# 中银理财-(7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	CYQ7D
理财产品名称	中银理财-(7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	Z7001022000528
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	2022-10-18
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
CYQ7DA	9,351,583,629.44	1.044155	1.044155	9,764,510,114.03	1.18%
CYQ7DB	3,248,256,577.73	1.045615	1.045615	3,396,427,634.71	1.23%

# (二) 截至报告期末,理财产品杠杆水平: 101.25%

# 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	85,043.02	6.46%	538,005.56	41.43%
同业存单	-	0.00%	265,312.84	20.43%
拆放同业及买入		0.00%	20,002,14	1.54%
返售	-	0.00%	20,002.14	1.54%
债券	55,113.73	4.19%	453,711.79	34.94%
非标准化债权类		0.000/		0.000/
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%	21,436.22	1.65%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	1,175,292.13	89.35%	-	0.00%
合计	1,315,448.88	100%	1,298,468.55	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	92,891.34	7.15%
2	DQ22042901: 存放同业	41,878.12	3.23%
3	RBRBZCZ20231222DQ231222031: 存放同业	23,315.19	1.80%
4	100201030110022102703: 存放同业	22,791.48	1.76%
5	DQ0107400114: 存放同业	22,195.61	1.71%
6	DQ0210820114: 存放同业	22,195.61	1.71%
7	RBRBZCZ20240112DQ240112012: 存放同业	21,977.02	1.69%
8	D002008840: 存放同业	21,160.34	1.63%
9	D002008753: 存放同业	21,154.77	1.63%

10	D002008821: 存放同业	20,097.04	1.55%
----	------------------	-----------	-------

#### 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(7天最短持有期纯债)
账号	767976273604
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,机构行为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	112304017	CD017	3,392	338,533.23
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304017	CD017	7,515	746,685.65
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304020	CD020	2,555	254,827.86
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304020	CD020	2,555	254,827.86
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304020	CD020	6,527	647,372.26
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304020	CD020	7,136	711,229.63
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304020	25 中国 版11 CD020	7,136	711,229.63
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304020	CD020	9,397	932,022.63
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304021	25 中国版刊 CD021	1,284	128,059.56
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304021	CD021	1,284	128,059.56
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304021	CD021	15,478	1,534,128.56
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304021	CD021	2,379	235,789.92
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304021	CD021	2,555	254,814.52
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304021	CD021	2,555	254,814.52
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304021	CD021	2,568	256,119.11
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304021	CD021	2,568	256,119.11
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304021	CD021	2,605	259,904.80
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304021	CD021	2,605	259,904.80
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304021	CD021	2,702	268,132.87
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304021	CD021	2,702	268,132.87
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304021	CD021	2,799	277,658.52
11 11 tV A 11		CD021	<u> </u>	1

	1			
中国银行股	112304021	23 中国银行	4,759	471,579.83
份有限公司		CD021		
中国银行股	112304021	23 中国银行	5,136	512,252.61
份有限公司		CD021	·	
中国银行股	112304021	23 中国银行	5,136	512,252.61
份有限公司		CD021		,
中国银行股	112304022	23 中国银行	20,352	2,024,537.44
份有限公司		CD022		_,-,,,
中国银行股	112304022	23 中国银行	6,784	674,845.81
份有限公司		CD022		
中国银行股	112304023	23 中国银行	2,615	260,826.63
份有限公司	112301023	CD023	2,013	200,020.03
中国银行股	112304023	23 中国银行	2,615	260,826.63
份有限公司	112304023	CD023	2,013	200,820.03
中国银行股	112304023	23 中国银行	3,248	322,102.62
份有限公司	112304023	CD023	3,240	322,102.02
中国银行股	112204022	23 中国银行	4.1	4.057.17
份有限公司	112304023	CD023	41	4,057.17
中国银行股	112204024	23 中国银行	12.076	1 202 102 14
份有限公司	112304024	CD024	13,076	1,303,192.14
中国银行股		23 中国银行	• 60•	
份有限公司	112304024	CD024	2,682	267,577.70
中国银行股	112201021	23 中国银行	2.711	252 075 75
份有限公司	112304024	CD024	2,744	273,867.67
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304024	CD024	3,269	325,802.94
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304024	CD024	6,538	651,605.87
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304024	CD024	9,807	977,408.81
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304025	CD025	11,834	1,172,196.62
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304025	CD025	11,834	1,172,196.62
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304025	CD025	11,834	1,172,171.77
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304025	2.5 中国银行 CD025	11,834	1,172,171.77
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304025	25 中国報刊 CD025	2,858	283,369.76
中国银行股		23 中国银行		
中国银行成 份有限公司	112304025	23 中国银门 CD025	20	2,028.52
中国银行股	112304025	23 中国银行	23,002	2,278,693.14
份有限公司		CD025		

				T
中国银行股	112304025	23 中国银行	39	3,897.88
份有限公司		CD025		
中国银行股	112304025	23 中国银行	8,051	797,525.69
份有限公司		CD025	·	,
中国银行股	112304025	23 中国银行	8,273	820,277.47
份有限公司	112001020	CD025		020,27711
中国银行股	112304026	23 中国银行	2,702	269,496.36
份有限公司	112304020	CD026	2,702	207,470.30
中国银行股	112204026	23 中国银行	2.702	260,406,26
份有限公司	112304026	CD026	2,702	269,496.36
中国银行股	112201026	23 中国银行	1-	746 507 70
份有限公司	112304026	CD026	7,515	746,587.73
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304026	CD026	9,807	977,351.87
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304027	CD027	11,834	1,172,100.25
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304027	CD027	11,834	1,172,100.25
		23 中国银行		
中国银行股	112304027		2,568	256,025.02
份有限公司		CD027		
中国银行股	112304027	23 中国银行	2,568	256,025.02
份有限公司		CD027		
中国银行股	112304027	23 中国银行	2,605	259,810.62
份有限公司		CD027		
中国银行股	112304027	23 中国银行	2,605	259,810.62
份有限公司	112301027	CD027	2,003	259,010.02
中国银行股	112304027	23 中国银行	41	4,056.71
份有限公司	112304027	CD027	41	4,030.71
中国银行股	112204027	23 中国银行	47	4 (00 20
份有限公司	112304027	CD027	47	4,689.20
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304027	CD027	9,745	966,194.24
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304032	CD032	41	4,055.57
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304032	CD032	8,074	799,366.34
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304033	CD033	7,126	707,955.37
	112304035			
中国银行股		23 中国银行	2,835	282,536.50
份有限公司		CD035		
中国银行股	112304035	23 中国银行	2,835	282,536.50
份有限公司		CD035	, 	,
中国银行股	112304035	23 中国银行	2,835	282,536.50
份有限公司		CD035		202,000.00

	1			
中国银行股 份有限公司	112304035	23 中国银行 CD035	2,835	282,536.50
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304035	CD035	3,037	302,774.98
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304035	CD035	3,037	302,774.98
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304037	CD037	1,355	135,012.81
中国银行股	112204027	23 中国银行	1.255	127.012.01
份有限公司	112304037	CD037	1,355	135,012.81
中国银行股	112304037	23 中国银行	1 255	125 012 91
份有限公司	112304037	CD037	1,355	135,012.81
中国银行股	112304037	23 中国银行	3,037	302,701.60
份有限公司	112304037	CD037	3,037	302,701.00
中国银行股	112304037	23 中国银行	3,037	302,701.60
份有限公司	112304037	CD037	3,037	302,701.00
中国银行股	112304037	23 中国银行	4,759	470,443.48
份有限公司	112301037	CD037	1,739	170,113.10
中国银行股	112304037	23 中国银行	6,652	658,538.24
份有限公司		CD037		
中国银行股	112304037	23 中国银行	6,751	668,539.10
份有限公司		CD037		,
中国银行股	112304037	23 中国银行	9,112	908,104.79
份有限公司		CD037	•	
中国银行股	112304037	23 中国银行	9,112	908,104.79
份有限公司		CD037		
中国银行股	112304039	23 中国银行	4,969	494,366.91
份有限公司 中国银行股		CD039		
中国银行版 份有限公司	112304039	23 中国银行 CD039	4,969	494,366.91
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304040	CD040	3,344	330,956.62
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304040	CD040	3,344	330,956.62
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304044	CD044	3,269	322,903.45
中国银行股		23 中国银行		
份有限公司	112304055	CD055	7,126	707,171.91
中国银行股		23 中国银行		_,
份有限公司	112304056	CD056	7,126	707,171.91
中国银行股	110004065	23 中国银行	2 202	227.016.10
份有限公司	112304065	CD065	3,383	335,916.10
L	I	<u> </u>		1

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

<b>学学</b> 为45	<b>ハナル ハカ</b>	代码 证券简称 -	报告期内买入证券	
关联方名称	证券代码		数量(单位:张)	总金额(单位:元)
中国银行股 份有限公司	012481275	24 黑牡丹 SCP001	129,890	12,988,970.40
中国银行股 份有限公司	012481349	24 渝医药 SCP004	31,738	3,173,809.20
中国银行股 份有限公司	032101135	21 吴中国太 PPN001(绿色)	61,936	6,305,787.36
中国银行股 份有限公司	032480424	24 柯桥国资 PPN002	223,076	22,307,630.80
中国银行股 份有限公司	082480164	24 美团美月 ABN002 优先 A	63,513	6,351,256.80
中国银行股 份有限公司	082480212	24 澄熙 ABN008 优先	53,625	5,362,860.31
中国银行股 份有限公司	082480310	24 澄熙 ABN007 优先	53,048	5,305,112.42
中国银行股 份有限公司	082480336	24 星澜 ABN003 优先	52,383	5,238,618.25
中国银行股 份有限公司	102282070	22 江宁经开 MTN002	65,551	6,734,180.15
中国银行股 份有限公司	102480928	24 皖能源 MTN002	77,728	7,772,756.20
中国银行股 份有限公司	102481311	24 吴中国太 MTN001	194,319	19,431,890.50
中国银行股 份有限公司	102482095	24 保利发展 MTN004	8,892	889,258.99
中国银行股 份有限公司	102482332	24 陕延油 MTN009B	2,862	286,209.60
中国银行股 份有限公司	102482413	24 中陕核工 MTN001	13,812	1,381,166.00
中国银行股 份有限公司	1920059	19 江苏银行二 级	14,650	1,478,110.84
中国银行股 份有限公司	1920059	19 江苏银行二 级	24,417	2,463,378.88
中国银行股 份有限公司	1920091	19 南京银行二 级	14,610	1,478,993.31
中国银行股 份有限公司	1920091	19 南京银行二 级	9,740	986,263.39
中国银行股 份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	12,122	1,257,055.43

上回42.75		10 10 10 10 10 10		
中国银行股	1928031	19 广发银行永	763,905	78,338,389.82
份有限公司		续债 10 广发银行录		
中国银行股	1928031	19 广发银行永 45 债	8,153	845,086.77
份有限公司		续债 10 中信银行业		
中国银行股 份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	31,469	3,236,184.06
中国银行股		19 中信银行永		
份有限公司	1928036	女债	93,566	9,622,664.32
中国银行股		20 南京银行二		
份有限公司	2020022	级 01	4,870	492,824.89
中国银行股		20 南京银行二		
份有限公司	2020022	级 01	9,740	985,969.25
中国银行股		20 光大银行永		
份有限公司	2028037	续债	134,467	14,260,269.77
中国银行股		20 光大银行永		
份有限公司	2028037	续债	21,164	2,182,199.07
中国银行股	2020011	20 广发银行二	<b>7</b> 00 000	50 500 005 00
份有限公司	2028044	级 01	500,000	53,593,095.90
中国银行股	2120011	21 邮储银行永	200.000	20.0(1.955.0(
份有限公司	2128011	续债 01	200,000	20,961,855.06
中国银行股	2422006	24 光大金租债	40,095	4 000 540 90
份有限公司	Z4ZZUU0	01	40,093	4,009,549.80
中国银行股	2422007	24 招银金租债	39,563	3,956,261.10
份有限公司	2722007	01	37,303	3,730,201.10
中国银行股	2489169	24 长金 1 优先	52,293	5,229,309.40
份有限公司	2107107	2 : 1 / MZ I / U/U	32,273	3,227,307.70
中国银行股				
份有限公				
司,中银国	190311	19 进出 11	1,545	158,175.45
际证券股份				
有限公司				
中国银行股				
份有限公				20-21-11
司,中银国	190311	19 进出 11	3,889	397,067.91
际证券股份				
有限公司				
中国银行股				
份有限公		19 工商银行永		
司,中银国	1928018	续债	271,689	28,024,057.04
际证券股份				
有限公司				

中国银行股				
份有限公		19 工商银行永		
司,中银国	1928018	45 工商取行水 续债	381,953	39,319,720.39
际证券股份		<b>.</b>		
有限公司				
中国银行股				
份有限公				
司,中银国	2028006	20 邮储银行永	158,545	16,114,207.26
际证券股份		续债		
有限公司				
中国银行股				
份有限公				
司,中银国	2028006	20 邮储银行永	179,797	18,253,186.52
际证券股份		续债	,	
有限公司				
中国银行股				
份有限公				
司,中银国	2028006	20 邮储银行永	34,836	3,558,022.62
际证券股份		续债	2 1,02 0	-,,-
有限公司				
中国银行股				
份有限公				
司,中银国	2028006	20 邮储银行永	35,768	3,629,396.18
际证券股份	2020000	续债	33,700	3,023,330.10
有限公司				
中国银行股				
份有限公				
司,中银国	2028006	20 邮储银行永	35,768	3,629,059.97
际证券股份	2020000	续债	55,700	3,047,037.71
有限公司				
中国银行股				
份有限公				
司,中银国	2028017	20 农业银行永	105,848	10,703,296.20
际证券股份	2020017	续债 01	102,070	10,703,270.20
有限公司				
中国银行股				
份有限公				
司,中银国	2028017	20 农业银行永	158,545	16,578,437.20
可, 甲银国   际证券股份	202001/	续债 01	130,343	10,5/0,45/.20
有限公司				
11 12 12 12 12 12 12 12 12 12 12 12 12 1				

	I	T	I	I
中国银行股				
份有限公		   20 农业银行永		
司,中银国	2028017	续债 01	169,325	17,159,633.55
际证券股份		失		
有限公司				
中国银行股				
份有限公		20 中川·伊尔·		
司,中银国	2028017	20 农业银行永	202,902	21,109,481.55
际证券股份		续债 01		
有限公司				
中国银行股				
份有限公				
司,中银国	2028017	20 农业银行永	21,168	2,142,581.00
际证券股份		续债 01	,	, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,
有限公司				
中国银行股				
份有限公				
司,中银国	2028017	20 农业银行永	28,299	2,867,385.45
际证券股份	2020017	续债 01	20,277	2,007,0001.0
有限公司				
中国银行股				
份有限公				
司,中银国	2028017	20 农业银行永 续债 01	42,336	4,286,736.91
际证券股份	2020017			
有限公司				
中国银行股				
份有限公司。由祖国	2020017	20 农业银行永	42.065	4 275 520 01
司,中银国	2028017	续债 01	43,065	4,375,538.81
际证券股份				
有限公司				
中国银行股				
份有限公司,由周围	2020017	20 农业银行永	52.202	E 212 161 52
司,中银国	2028017	续债 01	52,293	5,313,161.73
际证券股份				
有限公司				
中国银行股				
份有限公		20 农业银行永		
司,中银国	2028017	续债 01	78,440	7,969,742.60
际证券股份				
有限公司				

中国银行股 份有限公		20 农业银行永		
司,中银国	2028017	续债 01	84,683	8,563,823.21
际证券股份		安顶 01		
有限公司				
中国银行股				
份有限公		20 农业银行永		
司,中银国	2028017	20 秋亚秋 1 水   续债 01	9,492	994,150.27
际证券股份		────────────────────────────────────		
有限公司				
中国银行股				
份有限公		20 宏业组织表		
司,中银国	2028032	20 农业银行永 结债 02	42,341	4,349,552.09
际证券股份		续债 02		
有限公司				
中银国际证				
券股份有限	188771	21 国电 03	100,000	10,236,993.15
公司				
中银国际证				
<b>券股份有限</b>	188771	21 国电 03	100,000	10,236,993.15
公司		·	ŕ	
中银国际证		10 77 10 /		
券股份有限	1928006	19 工商银行二	5,445	574,106.67
公司		级 01	·	·
中银国际证		10		
<b>券股份有限</b>	1928025	19 交通银行永	11,415	1,180,308.96
公司		续债	·	
中银国际证				
券股份有限	2028023	20 招商银行永	194,319	20,348,833.23
公司		续债 01		
中银国际证		20 177 177		
券股份有限	2028023	20 招商银行永	21,180	2,160,892.14
公司		续债 01	·	
中银国际证				
券股份有限	2028023	20 招商银行永	42,336	4,318,158.66
公司		续债 01	,	
中银国际证		1		
券股份有限	2028023	20 招商银行永	63,492	6,474,089.06
公司		续债 01	ĺ	
中银国际证				
券股份有限	2028023	20 招商银行永	63,492	6,474,089.06
公司		续债 01		, , , ,
_ ,		L		

中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	63,497	6,480,059.75
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	64,410	6,780,009.66
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	84,672	8,636,672.95
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	96,615	10,170,014.49
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二级	134,467	14,167,002.70
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	13,812	1,381,166.00

# 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

<b>学</b> 联	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	ZYLCZYG JHZ002022 0304	中银证券中国 红-汇中 36 号 集合资产管理 计划	11,497,557	12,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYG JHZ002022 0304	中银证券中国 红-汇中 36 号 集合资产管理 计划	17,157,564	18,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYG JHZ002022 0304	中银证券中国 红-汇中 36 号 集合资产管理 计划	28,549,676	30,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYG JHZ002022 0304	中银证券中国 红-汇中 36 号 集合资产管理 计划	39,017,891	41,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYG JHZ002022 0304	中银证券中国 红-汇中 36 号 集合资产管理 计划	79,258,976	83,000,000.00

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	20,446,682.46
产品托管费	中国银行股份有限公司	1,559,081.87
10 日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	60,251.79
11 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	744,719.54
14 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	1,176,040.00
14 日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	8,278.00
1日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	5,055,010.93
1 日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	1,901,801.75
3 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	1,280,046.61
4 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	802,494.63
5 日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	519,414.00
6 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	7,780.00
7 日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	15,694,840.63
7 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	5,161,295.00
8日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	1,032,673.93
分销买入	中国银行股份有限公司	4,841,184.80
分销买入	中银国际证券股份有限公司	1,381,166.00
现券买入	中国银行股份有限公司	889,258.99

#### 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,努力控制

产品的杠杆与久期,做好风险对冲,加强与投资者沟通,提前做好各种情形下的流动性安排。



# 中银理财-(7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-(7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