(ESG 优享)中银理财-(6 个月)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	CYQESG6M
理财产品名称	(ESG 优享)中银理财-(6个月)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	Z7001022000527
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	2022-10-26
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
CYQESG6MA	4,772,205,217.86	1.040473	1.040473	4,965,353,993.83	4.05%
CYQESG6MB	11,532,559,861.43	1.041687	1.041687	12,013,326,873.52	4.15%

(二) 截至报告期末,理财产品杠杆水平: 116.84%

三、理财产品持仓情况

冰分米山	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	8,468.85	0.50%	147,412.62	7.53%
同业存单	-	0.00%	24,604.99	1.26%
拆放同业及买入		0.00%	2 020 20	0.20%
返售	-	0.00%	3,929.30	0.20%
债券	170,115.23	10.02%	1,697,289.40	86.66%
非标准化债权类		0.000/		0.000/
资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	21,994.50	1.12%
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%	63,410.92	3.24%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	1,519,213.00	89.48%	-	0.00%
合计	1,697,797.07	100%	1,958,641.73	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	147,412.62	7.53%
2	020602: 23 贴债 64	46,701.36	2.38%
3	020604: 23 贴债 66	29,795.55	1.52%
4	092100012: 21 长城资本债 01BC	16,704.11	0.85%
5	1928021: 19 农业银行永续债 01	13,703.52	0.70%
6	240277: 23 兴业 Y1	10,388.78	0.53%
7	019660: 21 国债 12	10,024.24	0.51%
8	001710:安信新趋势 A	9,385.84	0.48%
9	102382184: 23 金融街 MTN005	9,344.04	0.48%
10	1928026: 19 兴业银行二级 02	8,791.50	0.45%

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(ESG 优享 6 个月最短持有期固收		
	增强)		
账号	752376327190		
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

本产品主要投资高评级、高流动性的银行间和交易所债券,保持中性配置,并根据市场行情和产品状况动态调整久期和杠杆。产品保持适度比例的存单、利率债和资本工具交易仓位,增强产品流动性。

七、本运作期主要操作回顾

(一) 主要投资策略及操作

2023 年全年产品保持 110%-120%的中性杠杆, 久期控制在 1.2-1.5 范围内, 以票息策略为主。产品把握城投平台化债机会, 积极配置有价值的信用债, 并配置部分存单、金融债以保持资产流动性。产品权益仓位控制在 1%-2%的较低水平, 主要是权益类资产全年下行压力较大。

(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		内买入证券
大妖刀石你	胚分刊門	正分 间你	数量(单位:张)	总金额(单位:元)

中银国际控	VC2(47405	BCHINA		
股有限公司	XS2647495 576	3.22667	9	58,997,371.31
放有限公司	3/6	09/29/26		
中银国际控	XS2650032	BCHINA		
股有限公司	738	5.48135	7	21,564,049.84
双有限公司		07/17/26		
中银国际控	XS2650037	BCHINA		
股有限公司	703	10.9972	9	52,962,296.26
双有限公司	703	01/22/26		
中银国际证				
券股份有限	199836	23 电建 2A	143,010	14,301,000.00
公司				

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

光型子 5 5	マギルカ マギをむ				内买入证券
关联方名称 	证券代码	证券简称	数量(单位:张)	总金额(单位:元)	
中国银行股	012381971	23 津城建	38,120	3,812,000.00	
份有限公司	012361971	SCP032	36,120	5,812,000.00	
中国银行股	012381971	23 津城建	58,350	5,835,000.00	
份有限公司	0123017/1	SCP032	36,330	3,633,000.00	
中国银行股	012381971	23 津城建	69,080	6,908,000.00	
份有限公司	0123619/1	SCP032	09,080	0,908,000.00	
 中国银行股		23 闽能源			
份有限公司	012382234	SCP002(碳资	48,180	4,818,000.00	
MARZE		产)			
中国银行股	012382241	23 津城建	68,100	6,810,000.00	
份有限公司	012362241	SCP037	00,100	0,810,000.00	
中国银行股	012382241	23 津城建	69,340	6,934,000.00	
份有限公司	012362241	SCP037	09,540	0,934,000.00	
中国银行股	012382268	23 荣盛	96,360	9,636,000.00	
份有限公司	012382208	SCP004	90,300	9,030,000.00	
中国银行股	012383206	23 临空港投	11,990	1,199,000.00	
份有限公司	012383200	SCP001	11,990	1,199,000.00	
 中国银行股		23 海南农垦			
份有限公司	012383280	SCP002(乡村	46,190	4,619,000.00	
		振兴)			
中国银行股	012384563	23 东泰投资	35,994	3,599,406.80	
份有限公司	012384363	SCP001	33,774	3,377,400.00	
中国银行股	012384563	23 东泰投资	98,362	9,836,232.80	
份有限公司		SCP001	70,302	7,030,232.00	
中国银行股	012294567	23 常德经建	25 004	2 500 406 90	
份有限公司	012384567	SCP003	35,994	3,599,406.80	

	1	Γ		1
中国银行股 份有限公司	032280151	22 昆交投 PPN001	49,562	4,944,290.24
中国银行股	032280293	22 南昌水投	173,350	17,682,260.97
份有限公司	032200273	PPN001	173,330	17,002,200.77
中国银行股	032380214	23 常德城投	4,270	427,000.00
份有限公司		PPN003A		,,
中国银行股	032380311	23 常德城投	8,540	854,000.00
份有限公司		PPN005	· -	
中国银行股	032380382	23 常德城投	23,220	2,322,000.00
份有限公司 中国银行股		PPN006 23 常德城投		
份有限公司	032380472	25 吊德城仅 PPN007	57,180	5,718,000.00
中国银行股		23 惠安交发		
份有限公司	032380684	PPN002	44,790	4,479,000.00
中国银行股		23 许昌投资		
份有限公司	032380779	PPN004	35,970	3,597,000.00
中国银行股	0.40000000	23 广西金控	120.160	12 01 (000 00
份有限公司	042380292	CP001	138,160	13,816,000.00
中国银行股	042380292	23 广西金控	76,240	7,624,000.00
份有限公司	042360292	CP001	70,240	7,024,000.00
中国银行股	042380442	23 广投金控	184,760	18,476,000.00
份有限公司	042300442	CP002	104,700	10,470,000.00
中国银行股	042380569	23 云能投	138,990	13,899,000.00
份有限公司		CP012		.,,
中国银行股	042380715	23 淄博城运	95,633	9,563,293.80
份有限公司		CP001		
中国银行股	042380725	23 淄博城运 CP002	227,594	22,759,417.50
份有限公司 中国银行股		23 晋租 1 号		
份有限公司	082380084	ABN001 优先	260	26,000.00
		23 山西建投		
中国银行股	082380312	1ABN002 优	96,360	9,636,000.00
份有限公司		先		
中国银行股	002200557	23 华能罗源	(22.77:	(2.202.644.12
份有限公司	082380667	ABN001 优先	632,774	63,283,644.19
中国银行股	082280667	23 华能罗源	61 675	6 162 105 12
份有限公司	082380667	ABN001 优先	64,625	6,462,485.12
中国银行股	082380681	23 沣盈 3 号	242,508	24,250,765.00
份有限公司	004300001	ABN001 优先	2 4 2,300	24,230,703.00
中国银行股		23 信达乾元		
份有限公司	082380804	ABN001 优先	455,188	45,518,835.00
		A1		
中国银行股	082380908	23 晋租 2 号	97,234	9,723,369.80
份有限公司		ABN002 优先	,	

	1	T T		1
中国银行股		23 京东东裕		
份有限公司	082380909	2ABN001 优	34,101	3,410,069.40
		先 A		
中国银行股	092100012	21 长城资本债	29,890	2,919,072.84
份有限公司	0,2100012	01BC	29,090	2,515,072.01
中国银行股	092100012	21 长城资本债	787,215	76,725,368.06
份有限公司	092100012	01BC	707,213	70,723,300.00
中国银行股	102002105	20 中粮置业	358,320	37,165,293.99
份有限公司	102002103	MTN001	338,320	37,103,293.99
中国银行股	102002105	20 中粮置业	493,110	51,108,341.37
份有限公司	102002103	MTN001	493,110	31,100,341.37
中国银行股	102102252	21 保定长城	104.250	10 110 005 55
份有限公司	102102253	MTN001	184,350	19,119,865.55
中国银行股	102200220	22 广核电力	272.050	27.076.257.72
份有限公司	102280320	MTN001	273,950	27,876,257.72
中国银行股	100001555	22 联发集	0.740	0.50.544.00
份有限公司	102281663	MTN002	8,540	850,741.93
		23 晋路桥		
中国银行股	102300394	MTN001(乡村	179,160	17,916,000.00
份有限公司	102300371	振兴)	,	
中国银行股		23 华能		
份有限公司	102300441	MTN013	193,350	19,335,000.00
中国银行股		23 华能		
份有限公司	102300486	MTN015	17,970	1,797,000.00
中国银行股		23 华能		
份有限公司	102300486	MTN015	40,320	4,032,000.00
中国银行股		23 象屿		
份有限公司	102300496	MTN002	161,280	16,128,000.00
中国银行股		23 金辉集团		
份有限公司	102300571	MTN002	4,837	483,729.12
中国银行股		23 水电八局		
份有限公司	102380843	MTN001	11,610	1,161,125.93
中国银行股		23 碧桂园		
份有限公司	102381150	MTN002	11,436	1,143,600.00
中国银行股		23 新创建		
份有限公司	102381241	MTN001BC	355,485	36,135,982.37
中国银行股		23 新创建		
份有限公司	102381241	MTN001BC	57,180	5,718,000.00
中国银行股		23 桂铁投		
份有限公司	102381255	25 性状以 MTN001	19,060	1,906,000.00
中国银行股		23 成都产投		
中国银行版 份有限公司	102381302	2.3 成和广汉 MTN002	170,250	17,025,000.00
中国银行股	102381551	23 今世缘 MTN002	6,934	693,400.00
份有限公司		MTN002		

	Ī			
中国银行股 份有限公司	102381619	23 水利十四 MTN002	273,950	27,395,000.00
中国银行股		23 桂铁投		
份有限公司	102381625	MTN003	273,950	27,395,000.00
中国银行股		23 鲁高速		
份有限公司	102381724	MTN007	134,370	13,437,000.00
		23 中电投		
中国银行股	102381770	MTN027(能源	223,950	22,395,000.00
份有限公司		保供特别债)	,	, ,
中国银行股	102201002	23 武汉城建	6.010	601.000.00
份有限公司	102381892	MTN001	6,010	601,000.00
中国银行股	102201007	23 中煤集团	46.100	4 (10 000 00
份有限公司	102381997	MTN002	46,190	4,619,000.00
中国银行股	102382056	23 厦国贸控	230,950	23,095,000.00
份有限公司	102362030	MTN003	230,930	23,093,000.00
中国银行股	102382060	23 吉利汽车	325,430	32,543,000.00
份有限公司	102302000	MTN001		32,3 13,000.00
中国银行股	102382080	23 陕有色	11,990	1,199,000.00
份有限公司		MTN001	7	, ,
中国银行股	102382080	23 陕有色	232,450	23,245,000.00
份有限公司		MTN001	,	, ,
中国银行股	102382092	23 大唐集	193,350	19,335,000.00
份有限公司		MTN009		
中国银行股 份有限公司	102382117	23 成都环境 MTN003	11,990	1,199,000.00
10 有限公司		23 中铁十一		
中国银行股	102382128	MTN002(科创	154,680	15,468,000.00
份有限公司	102302120	票据)	13 1,000	13,100,000.00
 中国银行股		23 大唐集		
份有限公司	102382143	MTN010	92,980	9,298,000.00
中国银行股	10000110	23 中盐	107060	40.506.000.00
份有限公司	102382169	MTN002	185,960	18,596,000.00
中国银行股	102382259	23 晋能煤业	464.040	46 404 000 00
份有限公司	102382239	MTN004	464,040	46,404,000.00
中国银行股	102382270	23 贵州高速	39,840	3,984,326.56
份有限公司	102302270	MTN002	37,070	3,707,320.30
中国银行股	102382347	23 郑州公用	93,620	9,362,000.00
份有限公司	102302317	MTN002	70,020	2,302,000.00
中国银行股	102382354	23 武金控	46,810	4,681,000.00
份有限公司		MTN004	- /	7 300000
中国银行股	100000	23 绿城房产	60-10 -	20.712.112.7
份有限公司	102382357	MTN001(绿	207,400	20,742,442.33
		色)		

	ı			
中国银行股份有限公司	102382424	23 三明高速 MTN001(革命 老区)	17,970	1,797,000.00
中国银行股 份有限公司	102382439	23 云能投 MTN002	234,050	23,405,000.00
中国银行股 份有限公司	102382481	23 北部湾 MTN003	187,240	18,724,000.00
中国银行股 份有限公司	102382501	23 华发实业 MTN003A	327,670	32,767,000.00
中国银行股份有限公司	102382515	23 中建六局 MTN001(科创 票据)	17,970	1,797,000.00
中国银行股份有限公司	102382515	23 中建六局 MTN001(科创 票据)	20,740	2,074,209.67
中国银行股 份有限公司	102382520	23 河钢集 MTN013	140,430	14,043,000.00
中国银行股份有限公司	102382528	23 中交天航 MTN001(科创 票据)	161,280	16,128,000.00
中国银行股份有限公司	102382652	23 本钢集团 MTN001(科创 票据)	35,937	3,597,456.43
中国银行股份有限公司	102382652	23 本钢集团 MTN001(科创 票据)	8	801.64
中国银行股 份有限公司	102382652	23 本钢集团 MTN001(科创 票据)	92,662	9,274,201.43
中国银行股 份有限公司	102382686	23 水电八局 MTN003	73,832	7,383,166.00
中国银行股 份有限公司	102382701	23 沪电力 MTN001	15,018	1,501,837.80
中国银行股 份有限公司	102382701	23 沪电力 MTN001	49,519	4,951,875.00
中国银行股 份有限公司	102382904	23 北控集 MTN001	4	426.10
中国银行股 份有限公司	102382904	23 北控集 MTN001	44,977	4,497,698.20
中国银行股 份有限公司	102382920	23 武商贸集 MTN002	15,018	1,501,837.80
中国银行股 份有限公司	102382927	23 中建投资 MTN001	63,277	6,328,349.41

		I I		T
中国银行股 份有限公司	102383007	23 甘国投 MTN002	87,477	8,747,703.80
中国银行股 份有限公司	102383017	23 新创建 MTN002BC	24,152	2,415,472.96
中国银行股	102383017	23 新创建	4	427.60
份有限公司 中国银行股	102383017	MTN002BC 23 新创建	43,734	4,373,419.10
份有限公司	102303017	MTN002BC 23 中建七局	13,731	1,373,117.10
中国银行股 份有限公司	102383076	MTN002(科创 票据)	22,494	2,250,095.57
中国银行股 份有限公司	102383172	23 中铁置业 MTN002	239,164	23,916,398.50
中国银行股 份有限公司	102383255	23 上海宝冶 MTN001	97,668	9,766,773.00
中国银行股 份有限公司	102383260	23 湖北宏泰 MTN005	54,292	5,429,191.20
中国银行股 份有限公司	102383366	23 龙湖企业 MTN002	4,885	488,497.66
中国银行股 份有限公司	102383376	23 本钢集团 MTN002(科创 票据)	48,850	4,884,976.60
中国银行股 份有限公司	132100169	21 华能集 GN002(碳中和 债)	164,370	16,754,356.14
中国银行股 份有限公司	132380015	23 海螺创业 GN001BC	223,950	22,174,815.42
中国银行股 份有限公司	132380060	23 三峡 GN001	15,360	1,536,000.00
中国银行股 份有限公司	132380060	23 三峡 GN001	92,980	9,298,000.00
中国银行股 份有限公司	132380061	23 三峡 GN002	38,400	3,840,000.00
中国银行股 份有限公司	132380065	23 华能水电 GN015	140,430	14,043,000.00
中国银行股 份有限公司	132380067	23 晋能电力 GN011(碳中和 债)	17,970	1,789,961.97
中国银行股 份有限公司	132380067	23 晋能电力 GN011(碳中和 债)	46,810	4,662,666.65
中国银行股 份有限公司	1928002	19 民生银行二级 01	345,400	35,202,005.47

1928026	19 兴业银行二	184,760	19,495,105.03
1928026		223,950	23,594,944.35

1928026		461,900	48,737,762.57
			, ,
1928031		461.900	48,911,397.75
2028024		223,950	23,708,065.79
			, ,
2120115		12.810	1,252,603.06
			-,,
2128011		223.950	23,529,541.13
			20,023,011110
2128025		44.790	4,691,903.87
2120023	级 01		1,051,503.07
2128025	21 建设银行二	89 580	9,383,807.73
2120023	级 01		7,363,607.73
2128025	21 建设银行二	89 580	9,383,807.73
2120023	级 01	07,500	7,363,607.73
2128030	21 交通银行二	80 580	9,408,085.75
2120030	级	07,300	7,400,003.73
2320033	23 厦门银行小	80 580	8,958,000.00
2320033	微债 01	07,300	6,736,000.00
2320041	23 南京银行	7.680	768,000.00
2320041	01	7,000	708,000.00
2320044	23 湖南银行	10 020	1,992,000.00
2320044	01	19,920	1,992,000.00
2221017	23 无锡农商绿	49 190	4 818 000 00
2321017	色债 01	40,100	4,818,000.00
2222002	23 民生租赁债	2 770	277 000 00
2322002	01	3,770	377,000.00
2222000	23 福特汽车债	46 100	4.610.000.00
2322009	01	40,190	4,619,000.00
2222010	23 兴业消费金	0.407	040 602 10
2322018	融债 01	8,49/	849,692.10
	23 创兴银行二		
232380063	级资本债	17,970	1,797,000.00
	01BC		
	23 创兴银行二		
232380063	级资本债	93,620	9,362,000.00
	01BC		
2326008	23 南洋银行	223,950	22,395,000.00
11:1/1/ (\(\)	1	1117 (157)	111 705 (MM) (M)
	1928026 1928026 1928031 2028024 2120115 2128011 2128025 2128025 2128025 2128030 2320033 2320041 23220044 2321017 2322002 2322009 2322018 232380063	1928026	1928026

中国银行股	2389373	23 汇聚融	73	7,337.30
份有限公司		1A1_BC		,
中国银行股	242300001	23 宁波银行永	19,920	2,004,522.17
份有限公司		续债 01	,	
中国银行股	242300001	23 宁波银行永	273,950	27,395,000.00
份有限公司		续债 01		
中国银行股	242300001	23 宁波银行永	39,840	4,008,155.91
份有限公司		续债 01		
中国银行股	242300001	23 宁波银行永	39,840	4,009,044.34
份有限公司		续债 01		
中国银行股 份有限公司	242300001	23 宁波银行永 续债 01	39,840	4,008,155.91
中国银行股		23 宁波银行永		
份有限公司	242300001	23 「	59,760	6,013,566.51
中国银行股		23 富邦华一永		
份有限公司	242380014		2,404	240,400.00
中国银行股		23 邮储永续债		
份有限公司	242380019	01	40,460	4,046,026.80
中国银行股		23 邮储永续债		
份有限公司	242380019	01	99,986	9,998,578.60
中国银行股	242200021	23 建行永续债	170 700	17.070.000.00
份有限公司	242380021	02	179,700	17,970,000.00
中国银行股	242380021	23 建行永续债	211 100	21 110 000 00
份有限公司	242360021	02	311,100	31,110,000.00
中国银行股	242380021	23 建行永续债	604,800	60,480,000.00
份有限公司	242360021	02	004,800	00,480,000.00
中国银行股	272380014	23 东方二级资	100,800	10,080,000.00
份有限公司	272300011	本债 01BC		10,000,000.00
中国银行股	272380014	23 东方二级资	44,925	4,492,500.00
份有限公司	2,20001.	本债 01BC	,,, 20	., ., 2,00000
中国银行股	282380002	23 太保寿险永	190,043	19,004,250.65
份有限公司		续债 01	, 	, ,
中国银行股	282380002	23 太保寿险永	74,275	7,428,186.63
份有限公司		续债 01		
中国银行股	292380005	23 法农银行债	273,950	27,395,000.00
份有限公司		01		
中国银行股	292380007	23 加拿大银行	44,844	4,484,396.90
份有限公司		债 01BC		
中国银行股	UL492881	23 龙湖拓展	139,440	13,944,000.00
份有限公司		MTN001		

中国银行股				
份有限公司,	1020010	19 平安银行二	220.050	22.742.025.10
中银国际证	1928010	级	230,950	23,743,835.10
券股份有限				
公司				
中国银行股				
份有限公司,	1020010	19 平安银行二	02.200	0.407.524.04
中银国际证	1928010	级	92,380	9,497,534.04
券股份有限				
公司				
中国银行股				
份有限公司,	1020010	19 工商银行永	100.500	11 (24 420 72
中银国际证	1928018	续债	109,580	11,634,430.73
券股份有限				
公司				
中国银行股				
份有限公司,	1020010	19 工商银行永	7.4. 7 0.0	5 015 500 05
中银国际证	1928018	续债	54,790	5,817,500.27
券股份有限				
公司				
中国银行股				
份有限公司,	2020040	20 工商银行二	124250	1 4 222 2 42 42
中银国际证	2028049	级 02	134,370	14,223,249.49
券股份有限				
公司				
中国银行股				
份有限公司,	2120021	21 工商银行永	222.050	22.116.026.17
中银国际证	2128021	续债 01	223,950	23,116,036.17
券股份有限 公司				
公司				
中国银行股				
份有限公司,	2120220	21 邮储银行二	222.050	22 400 040 00
中银国际证	2128028	级 01	223,950	23,408,040.89
券股份有限 公司				
公司				
中国银行股				
份有限公司,	2120020	21 邮储银行二	44 700	1 601 662 72
中银国际证	2128028	级 01	44,790	4,684,663.72
券股份有限 公司				
公司				

中国银行股 份有限公司, 中银国际证 券股份有限 公司	2128028	21 邮储银行二级 01	89,580	9,369,327.43
中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司	2128042	21 兴业银行二 级 02	313,530	32,647,131.58
中国银行股 份有限公司, 中银国际证 券股份有限 公司	2128042	21 兴业银行二 级 02	44,790	4,663,875.94
中国银行股 份有限公司, 中银国际证 券股份有限 公司	2128048	21 民生银行 02	193,350	19,876,717.43
中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司	2128048	21 民生银行 02	447,900	45,873,732.70
中国银行股 份有限公司, 中银国际证 券股份有限 公司	2128051	21 工商银行二 级 02	44,790	4,639,572.52
中国银行股 份有限公司, 中银国际证 券股份有限 公司	2128051	21 工商银行二 级 02	44,790	4,639,572.52
中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司	2128051	21 工商银行二 级 02	44,790	4,639,572.52

中国银行股份有限公司,中银国际证券股份有限公司	2228045	22 兴业银行 04	232,450	23,814,196.18
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	14,330	1,433,000.00
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	19,920	1,992,182.33
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	46,490	4,649,000.00
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	172,300	17,230,000.00
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	199,200	19,920,000.00
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	386,700	38,670,000.00
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	461,900	46,190,000.00

	<u> </u>		I	
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	464,900	46,490,000.00
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	65,908	6,759,917.92
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	21,969	2,258,839.94
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	42,539	4,502,805.57
中国银行股 份有限公司; 中银国际证 券股份有限 公司	2320061	23 厦门国际银行 01	21,092	2,109,737.38
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	104,169	10,419,804.11
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	260,082	26,008,239.50
中银国际控股有限公司	XS2647495 576	BCHINA 3.22667 09/29/26	9	58,997,371.31
中银国际控股有限公司	XS2650032 738	BCHINA 5.48135 07/17/26	7	21,564,049.84
中银国际控股有限公司	XS2650037 703	BCHINA 10.9972 01/22/26	9	52,962,296.26

中银国际亚	0.6020	进 肌 泽	40.212	510.007.46
洲有限公司	06030	港股通	40,213	519,987.46
中银国际证				
券股份有限	115629	23 津投 13	1,202	120,200.00
公司				
中银国际证				
券股份有限	115699	23BEHL01	328,740	32,874,000.00
公司				
中银国际证				
券股份有限	115699	23BEHL01	36,060	3,606,000.00
公司				
中银国际证				
券股份有限	155601	19 联发 02	38,670	3,918,478.25
公司				
中银国际证		18 建设银行二		
券股份有限	1828010	级 01	323,330	33,826,099.85
公司		~ .		
中银国际证		18 建设银行二		
券股份有限	1828010	级 01	369,520	38,658,399.83
公司				
中银国际证		19 工商银行二		
券股份有限	1928006	级 01	69,080	7,045,504.97
公司				
中银国际证	102000	19 农业银行二	150 500	17.550.050.44
券股份有限	1928009	级 04	172,700	17,559,258.44
公司				
中银国际证	1020011	19 工商银行二	24.540	2.512.502.20
券股份有限	1928011	级 03	34,540	3,512,783.39
公司 中银国际证				
中银国际证 券股份有限	1928011	19 工商银行二	54 700	5 612 167 62
安 放 份 有 限 公 司	1928011	级 03	54,790	5,612,167.62
中银国际证				
券股份有限	1928014	19 华夏银行永	415,710	42,711,374.53
分成衍有限公司	1720014	续债	713,/10	T4,/11,J/ 1 .JJ
中银国际证				
券股份有限	1928021	19 农业银行永	109,580	11,600,990.97
公司	1,20021	续债 01	200,000	11,000,000
中银国际证				
券股份有限	1928021	19 农业银行永	184,350	19,518,109.03
公司		续债 01		,,,, -
中银国际证				
券股份有限	1928021	19 农业银行永	184,350	19,518,109.03
公司		续债 01	,	
47				

中银国际证券股份有限	1928021	19 农业银行永 续债 01	273,950	29,003,217.10
公司 中银国际证 券股份有限	1928021	19 农业银行永	36,870	3,903,621.81
公司		续债 01		
中银国际证券股份有限	1928021	19 农业银行永	461,900	47,073,131.92
公司	1720021	续债 01	401,700	47,073,131.72
中银国际证		19 农业银行永		
券股份有限 公司	1928023	续债 02	89,580	9,439,701.85
中银国际证				
券股份有限	1928025	19 交通银行永续债	383,530	40,368,992.35
公司		次		
中银国际证券股份有限	199836	23 电建 2A	143,010	14,301,000.00
公司	199030	25 电连 2A	143,010	14,501,000.00
中银国际证		20 农业银行二		
券股份有限	2028013	级 01	369,520	37,466,292.49
公司				
中银国际证	2020012	20 农业银行二	90.590	0.002.466.00
券股份有限 公司	2028013	级 01	89,580	9,093,466.99
中银国际证		a a		
券股份有限	2028018	20 交通银行二 级	89,580	9,114,656.28
公司		5)X		
中银国际证		20 建设银行二	•10.150	
券股份有限 公司	2028033	级	219,160	23,363,565.31
中银国际证		22 (V = 10 / 2 / 2		
券股份有限	212380003	23 华夏银行债 01	109,580	11,099,070.96
公司		U1		
中银国际证	212200000	23 华夏银行债	212.522	21.554.421.24
券股份有限 公司	212380003	01	313,530	31,756,631.84
中银国际证				
券股份有限	2389307	23 欣荣 2 优先	12,444	1,244,400.00
公司		.,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,	, .	
中银国际证				
券股份有限	300760	迈瑞医疗	311	84,330.45
公司				

中银国际证 券股份有限	300760	迈瑞医疗	639	172,067.75
公司				
中银国际证				
券股份有限	600030	中信证券	28,076	689,906.85
公司				
中银国际证				
券股份有限	600030	中信证券	28,076	689,906.85
公司				
中银国际证				
券股份有限	600030	中信证券	28,601	689,929.21
公司				
中银国际证				
券股份有限	600030	中信证券	56,828	1,379,851.65
公司				
中银国际证				
券股份有限	600030	中信证券	57,763	1,379,957.31
公司				
中银国际证				
券股份有限	600900	长江电力	7,841	172,335.95
公司				
中银国际证				
券股份有限	601808	中海油服	14,481	221,373.93
公司				
中银国际证				
券股份有限	601808	中海油服	14,700	220,228.65
公司				
中银国际证				
券股份有限	601808	中海油服	8,776	129,547.27
公司				

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

学 段主 权 秘	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)
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	10,400,505	11,530,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	100,176,351	113,610,000.00

	T .			ı
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	103,360,156	116,890,000.00
中银国际证券股份有限公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	106,016,964	119,990,000.00
中银国际证券股份有限公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	107,992,614	122,820,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	108,110,486	122,900,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	108,129,654	123,430,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	115,073,432	130,850,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	115,114,127	130,620,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	118,401,471	135,250,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	118,511,384	135,340,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	134,683,656	153,270,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	148,366,245	167,550,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	149,739,054	169,280,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	177,462,289	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	18,482,831	21,100,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中 2 号	202,737,420	228,850,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	218,741,797	250,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	239,062,086	270,690,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	243,210,096	273,660,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	256,343,877	290,130,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中 2 号	256,765,475	294,510,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	3,845,807	4,260,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	4,913,008	5,450,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	40,409,903	44,560,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	44,592,697	50,800,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	49,660,883	56,380,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	5,325,284	5,910,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	532,729,842	603,210,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中 2 号	66,137,520	75,410,000.00

	T	<u> </u>		I
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	73,324,939	81,530,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	8,481,619	9,390,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	80,333,540	90,560,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	88,676,066	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	88,794,175	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	9,822,560	10,850,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	93,366,223	105,980,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	BOCI- ZGH-HZ- 002	中银证券中国 红-汇中2号	99,150,092	113,160,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202131	中银证券中国 红-汇中 31 号 集合资产管理 计划	100,936,746	108,830,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202131	中银证券中国 红-汇中 31 号 集合资产管理 计划	137,522,009	148,400,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202131	中银证券中国 红-汇中 31 号 集合资产管理 计划	144,230,234	155,610,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202131	中银证券中国 红-汇中 31 号 集合资产管理 计划	643,974,002	693,560,000.00
中银基金管理有限公司	018581	中银纯债债券 D	19,518,161	21,335,302.29

中银基金管理有限公司	ZYJJCWQ D08	中银基金-财 稳 8 号 QDII 集合资产管理 计划	150,000,000	150,000,000.00
中银基金管理有限公司	ZYJJCWQ D08	中银基金-财 稳 8 号 QDII 集合资产管理 计划	30,000,000	30,000,000.00
中银基金管理有限公司	ZYJJCWQ D08	中银基金-财 稳 8号 QDII 集合资产管理 计划	467,906,419	468,000,000.00
中银基金管理有限公司	ZYJJZLJC0 120230314	中银基金-战 略基础 1 号集 合资产管理计 划	2,058,248	2,000,000.00
中银基金管理有限公司	ZYJJZLJC0 120230314	中银基金-战 略基础 1 号集 合资产管理计 划	5,125,577	5,000,000.00
中银基金管理有限公司	ZYJJZLJC0 120230314	中银基金-战 略基础 1 号集 合资产管理计 划	5,688,929	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)
销售服务费	中国银行股份有限公司	26,840,258.30
产品托管费	中国银行股份有限公司	2,339,002.43
1 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	34,670,000.00
26 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	2,380,000.00
27 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	2,125,000.00
28 日质押式正回购	中国银行股份有限公司	2,465,000.00
7日质押式正回购	中银基金管理有限公司	37,595,200.00
现券买入	中国银行股份有限公司	1,383,663,378.08
现券买入	中银国际控股有限公司	133,523,717.41
现券买入	中银国际证券股份有限公司	22,736,850.33

现券卖出	中银国际证券股份有限公司	212,373,383.49
现券卖出	中银国际控股有限公司	59,376,361.54
现券卖出	中国银行股份有限公司	29,039,189.17

八、后市展望及下阶段投资策略

沪深港三地股指在 2023 年持续下跌,而债券收益率也在 2023 年不断探底。2023 年全年国内通货膨胀率持续处于 0%以下,叠加境内投资者风险偏好降低,债券类资产依旧比较有吸引力。股票市场的表现需要观察后续政府出台的各项政策,以及外资对中国经济的看法是否发生变化。



(ESG 优享) 中银理财-(6 个月) 最短持有期固收增强理财产品

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(ESG 优享)中银理财-(6个月)最短持有期固收增强理财产 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