

中银理财-稳富固收增强（6个月滚续）2号 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	WFZQ6M02
理财产品名称	中银理财-稳富固收增强（6个月滚续）2号
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000459
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	2022-09-15
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
WFZQ6M02A	12,638,072,452.57	1.072857	1.072857	13,558,849,470.45	2.21%
WFZQ6M02B	22,500,125,731.29	1.075078	1.075078	24,189,399,619.25	2.27%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：104.92%

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	161,096.26	4.27%	408,989.65	10.48%
同业存单	-	0.00%	207,383.42	5.31%
拆放同业及买入返售	-	0.00%	74,713.01	1.91%
债券	242,410.15	6.42%	2,867,768.89	73.50%
非标准化债权类资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	164,432.68	4.21%
境外投资资产	-	0.00%	39,938.63	1.02%
商品类资产	-	0.00%	-	0.00%
另类资产	-	0.00%	-	0.00%
公募基金	3,037.79	0.08%	138,697.75	3.55%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	3,367,860.53	89.23%	-	0.00%
合计	3,774,404.72	100%	3,901,924.03	100%

注：报告期末本理财产品持仓金融衍生品 45.93 万元。

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	290,754.20	7.45%
2	360036：工行优 2	39,710.91	1.02%
3	DQ22091601：存放同业	38,181.94	0.98%
4	1928031：19 广发银行永续债	34,100.59	0.87%
5	254697：24 交房 01	30,536.91	0.78%
6	092100012：21 长城资本债 01BC	29,480.12	0.76%
7	DQ22090702：存放同业	28,636.69	0.73%
8	2223009：22 国任财险	27,417.26	0.70%
9	1928021：19 农业银行永续债 01	25,786.88	0.66%

10	1928018: 19 工商银行永续债	25,418.12	0.65%
----	---------------------	-----------	-------

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（稳富固收增强 6 个月滚续 2 号）
账号	747176161591
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，产品管理人结合产品规模变化合理进行资产配置，控制产品久期、杠杆比例，维持适当比例高流动性资产，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，市场收益率水平波动加大，但整体震荡下行。投资经理积极配置长久期资产，获得了较好的资本利得收益；同时，投资经理积极拓展优质资产，并根据市场变化对组合久期、杠杆、资产配置进行灵活调整。权益市场方面，报告期内权益市场整体呈 V 型走势，本产品权益仓位可控。

（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	XS2789755 506	BCHINA 3.65 03/19/27	24,000	24,129,600.00
中国银行股份有限公司	XS2791420 123	BCHINA 4 03/21/27	36,000	36,194,400.00
中国银行股份有限公司	XS2800257 631	BCHINA 5.8 04/09/27	360,000	36,194,400.00
中国银行股份有限公司	XS2805154 007	BCHINA 5.2 04/16/27	22,000	22,118,800.00
中国银行股份有限公司	XS2852735 955	BCHIN 6 06/26/2027	3,600	36,194,400.00
中银国际证券股份有限公司	262298	工瑞 8A1	1,325	132,539.70

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	012384462	23 招商局 SCP010	492,268	49,642,741.94
中国银行股份有限公司	012480781	24 恒安国际 SCP001	36,684	3,665,757.38
中国银行股份有限公司	012480875	24 鲁商 SCP004	11,125	1,112,491.65
中国银行股份有限公司	012481275	24 黑牡丹 SCP001	42,412	4,241,240.60
中国银行股份有限公司	012481808	24 金风科技 SCP001(科创 票据)	76,984	7,698,875.11
中国银行股份有限公司	032100932	21 承德国控 PPN002	115,477	12,075,637.41
中国银行股份有限公司	032100932	21 承德国控 PPN002	73,955	7,713,870.00
中国银行股份有限公司	032380472	23 常德城投 PPN007	198,401	21,475,157.06
中国银行股份有限公司	032480424	24 柯桥国资 PPN002	10,755	1,075,459.20
中国银行股份有限公司	042480135	24 鄂文旅 CP002	333,061	33,306,087.60
中国银行股份有限公司	082480001	24 惠行 ABN001 优先 A	139,749	13,976,046.31

中国银行股份有限公司	082480007	24 和煦 ABN001 优先 A	1,476,840	147,695,537.22
中国银行股份有限公司	082480014	24 无锡国联 ABN001 优先 (类 REITs)	257,219	25,724,224.00
中国银行股份有限公司	082480025	24 星睿 ABN001 优先	260,037	26,009,671.75
中国银行股份有限公司	082480025	24 星睿 ABN001 优先	39,162	3,917,078.41
中国银行股份有限公司	082480054	24 晋租 1 号 ABN001 优先 (绿色)	35,033	3,503,343.30
中国银行股份有限公司	082480078	24 聚润京能 ABN001 优先 (绿色)	203,459	20,345,920.80
中国银行股份有限公司	082480080	24 惠行 1 号 ABN001 优先 A	176,223	17,623,456.93
中国银行股份有限公司	082480307	24 澄熙 ABN006 优先	1,782	178,242.83
中国银行股份有限公司	082480307	24 澄熙 ABN006 优先	92,580	9,258,002.60
中国银行股份有限公司	082480313	24 惠行 3 号 ABN001 优先 A	92,580	9,258,002.60
中国银行股份有限公司	082480316	24 星澜 ABN002 优先	1,777	177,701.98
中国银行股份有限公司	082480333	24 澄熙 ABN009 优先	1,767	176,752.86
中国银行股份有限公司	082480333	24 澄熙 ABN009 优先	46,649	4,664,910.50
中国银行股份有限公司	082480400	24 中建新疆 2ABN001 优 先(乡村振兴)	708	70,823.87
中国银行股份有限公司	082480415	24 广能莱州 ABN001 优先	26,663	2,666,266.80
中国银行股份有限公司	082480438	24 澄欣 ABN001 优先	185,796	18,579,570.80
中国银行股份有限公司	082480504	24 邦鑫 ABN002 优先	139,744	13,974,351.30
中国银行股份有限公司	092280080	22 光大银行二 级资本债 01A	98,888	10,334,434.05

中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	296,663	31,077,970.57
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	296,663	31,090,061.61
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	34,145	3,537,977.26
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	34,145	3,537,977.26
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	98,867	10,372,434.25
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	98,888	10,362,557.15
中国银行股份有限公司	092280139	22 交行二级资 本债 02A	31,706	3,286,665.66
中国银行股份有限公司	102001446	20 陕有色 MTN002	228,601	24,117,327.25
中国银行股份有限公司	102100597	21 陕有色 MTN002	31,586	3,339,068.62
中国银行股份有限公司	102100780	21 中电国际 MTN001	126,421	13,084,512.14
中国银行股份有限公司	102100780	21 中电国际 MTN001	274,321	28,385,730.88
中国银行股份有限公司	102101238	21 华润控股 MTN002B	124,419	13,111,495.96
中国银行股份有限公司	102101706	21 京住总集 MTN002	5,736	591,232.19
中国银行股份有限公司	102281138	22 中海企业 MTN003B	472,309	47,950,559.93
中国银行股份有限公司	102282441	22 中交疏浚 MTN002	23,858	2,399,592.36
中国银行股份有限公司	102282498	22 厦港务 MTN004	143,146	14,502,165.58
中国银行股份有限公司	102282794	22 中粮置业 MTN001	124,419	12,862,395.90
中国银行股份有限公司	102282794	22 中粮置业 MTN001	76,984	7,998,861.82
中国银行股份有限公司	102380408	23 海尔金控 MTN001	73,393	7,694,848.42
中国银行股份有限公司	102382878	23 中交天航 MTN002(科创 票据)	14,217	1,487,040.59
中国银行股份有限公司	102383076	23 中建七局 MTN002(科创 票据)	254,582	25,910,577.19

中国银行股份有限公司	102383134	23 中交天航 MTN003(科创 票据)	28,435	2,865,346.17
中国银行股份有限公司	102383172	23 中铁置业 MTN002	438,055	44,648,012.75
中国银行股份有限公司	102400690	24 云能投 MTN007	177,964	17,798,533.34
中国银行股份有限公司	102400761	24 夏商 MTN001	11,990	1,199,230.21
中国银行股份有限公司	102400761	24 夏商 MTN001	47,960	4,796,540.79
中国银行股份有限公司	102400775	24 晋路桥 MTN001(科创 票据)	30,588	3,058,827.00
中国银行股份有限公司	102400775	24 晋路桥 MTN001(科创 票据)	51,131	5,113,148.20
中国银行股份有限公司	102400787	24 华润 MTN004	53,137	5,313,749.20
中国银行股份有限公司	102480109	24 太湖国投 MTN001	169,722	16,976,701.30
中国银行股份有限公司	102480130	24 郑州公用 MTN001	85,740	8,574,668.96
中国银行股份有限公司	102480362	24 厦国贸控 MTN001	75,156	7,515,616.20
中国银行股份有限公司	102480364	24 云建投 MTN002	173,746	17,376,079.21
中国银行股份有限公司	102480369	24 闽建工 MTN001	86,873	8,688,077.58
中国银行股份有限公司	102480390	24 象屿 MTN001	434,183	43,422,203.95
中国银行股份有限公司	102480411	24 闽国资 MTN001	260,510	26,051,009.10
中国银行股份有限公司	102480464	24 陕延油 MTN005	214,450	21,444,970.80
中国银行股份有限公司	102480518	24 北部湾 MTN003	33,547	3,354,709.80
中国银行股份有限公司	102480546	24 津城建 MTN009	335,328	33,532,785.00
中国银行股份有限公司	102480612	24 云建投 MTN004	281,552	28,155,208.00
中国银行股份有限公司	102480661	24 中建六局 MTN002(科创 票据)	86,334	8,633,990.15

中国银行股份有限公司	102480700	24 福建港口 MTN001	86,684	8,669,080.22
中国银行股份有限公司	102480708	24 云南机场 MTN001	434,452	43,448,750.83
中国银行股份有限公司	102480721	24 合高建设 MTN001	28,947	2,919,313.13
中国银行股份有限公司	102480753	24 沈阳地铁 MTN002	34,296	3,429,641.90
中国银行股份有限公司	102480777	24 北部湾投 MTN001	56,200	5,707,921.43
中国银行股份有限公司	102480777	24 北部湾投 MTN001	67,820	6,781,973.60
中国银行股份有限公司	102480803	24 湘建工 MTN001(科创 票据)	103,981	10,398,090.90
中国银行股份有限公司	102480803	24 湘建工 MTN001(科创 票据)	198,401	19,927,606.48
中国银行股份有限公司	102480861	24 厦门海翼 MTN001	111,239	11,123,893.50
中国银行股份有限公司	102480928	24 皖能源 MTN002	35,849	3,584,882.60
中国银行股份有限公司	102480992	24 特变股份 MTN001B	27,847	2,784,656.50
中国银行股份有限公司	102481040	24 青岛城投 MTN003	37,016	3,701,577.70
中国银行股份有限公司	102481056	24 西部矿业 MTN001(可持 续挂钩)	37,676	3,767,572.90
中国银行股份有限公司	102481056	24 西部矿业 MTN001(可持 续挂钩)	87,611	8,761,941.30
中国银行股份有限公司	102481091	24 福建漳州 MTN001	175,222	17,526,479.74
中国银行股份有限公司	102481100	24 海运集装 MTN001(科创 票据)	198,383	19,838,272.80
中国银行股份有限公司	102481104	24 北部湾 MTN005	175,222	17,522,202.40
中国银行股份有限公司	102481117	24 光大环境 MTN001	31,588	3,177,871.10
中国银行股份有限公司	102481117	24 光大环境 MTN001	63,176	6,355,742.21

中国银行股份有限公司	102481117	24 光大环境 MTN001	94,764	9,533,613.31
中国银行股份有限公司	102481119	24 浙能国际 MTN001	88,111	8,811,776.74
中国银行股份有限公司	102481128	24 山西建投 MTN003A	528,669	52,872,108.87
中国银行股份有限公司	102481133	24 厦国贸控 MTN004	114,360	11,436,902.38
中国银行股份有限公司	102481133	24 厦国贸控 MTN004	88,111	8,811,839.51
中国银行股份有限公司	102481156	24 荣盛 MTN001	264,334	26,435,489.56
中国银行股份有限公司	102481164	24 津城建 MTN014	793,003	79,307,946.05
中国银行股份有限公司	102481165	24 滨建投 MTN007	793,003	79,308,163.30
中国银行股份有限公司	102481195	24 泰州城建 MTN002	88,111	8,811,875.72
中国银行股份有限公司	102481205	24 华电股 MTN001	100,916	10,143,465.03
中国银行股份有限公司	102481205	24 华电股 MTN001	25,229	2,535,866.26
中国银行股份有限公司	102481207	24 鄂联投 MTN002	622,242	62,230,158.10
中国银行股份有限公司	102481207	24 鄂联投 MTN002	76,240	7,624,004.20
中国银行股份有限公司	102481210	24 粤财投资 MTN001A	88,892	8,889,796.10
中国银行股份有限公司	102481215	24 保利发展 MTN003	114,360	11,436,006.30
中国银行股份有限公司	102481237	24 象屿 MTN002A	11,233	1,123,445.38
中国银行股份有限公司	102481237	24 象屿 MTN002A	88,982	8,898,983.88
中国银行股份有限公司	102481311	24 吴中国太 MTN001	71,698	7,169,765.20
中国银行股份有限公司	102481317	24 武商贸集 MTN002	35,731	3,573,121.80
中国银行股份有限公司	102481323	24 厦国贸控 MTN005	142,925	14,292,487.20
中国银行股份有限公司	102481333	24 福州古厝 MTN003	71,462	7,146,243.60
中国银行股份有限公司	102481436	24 联发集 MTN003	85,380	8,537,959.20

中国银行股份有限公司	102481507	24 亿纬锂能 MTN001(科创 票据)	198,383	19,838,272.80
中国银行股份有限公司	102481596	24 中国绿发 MTN001	252,042	25,204,175.00
中国银行股份有限公司	102481618	24 福瑞能源 MTN001	263,590	26,379,438.80
中国银行股份有限公司	102481747	24 豫航空港 MTN007	17,865	1,786,521.00
中国银行股份有限公司	102481752	24 中铁置业 MTN001	95,679	9,567,862.40
中国银行股份有限公司	102481759	24 云建投 MTN009	10,719	1,071,912.60
中国银行股份有限公司	102481846	24 华润租赁 MTN003(碳中 和债)	158,751	15,875,123.80
中国银行股份有限公司	102481872	24 通汇投资 MTN002	89,167	8,916,695.55
中国银行股份有限公司	102481936	24 泉州城建 MTN001	244,706	24,470,555.00
中国银行股份有限公司	102482010	24 中交三航 MTN002(科创 票据)	201,544	20,154,413.70
中国银行股份有限公司	102482011	24 诚通控股 MTN013A	56,200	5,632,311.92
中国银行股份有限公司	102482024	24 鲁高速 MTN005	131,190	13,118,964.50
中国银行股份有限公司	102482086	24 云南交投 MTN001	344,218	34,421,791.30
中国银行股份有限公司	102482095	24 保利发展 MTN004	344,255	34,425,476.80
中国银行股份有限公司	102482128	24 香格里拉 MTN001BC	30,643	3,064,476.38
中国银行股份有限公司	102482128	24 香格里拉 MTN001BC	53,137	5,313,749.20
中国银行股份有限公司	102482135	24 南山开发 MTN001A	132,844	13,284,373.00
中国银行股份有限公司	102482246	24 云南交投 MTN002	27,695	2,769,495.90
中国银行股份有限公司	102482246	24 云南交投 MTN002	42,488	4,249,100.42
中国银行股份有限公司	102482300	24 湘建工 MTN002(科创 票据)	134,363	13,436,275.80

中国银行股份有限公司	102482363	24 云建投 MTN012	215,900	21,589,966.40
中国银行股份有限公司	102482410	24 湖北宏泰 MTN002	214,190	21,419,022.40
中国银行股份有限公司	102482745	24 北部湾投 MTN003	10,263	1,026,329.70
中国银行股份有限公司	132480009	24 河钢集 GN002	253,167	25,318,821.35
中国银行股份有限公司	132480009	24 河钢集 GN002	357,416	35,741,618.00
中国银行股份有限公司	132480015	24 苏州高新 GN001	433,420	43,345,341.74
中国银行股份有限公司	132480020	24 南京地铁 GN002(碳中和 债)	74,014	7,401,352.80
中国银行股份有限公司	132480026	24 新奥天然气 GN001	37,676	3,767,572.90
中国银行股份有限公司	132480027	24 金融城建 GN001	37,676	3,767,572.90
中国银行股份有限公司	132480028	24 郑州地铁 GN001	198,383	19,838,272.80
中国银行股份有限公司	132480056	24 河钢集 GN005	695,230	69,522,973.00
中国银行股份有限公司	1920059	19 江苏银行二 级	51,273	5,277,901.88
中国银行股份有限公司	1920091	19 南京银行二 级	210,972	21,588,395.75
中国银行股份有限公司	1928022	19 兴业银行二 级 01	140,648	14,526,793.72
中国银行股份有限公司	1928026	19 兴业银行二 级 02	102,545	10,556,378.02
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	103,060	10,645,713.83
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	34,091	3,530,632.14
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	45,720	4,730,516.23
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	98,946	10,232,134.22
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	233,368	24,061,116.34
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永 续债	140,021	14,411,078.58

中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	196,695	20,190,626.27
中国银行股份有限公司	2020022	20 南京银行二级 01	63,048	6,396,103.23
中国银行股份有限公司	2020044	20 宁波银行二级	62,950	6,653,659.27
中国银行股份有限公司	2023001	20 人民财险	103,060	10,424,289.05
中国银行股份有限公司	2023001	20 人民财险	137,161	13,910,012.69
中国银行股份有限公司	2023001	20 人民财险	51,273	5,184,672.86
中国银行股份有限公司	2023001	20 人民财险	70,324	7,126,553.32
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	42,140	4,272,052.66
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	51,530	5,207,810.85
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	51,530	5,208,320.99
中国银行股份有限公司	2023014	20 中国人寿财险	153,818	16,033,069.02
中国银行股份有限公司	2023014	20 中国人寿财险	51,530	5,372,634.98
中国银行股份有限公司	2023016	20 中财再保险	199,594	20,601,372.76
中国银行股份有限公司	2023016	20 中财再保险	31,615	3,319,224.97
中国银行股份有限公司	2023016	20 中财再保险	395,551	41,597,611.14
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	23,980	2,452,317.32
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	95,919	9,808,981.52
中国银行股份有限公司	2028024	20 中信银行二级	231,459	24,214,028.23
中国银行股份有限公司	2028024	20 中信银行二级	231,459	24,212,523.75
中国银行股份有限公司	2028024	20 中信银行二级	63,574	6,667,852.25
中国银行股份有限公司	2028024	20 中信银行二级	71,940	7,562,919.14
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	119,420	12,569,460.31

中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	126,421	13,384,863.48
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	26,246	2,763,398.72
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	416,626	44,051,285.81
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	45,720	4,839,755.57
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	46,292	4,894,587.31
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	119,899	12,759,815.96
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	98,888	10,498,161.38
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	98,888	10,498,161.38
中国银行股份有限公司	2028044	20 广发银行二级 01	45,837	4,785,082.19
中国银行股份有限公司	2028044	20 广发银行二级 01	68,755	7,177,623.29
中国银行股份有限公司	2120064	21 恒丰银行永续债	1,961	209,415.36
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永续债 01	26,246	2,835,638.77
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永续债 01	26,246	2,835,638.77
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	11,139	1,189,016.34
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	44,555	4,756,983.20
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永续债	136,581	14,639,175.90
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永续债	211,754	22,843,157.92
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永续债	25,389	2,723,586.81
中国银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永续债	102,436	10,901,715.06
中国银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永续债	296,663	31,870,027.23
中国银行股份有限公司	2128025	21 建设银行二级 01	197,775	20,808,267.65
中国银行股份有限公司	2128025	21 建设银行二级 01	296,663	31,214,315.56

中国银行股份有限公司	2128025	21 建设银行二级 01	98,888	10,404,133.83
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	98,888	10,381,667.37
中国银行股份有限公司	2228001	22 邮储银行永续债 01	296,663	30,866,993.63
中国银行股份有限公司	231814	24 湖南 16	30,673	3,067,732.32
中国银行股份有限公司	231814	24 湖南 16	30,673	3,067,732.32
中国银行股份有限公司	231814	24 湖南 16	30,673	3,067,732.32
中国银行股份有限公司	232380026	23 厦门国际二级资本债 01	28,435	3,025,686.49
中国银行股份有限公司	232400014	24 民生银行二级资本债 01	197,820	19,782,306.08
中国银行股份有限公司	232400014	24 民生银行二级资本债 01	98,910	9,900,074.70
中国银行股份有限公司	232400014	24 民生银行二级资本债 01	98,910	9,900,074.70
中国银行股份有限公司	232400018	24 宁波银行二级资本债 01	59,323	5,932,315.00
中国银行股份有限公司	232480014	24 交行二级资本债 01A	199,594	19,932,572.58
中国银行股份有限公司	232480014	24 交行二级资本债 01A	31,524	3,166,124.03
中国银行股份有限公司	232480014	24 交行二级资本债 01A	31,524	3,166,124.03
中国银行股份有限公司	232480014	24 交行二级资本债 01A	63,073	6,352,688.77
中国银行股份有限公司	232480020	24 兴业银行二级资本债 01	19,017	1,901,667.90
中国银行股份有限公司	232480020	24 兴业银行二级资本债 01	77,032	7,703,162.10
中国银行股份有限公司	2422004	24 兴业消费金融债 01	36,688	3,668,823.40
中国银行股份有限公司	2422005	24 农银金租债 01	172,445	17,244,476.00
中国银行股份有限公司	2422007	24 招银金租债 01	67,820	6,781,973.60
中国银行股份有限公司	2422013	24 兴业消费金融债 02	38,045	3,804,525.20
中国银行股份有限公司	2422015	24 招联消费金融债 03	32,844	3,284,371.90

中国银行股份有限公司	2422024	24 招联消费金融债 04	76,429	7,642,881.90
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	30,035	3,161,935.67
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	35,980	3,782,838.58
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	47,960	5,070,234.98
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	71,940	7,607,874.36
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	76,166	7,976,063.82
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	11,426	1,192,019.31
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	11,426	1,192,019.31
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	12,694	1,325,930.45
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	50,778	5,304,884.59
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	68,291	7,130,866.97
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	136,581	13,665,065.58
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	370,831	37,083,055.00
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	57,567	5,799,780.17
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	76,166	7,636,034.07
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	1,328,437	132,843,730.00
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	249,121	24,912,057.00
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	61,285	6,128,533.00
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	178,361	17,852,573.97
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	533,702	53,370,166.00
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	89,180	8,926,286.99
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	89,180	8,926,286.99

中国银行股份有限公司	2489031	24 汇聚融 1A2_bc	37,080	3,707,964.50
中国银行股份有限公司	262480001	24 江苏金租绿 债 01	42,741	4,274,136.10
中国银行股份有限公司	262480003	24 江苏金租绿 债 02	33,910	3,390,986.80
中国银行股份有限公司	272380006	23 中财再保险 资本补充债 01	395,551	40,984,939.75
中国银行股份有限公司	282400001	24 太保寿险永 续债 01	130,850	13,085,006.50
中国银行股份有限公司	282400001	24 太保寿险永 续债 01	46,041	4,604,136.50
中国银行股份有限公司	292480005	24 创兴银行二 级资本债 01BC	52,485	5,248,489.80
中国银行股份有限公司	UL536164	24 美团美月 ABN003 优先 A	11,903	1,190,382.73
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	092280134	22 工行二级资 本债 04A	296,663	30,739,698.43
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	115,477	12,037,631.71
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	119,420	12,356,481.29
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	138,839	14,422,291.05
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	139,027	14,442,408.48

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	205,091	21,247,069.82
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	210,702	21,872,521.77
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	63,231	6,575,086.35
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	70,585	7,329,746.72
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	95,536	9,885,185.03
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	98,348	10,203,230.07
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	119,899	12,232,484.23
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	42,140	4,281,850.30

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	51,976	5,460,484.13
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	84,281	8,563,700.60
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	105,877	10,770,055.33
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	168,562	17,136,301.25
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	231,459	23,508,449.56
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	231,459	23,508,449.56
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	259,882	26,324,198.91
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	31,615	3,219,064.22

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	47,768	5,008,861.50
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	63,231	6,438,128.44
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	98,946	10,045,096.96
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	119,420	12,425,828.21
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	119,899	12,166,587.37
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	143,304	14,910,324.44
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	20,997	2,184,632.65
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	26,246	2,730,482.84

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	47,768	4,970,108.15
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	114,592	11,987,442.97
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	141,169	15,123,883.31
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	32,956	3,534,287.71
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	37,678	4,042,623.37
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	65,911	7,068,575.43
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2128032	21 兴业银行二级 01	197,775	20,909,625.85
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2128044	21 工商银行永续债 02	199,594	20,592,830.13

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2128044	21 工商银行永续债 02	296,663	31,141,058.93
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	494,438	51,621,505.83
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2228003	22 兴业银行二级 01	98,888	10,292,052.55
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	13,176	1,339,593.14
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	13,176	1,339,593.14
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	13,176	1,339,593.14
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	158,529	16,609,104.83
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	232400022	24 成都银行二级资本债 01	38,492	3,849,470.24

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	12,685	1,296,920.19
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	2,537	259,384.04
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	68,291	7,100,464.00
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	63,318	6,679,245.06
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	1,305,247	130,524,673.50
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	136,581	13,662,033.48
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	179,898	18,120,481.21
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	30,035	3,027,600.83

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	30,035	3,026,222.22
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	30,035	3,027,600.83
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	34,145	3,415,508.37
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	35,980	3,624,096.24
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	50,778	5,087,251.74
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	71,959	7,248,192.48
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	157,940	15,716,538.01
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	189,528	18,877,376.91

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	49,703	4,970,312.20
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242400008	24 江苏银行永续债 01	107,778	10,777,785.60
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242400008	24 江苏银行永续债 01	21,553	2,155,341.90
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242400008	24 江苏银行永续债 01	98,910	9,893,744.47
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242480003	24 广州农商行永续债 01	56,200	5,620,459.34
中银国际证券股份有限公司	115886	23 吉利 K1	47,477	4,963,721.20
中银国际证券股份有限公司	133825	24 坪投 01	197,775	19,891,401.88
中银国际证券股份有限公司	148717	24 中航 K4	124,123	12,429,818.06
中银国际证券股份有限公司	1928011	19 工商银行二级 03	210,702	21,984,235.91
中银国际证券股份有限公司	1928014	19 华夏银行永续债	102,545	10,687,912.82
中银国际证券股份有限公司	1928014	19 华夏银行永续债	49,473	5,163,160.37

中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	69,419	7,252,401.46
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	147,522	15,275,326.05
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	182,881	18,942,511.01
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	205,091	21,204,985.25
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	38,492	4,005,479.75
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	256,363	26,432,655.34
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	49,473	5,108,473.02
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	103,060	10,620,773.27
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	103,953	10,708,987.73
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	158,935	16,433,770.60
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	188,392	19,467,233.43
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	34,757	3,591,458.04
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	51,354	5,293,291.10
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	65,911	6,811,007.59

中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	138,875	14,441,117.05
中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	231,459	24,067,324.82
中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	63,048	6,377,226.61
中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	92,584	9,627,411.37
中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	94,572	9,563,503.98
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	150,714	15,861,876.49
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	37,678	3,965,469.12
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	47,768	4,994,131.48
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	51,530	5,397,137.54
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	102,274	10,753,336.28
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	31,766	3,346,709.75
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	31,766	3,346,709.75
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	418,807	43,002,589.77
中银国际证 券股份有限 公司	232380004	23 农行二级资 本债 01A	10,540	1,106,299.72

中银国际证 券股份有限 公司	232380004	23 农行二级资 本债 01A	2,635	276,574.93
中银国际证 券股份有限 公司	232380004	23 农行二级资 本债 01A	2,635	276,574.93
中银国际证 券股份有限 公司	232380004	23 农行二级资 本债 01A	5,270	553,149.86
中银国际证 券股份有限 公司	232480011	24 农行二级资 本债 02A	31,519	3,150,847.85
中银国际证 券股份有限 公司	240137	23 吉高 03	60,448	6,315,629.24
中银国际证 券股份有限 公司	240554	24 国惠 02	100,000	10,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	240554	24 国惠 02	86,679	8,667,896.10
中银国际证 券股份有限 公司	2420002	24 北部湾银行 小微债 01	40,584	4,058,437.90
中银国际证 券股份有限 公司	2420004	24 北部湾银行 小微债 02	86,334	8,633,387.00
中银国际证 券股份有限 公司	2422017	24 汇通金租债 01	496,349	49,634,866.00
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	1,070,951	107,095,112.00
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	176,654	17,665,362.00
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	119,899	12,012,211.67
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	323,214	32,321,387.00

中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	918,486	91,848,571.50
中银国际证 券股份有限 公司	254165	24 厦国 K1	16,442	1,644,151.65
中银国际证 券股份有限 公司	360025	中信优 1	109,187	11,374,058.54
中银国际证 券股份有限 公司	360025	中信优 1	47,191	4,918,269.99
中银国际证 券股份有限 公司	360025	中信优 1	54,848	5,712,970.28
中银国际证 券股份有限 公司	360025	中信优 1	94,382	9,833,708.51
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	103,432	10,610,094.16
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	109,187	11,203,726.09
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	110,577	11,344,063.24
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	133,785	13,936,381.89
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	145,395	15,126,872.39
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	145,395	15,116,694.76
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	255,005	26,117,624.80
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	290,790	30,233,389.51

中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	306,789	31,795,567.39
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	331,029	34,274,772.69
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	401,355	41,841,254.06
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	48,519	4,981,462.98
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	94,382	9,664,763.90
中银国际证 券股份有限 公司	360030	建行优 1	99,899	10,174,711.11
中银国际证 券股份有限 公司	360034	光大优 3	109,187	11,633,924.72
中银国际证 券股份有限 公司	360034	光大优 3	110,577	11,765,360.45
中银国际证 券股份有限 公司	360034	光大优 3	141,574	15,057,777.67
中银国际证 券股份有限 公司	360034	光大优 3	17,627	1,869,883.83
中银国际证 券股份有限 公司	360034	光大优 3	255,005	27,140,195.35
中银国际证 券股份有限 公司	360034	光大优 3	33,300	3,535,091.91
中银国际证 券股份有限 公司	360034	光大优 3	46,233	4,928,385.67
中银国际证 券股份有限 公司	360034	光大优 3	499,070	53,250,774.55

中银国际证 券股份有限 公司	360034	光大优 3	51,716	5,510,877.53
中银国际证 券股份有限 公司	360034	光大优 3	60,479	6,441,042.47
中银国际证 券股份有限 公司	360034	光大优 3	642,211	68,511,037.69
中银国际证 券股份有限 公司	360034	光大优 3	668,253	68,215,232.86
中银国际证 券股份有限 公司	360034	光大优 3	97,038	10,340,405.08
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	1,442,726	148,990,296.98
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	110,577	11,360,649.75
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	153,199	15,860,715.04
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	163,781	16,849,810.06
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	17,627	1,805,016.06
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	214,056	22,150,512.40
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	232,632	24,058,764.21
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	255,005	26,204,326.54
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	412,502	42,570,170.28

中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	412,502	42,574,295.30
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	46,233	4,758,712.36
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	460,183	47,578,305.38
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	51,716	5,321,079.10
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	596,339	61,446,719.97
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	66,599	6,825,764.31
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	783,753	80,875,486.00
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	94,382	9,684,584.22
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	97,038	9,984,274.39
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	29,256	755,946.10
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	53,255	1,509,112.36
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	58,701	1,513,636.58
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	7,315	188,424.56
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	7,895	202,668.33

中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	216,676	1,135,382.32
中银国际证 券股份有限 公司	601808	中海油服	1,893	33,722.86
中银国际证 券股份有限 公司	601808	中海油服	1,959	33,550.95

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）
中银国际证 券股份有限 公司	ZYGJZGH HZ5820220 815	中银证券中国 红-汇中 58 号 集合资产管理 计划	10,875,476	10,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYGJZGH HZ5820220 815	中银证券中国 红-汇中 58 号 集合资产管理 计划	32,147,450	30,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202118	中银证券中国 红-汇中 18 号 集合资产管理 计划	238,816,610	268,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202118	中银证券中国 红-汇中 18 号 集合资产管理 计划	275,849,795	310,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202118	中银证券中国 红-汇中 18 号 集合资产管理 计划	53,976,250	60,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	109,051,254	120,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	109,769,484	120,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	117,022,234	130,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	128,440,367	140,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	135,783,471	150,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	136,823,862	150,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	139,790,765	155,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	143,949,618	160,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	206,722,991	230,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	210,564,863	230,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	35,958,288	40,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	359,421,332	400,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	36,023,055	40,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	44,915,559	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	44,964,029	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	45,024,764	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	57,371,824	63,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	623,224,269	680,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	71,987,762	80,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	9,117,433	10,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202120	中银证券中国 红-汇中 20 号 集合资产管理 计划	179,356,112	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202120	中银证券中国 红-汇中 20 号 集合资产管理 计划	32,488,043	36,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202120	中银证券中国 红-汇中 20 号 集合资产管理 计划	58,643,089	65,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220323	中银证券中国 红-汇中 53 号 集合资产管理 计划	141,234,851	148,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220323	中银证券中国 红-汇中 53 号 集合资产管理 计划	30,057,252	31,500,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220323	中银证券中国 红-汇中 53 号 集合资产管理 计划	32,901,011	34,500,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ QHZ55202 20302	中银证券中国 红-汇中 55 号 集合资产管理 计划	281,399,493	300,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQ99Q DII2023062 9	中银证券-中 银理财 99 号 QDII 单一资 产管理计划	48,248,577	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQZLJ C20230228	中银证券中国 红-汇中战略 基础集合资产 管理计划	163,416,494	150,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQZLJ C20230228	中银证券中国 红-汇中战略 基础集合资产 管理计划	167,691,448	150,000,000.00
中银基金管 理有限公司	018581	中银纯债债券 D	27,739,222	31,658,774.41
中银基金管 理有限公司	018581	中银纯债债券 D	31,694,255	35,979,318.20
中银基金管 理有限公司	018581	中银纯债债券 D	5,320,865	6,044,502.36

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	30,465,354.60
产品托管费	中国银行股份有限公司	2,584,209.10
28 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	24,538,276.00
7 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	77,295,569.40
分销买入	中国银行股份有限公司	1,311,637,101.66
分销买入	中银国际证券股份有限公司	249,062,972.20

现券买入	中国银行股份有限公司	896,331,367.54
------	------------	----------------

八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市，在国内经济高质量发展的背景下，资金面大概率维持稳健宽松，债券市场仍有配置机会。但当前债券利率绝对水平处在历史较低水平，债券市场波动率有可能增大。在此背景下，将继续努力挖掘优质票息资产，控制组合久期及杠杆，把握交易机会，在努力控制组合回撤的基础上力争增厚产品收益。

中银理财-稳富固收增强（6个月滚续）2号

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-稳富固收增强（6个月滚续）2号（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

