
7 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	57,282,780.80
现券买入	中国银行股份有限公司	1,176,489,387.68
现券买入	中银国际证券股份有限公 司	175,239,700.64
现券卖出	中银国际证券股份有限公 司	46,161,726.02

## 八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市，美联储和欧洲央行可能开启降息周期，将有利于人民币汇率和跨境资金流动更加趋于稳定，国内货币政策降准降息空间将进一步打开。内需方面，随着三大工程的落地实施，国内房地产行业对经济拖累或将减弱，加之包括新能源、高技术装备制造等相关产业升级动能发力壮大，国内经济内生动能有望加强。预计 2024 年债券市场大体维持震荡格局，反转风险不大，随着市场避险情绪逐步平稳，股债跷跷板效应影响可能增加。债券投资方面以稳健为主，目前利率处于历史较低水平，需兼顾收益和流动性两个方面，择机配置性价比较高的固定收益资产，保持产品合理杠杆水平，控制产品久期风险。

## 中银理财-（9个月）最短持有期纯债理财产品

### 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-（9个月）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 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

