

中银理财-稳富高信用等级同业存单指数 7 天持有期理财产品

品

2024 年三季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 7 月 1 日至 2024 年 9 月 30 日

一、理财产品基本情况

理财产品代码	CYQCDZS7D
理财产品名称	中银理财-稳富高信用等级同业存单指数 7 天持有期理财产品
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000227
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	2022-05-26
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
CYQCDZS7DA	17,463,932,585.53	1.066729	1.066729	18,629,294,022.91	0.48%
CYQCDZS7DB	19,551,530,528.65	1.068638	1.068638	20,893,513,130.13	0.50%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：104.39%

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	268,039.09	6.78%	1,349,173.28	33.09%
同业存单	-	0.00%	768,398.63	18.84%
拆放同业及买入 返售	97,100.00	2.46%	157,722.83	3.87%
债券	43,036.51	1.09%	1,477,164.78	36.22%
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%	325,356.95	7.98%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	3,544,981.38	89.67%	-	0.00%
合计	3,953,156.98	100%	4,077,816.47	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	680,478.81	16.69%
2	TRADE_7939267：交易所逆回购	97,100.00	2.38%
3	2028006：20 邮储银行永续债	78,110.80	1.92%
4	2028017：20 农业银行永续债 01	71,650.25	1.76%
5	RBBZ21020240131DQ240131041： 存放同业	54,773.18	1.34%
6	112403238：24 农业银行 CD238	49,060.00	1.20%
7	ALAX51-20240927-5：交易所逆回 购	47,763.68	1.17%
8	DQ23052601：存放同业	43,818.25	1.07%
9	Depo_nh_20230921_AX55：存放同 业	41,131.17	1.01%

10	ALAX51-20240830-1：存放同业	38,687.00	0.95%
----	------------------------	-----------	-------

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（稳富高信用级同业存单指数 7 天持有期）
账号	747175779562
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

2024 年三季度，债券市场进一步走强，长端利率创出历史新低，信用债收益率紧跟利率下行，临近季末，受降准降息政策落地和预计的财政刺激政策影响，股市走强对债市也产生较大的压制。资产配置方面，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，努力夯实产品票息收益，阶段性参与波段交易力图增厚组合净值，利用资金面相对宽松的条件，保持产品合适的杠杆率，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 7 月 1 日至 2024 年 9 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	112304059	23 中国银行 CD059	19,201	1,905,883.30
中国银行股份有限公司	112304059	23 中国银行 CD059	19,201	1,905,883.30
中国银行股份有限公司	112304059	23 中国银行 CD059	9,664	959,210.88
中国银行股份有限公司	112304059	23 中国银行 CD059	9,664	959,210.88
中国银行股份有限公司	112304062	23 中国银行 CD062	25,138	2,498,935.17
中国银行股份有限公司	112304062	23 中国银行 CD062	25,138	2,498,935.17
中国银行股份有限公司	112404003	24 中国银行 CD003	41,788	4,148,083.57
中国银行股份有限公司	112404003	24 中国银行 CD003	41,788	4,148,083.57
中国银行股份有限公司	112404004	24 中国银行 CD004	13,688	1,358,713.91
中国银行股份有限公司	112404004	24 中国银行 CD004	13,688	1,358,713.91
中国银行股份有限公司	112404004	24 中国银行 CD004	9,498	940,048.36
中国银行股份有限公司	112404004	24 中国银行 CD004	9,498	940,048.36
中国银行股份有限公司	112404005	24 中国银行 CD005	13,929	1,382,621.59
中国银行股份有限公司	112404005	24 中国银行 CD005	13,929	1,382,621.59
中国银行股份有限公司	112404012	24 中国银行 CD012	12,746	1,258,695.80
中国银行股份有限公司	112404012	24 中国银行 CD012	12,746	1,258,695.80
中国银行股份有限公司	112404015	24 中国银行 CD015	13,665	1,349,171.90
中国银行股份有限公司	112404015	24 中国银行 CD015	13,665	1,349,171.90
中国银行股份有限公司	112404021	24 中国银行 CD021	25,492	2,514,524.32
中国银行股份有限公司	112404021	24 中国银行 CD021	25,492	2,514,524.32

中国银行股份有限公司	112404024	24 中国银行 CD024	23,957	2,370,972.47
中国银行股份有限公司	112404024	24 中国银行 CD024	23,957	2,370,972.47
中国银行股份有限公司	112404025	24 中国银行 CD025	202,714	19,879,734.96
中国银行股份有限公司	112404026	24 中国银行 CD026	12,746	1,261,647.37
中国银行股份有限公司	112404026	24 中国银行 CD026	12,746	1,261,647.37
中国银行股份有限公司	112404029	24 中国银行 CD029	25,492	2,522,624.70
中国银行股份有限公司	112404029	24 中国银行 CD029	25,492	2,522,624.70
中国银行股份有限公司	112404039	24 中国银行 CD039	25,686	2,535,481.26
中国银行股份有限公司	112404039	24 中国银行 CD039	25,686	2,535,481.26
中国银行股份有限公司	112404039	24 中国银行 CD039	6,833	674,610.82
中国银行股份有限公司	112404039	24 中国银行 CD039	6,833	674,610.82
中国银行股份有限公司	112404039	24 中国银行 CD039	6,889	680,620.12
中国银行股份有限公司	112404039	24 中国银行 CD039	6,889	680,620.12
中银国际证 券股份有限 公司	261474	中建保 2A	5,216	521,564.56
中银国际证 券股份有限 公司	261474	中建保 2A	672,309	67,230,920.70
中银国际证 券股份有限 公司	263295	工鑫 15B3	783,740	78,374,035.00

本产品于 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 9 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	012480781	24 恒安国际 SCP001	35,486	3,578,188.44

中国银行股份有限公司	012482573	24 苏农垦 SCP009	428,304	42,830,382.00
中国银行股份有限公司	012483147	24 莆田国资 SCP004	199,500	19,949,986.40
中国银行股份有限公司	032480838	24 龙城发展 PPN003B	4,037	403,698.00
中国银行股份有限公司	082400628	24 申金磐硕 ABN002 优先 (碳中和债)	341,351	34,138,992.67
中国银行股份有限公司	082480876	24 晋租 2 号 ABN002 优先 (绿色)	75,796	7,579,557.00
中国银行股份有限公司	092280033	22 宁波银行二 级资本债 01	18,539	1,966,789.95
中国银行股份有限公司	092280080	22 光大银行二 级资本债 01A	27,694	2,927,233.98
中国银行股份有限公司	092280080	22 光大银行二 级资本债 01A	9,231	975,744.66
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	58,446	6,183,195.53
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	9,269	979,313.99
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	9,269	980,678.95
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	9,269	980,678.95
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	97,409	10,306,816.24
中国银行股份有限公司	092280139	22 交行二级资 本债 02A	18,539	1,938,479.16
中国银行股份有限公司	102000920	20 闽交运 MTN001	23,572	2,398,264.60
中国银行股份有限公司	102100118	21 陕有色 MTN001	58,886	6,263,372.19
中国银行股份有限公司	102281782	22 舟山交投 MTN001	9,231	952,206.16
中国银行股份有限公司	102400896	24 华润电力 MTN001	8,074	807,396.00
中国银行股份有限公司	102482011	24 诚通控股 MTN013A	30,096	3,094,269.02
中国银行股份有限公司	102482742	24 广州控股 MTN002A	97,409	9,763,785.51
中国银行股份有限公司	102482828	24 厦国贸控 MTN009	4,926	492,637.20

中国银行股份有限公司	102482871	24 皖投集 MTN004	9,231	926,613.09
中国银行股份有限公司	102482968	24 川投资 MTN003	35,486	3,561,591.74
中国银行股份有限公司	102482985	24 青岛地铁 MTN001A	360,949	36,094,858.00
中国银行股份有限公司	102483012	24 粤电发 MTN002	4,843	484,324.80
中国银行股份有限公司	102483314	24 相城城建 MTN005	9,231	922,595.28
中国银行股份有限公司	102483341	24 厦国贸控 MTN011	2,162	216,214.10
中国银行股份有限公司	102483359	24 鲁能源 MTN002A	21,621	2,162,141.00
中国银行股份有限公司	102483821	24 北部湾 MTN010	9,723	972,330.00
中国银行股份有限公司	102484024	24 晋城国资 MTN002	5,418	541,750.20
中国银行股份有限公司	102484083	24 中船租 MTN001	1,806	180,583.40
中国银行股份有限公司	102484185	24 闽建工 MTN003	3,533	353,271.40
中国银行股份有限公司	102484254	24 南航股 MTN009	13,423	1,342,287.20
中国银行股份有限公司	102484314	24 云南交投 MTN004	4,972	497,233.50
中国银行股份有限公司	1920091	19 南京银行二 级	23,614	2,440,741.12
中国银行股份有限公司	1920091	19 南京银行二 级	47,314	4,881,581.55
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永 续债	11,829	1,223,845.79
中国银行股份有限公司	198536	24 河北债 46	11,827	1,182,879.48
中国银行股份有限公司	198541	24 湖南债 27	25,456	2,549,099.79
中国银行股份有限公司	198541	24 湖南债 27	31,820	3,182,995.50
中国银行股份有限公司	198541	24 湖南债 27	6,364	637,274.95
中国银行股份有限公司	2020044	20 宁波银行二 级	25,468	2,591,508.69
中国银行股份有限公司	2020044	20 宁波银行二 级	42,446	4,325,365.58

中国银行股份有限公司	2022025	20 招银租赁二级	492,922	50,445,040.71
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	108,285	11,051,451.09
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	200,000	20,496,410.96
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	23,552	2,408,286.54
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	300,000	30,746,358.90
中国银行股份有限公司	2023006	20 农银人寿	985,844	100,904,326.18
中国银行股份有限公司	2023021	20 中邮人寿02	248,640	26,368,314.36
中国银行股份有限公司	2023021	20 中邮人寿02	49,389	5,233,810.67
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	36,095	3,701,311.86
中国银行股份有限公司	2028024	20 中信银行二级	16,979	1,725,217.37
中国银行股份有限公司	2028024	20 中信银行二级	8,489	862,481.35
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	180,474	19,244,839.32
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	49,728	5,098,401.80
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	42,446	4,351,049.83
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	42,446	4,352,323.21
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	739,383	79,015,829.57
中国银行股份有限公司	2028044	20 广发银行二级 01	16,978	1,737,083.90
中国银行股份有限公司	2028044	20 广发银行二级 01	16,979	1,742,834.28
中国银行股份有限公司	2028044	20 广发银行二级 01	16,979	1,742,627.14
中国银行股份有限公司	2028044	20 广发银行二级 01	16,979	1,740,464.07
中国银行股份有限公司	2028044	20 广发银行二级 01	25,468	2,611,251.31
中国银行股份有限公司	2028044	20 广发银行二级 01	60,191	6,361,970.11

中国银行股份有限公司	2028044	20 广发银行二级 01	8,489	869,917.93
中国银行股份有限公司	2028052	20 恒丰银行永续债	149,184	16,004,608.08
中国银行股份有限公司	2123004	21 中邮人寿 01	49,389	5,192,677.96
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永续债 01	100,000	10,575,700.27
中国银行股份有限公司	2128016	21 民生银行永续债 01	500,000	52,575,325.34
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	37,077	3,919,794.20
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	74,154	7,840,010.38
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	9,269	979,058.53
中国银行股份有限公司	2223008	22 仁和人寿	18,462	1,959,835.33
中国银行股份有限公司	2228001	22 邮储银行永续债 01	18,539	1,940,844.98
中国银行股份有限公司	2228001	22 邮储银行永续债 01	18,539	1,942,805.98
中国银行股份有限公司	2228001	22 邮储银行永续债 01	27,808	2,911,267.48
中国银行股份有限公司	2228001	22 邮储银行永续债 01	27,808	2,911,267.48
中国银行股份有限公司	231876	24 安徽 45	11,786	1,178,754.45
中国银行股份有限公司	231917	24 广东 64	12,728	1,281,858.21
中国银行股份有限公司	231917	24 广东 64	12,728	1,281,858.21
中国银行股份有限公司	231917	24 广东 64	44,547	4,486,503.73
中国银行股份有限公司	231917	24 广东 64	6,364	640,929.10
中国银行股份有限公司	231917	24 广东 64	6,364	640,292.71
中国银行股份有限公司	231917	24 广东 64	6,364	640,610.91
中国银行股份有限公司	231917	24 广东 64	6,364	640,929.10
中国银行股份有限公司	231920	24 广东 67	35,421	3,549,847.75

中国银行股份有限公司	231925	24 重庆 27	127,278	12,785,464.30
中国银行股份有限公司	231930	24 四川 36	11,777	1,177,875.79
中国银行股份有限公司	231930	24 四川 36	6,339	633,969.47
中国银行股份有限公司	231971	24 青岛 56	6,447	644,918.01
中国银行股份有限公司	232380009	23 建行二级资本债 01A	9,269	978,549.97
中国银行股份有限公司	232400034	24 杭州银行二级资本债 01	4,037	403,698.00
中国银行股份有限公司	232480014	24 交行二级资本债 01A	9,269	938,665.43
中国银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资本债 02A	1,997	199,728.52
中国银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资本债 02A	17,974	1,797,556.67
中国银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资本债 02A	18,462	1,861,542.21
中国银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资本债 02A	18,462	1,861,333.59
中国银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资本债 02A	19,971	1,997,742.52
中国银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资本债 02A	9,231	929,625.51
中国银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资本债 02A	9,231	924,000.85
中国银行股份有限公司	232480035	24 平安银行二级资本债 01A	9,231	932,578.03
中国银行股份有限公司	232480037	24 交行二级资本债 02A	18,519	1,851,891.20
中国银行股份有限公司	232480038	24 交行二级资本债 02B	10,445	1,057,133.76
中国银行股份有限公司	232480050	24 上海银行二级资本债 01	62,669	6,266,922.00
中国银行股份有限公司	2405282	24 山东债 16	5,914	621,689.77
中国银行股份有限公司	2405579	24 厦门债 26	11,827	1,183,074.42
中国银行股份有限公司	2405579	24 厦门债 26	6,495	649,716.82
中国银行股份有限公司	2405616	24 青岛债 41	6,470	647,064.98

中国银行股份有限公司	2405628	24 新疆债 29	19,368	1,936,359.98
中国银行股份有限公司	2405633	24 陕西债 20	12,912	1,291,223.00
中国银行股份有限公司	2405633	24 陕西债 20	47,309	4,731,480.09
中国银行股份有限公司	2405637	24 山西债 23	6,318	631,862.16
中国银行股份有限公司	2405638	24 山西债 24	12,728	1,296,818.49
中国银行股份有限公司	2405674	24 江西债 46	6,364	635,964.62
中国银行股份有限公司	2405687	24 湖北债 55	11,817	1,181,964.85
中国银行股份有限公司	2405687	24 湖北债 55	6,364	636,555.83
中国银行股份有限公司	2405763	24 河南债 37	12,719	1,276,662.47
中国银行股份有限公司	2405763	24 河南债 37	95,391	9,574,968.53
中国银行股份有限公司	2405766	24 河南债 40	19,078	1,911,178.08
中国银行股份有限公司	2405806	24 江苏债 20	47,228	4,735,680.63
中国银行股份有限公司	2422043	24 中邮消费金融债 01	4,630	462,972.80
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	9,231	997,211.13
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	18,462	1,915,788.43
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	18,462	1,913,419.69
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	18,462	1,882,178.12
中国银行股份有限公司	242400016	24 民生银行永续债 01	39,220	3,921,980.00
中国银行股份有限公司	2489277	24 长金 2 优先	34,307	3,430,875.61
中国银行股份有限公司	272380002	23 太平洋财险债 01	9,231	983,858.14
中国银行股份有限公司	272380002	23 太平洋财险债 01	9,231	986,322.03
中国银行股份有限公司	272480003	24 东方二级资本债 01BC	11,574	1,157,416.50

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	092280065	22 工行二级资本债 03A	19,361	1,985,517.37
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	136,373	14,409,512.32
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	19,482	2,058,201.74
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	27,808	2,933,838.60
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	18,539	1,936,882.49
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	9,269	969,607.67
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	500,000	51,371,180.82
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	108,285	11,074,057.94

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	180,474	18,456,763.23
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	492,922	50,531,619.39
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	108,285	11,017,474.06
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	248,640	25,411,628.07
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	360,949	36,724,913.52
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	360,949	36,722,915.95
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	985,844	100,545,040.20
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	210,670	22,458,214.07

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	246,461	26,156,038.64
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2120089	21 北京银行永续债 01	27,694	2,995,778.37
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2120089	21 北京银行永续债 01	9,231	998,799.57
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2120089	21 北京银行永续债 01	9,269	1,000,586.99
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	3,889	404,966.17
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	13,284	1,413,579.81
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	18,539	1,972,825.27
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	19,926	2,120,369.72

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	55,616	5,918,475.80
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2128038	21 农业银行永续债 01	18,539	1,967,268.92
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	9,269	979,058.04
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	9,269	978,839.29
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	27,694	2,918,765.85
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	9,269	974,880.29
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2228011	22 农业银行永续债 01	18,462	1,937,559.13
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2228011	22 农业银行永续债 01	18,539	1,938,003.70

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2228011	22 农业银行永续债 01	37,077	3,876,963.98
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2228011	22 农业银行永续债 01	9,231	968,896.80
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2228017	22 邮储银行二级 01	27,808	2,914,494.97
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	232380037	23 工行二级资本债 02B	10,445	1,158,492.01
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	232380037	23 工行二级资本债 02B	5,991	656,429.07
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	232380037	23 工行二级资本债 02B	9,986	1,093,978.43
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	232380082	23 浙商银行二级资本债 02	18,462	1,983,328.02
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	9,269	929,300.77

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	232480010	24 浙商银行二级资本债 01	18,462	1,892,822.05
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	232480061	24 工行二级资本债 01A(BC)	18,462	1,848,197.40
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	232480061	24 工行二级资本债 01A(BC)	27,694	2,772,944.13
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	232480061	24 工行二级资本债 01A(BC)	36,925	3,719,285.20
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2420039	24 广州银行小微债 01	5,834	583,398.00
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	9,269	951,158.87
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	46,156	4,672,420.64
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242400019	24 江苏银行永续债 02	3,872	387,211.40

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242400020	24 交行永续债 01BC	18,462	1,857,990.23
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242400020	24 交行永续债 01BC	18,462	1,859,803.22
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242400020	24 交行永续债 01BC	46,156	4,619,731.28
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242480007	24 工行永续债 01	18,462	1,854,288.17
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242480007	24 工行永续债 01	36,925	3,735,304.67
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242480007	24 工行永续债 01	36,925	3,738,646.38
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242480007	24 工行永续债 01	36,925	3,693,211.61
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242480007	24 工行永续债 01	360,949	36,094,858.00

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242480007	24 工行永续债 01	96,865	9,686,496.00
中银国际证券股份有限公司	1580090	15 长沙轨道债 01	121,629	1,871,256.63
中银国际证券股份有限公司	1928020	19 交通银行二级 02	18,462	2,055,230.85
中银国际证券股份有限公司	2028022	20 民生银行二级	180,474	18,368,683.62
中银国际证券股份有限公司	2028022	20 民生银行二级	36,095	3,671,691.23
中银国际证券股份有限公司	2028022	20 民生银行二级	397,824	40,644,226.56
中银国际证券股份有限公司	2028022	20 民生银行二级	99,456	10,162,568.37
中银国际证券股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	16,979	1,723,093.36
中银国际证券股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	25,468	2,586,858.28
中银国际证券股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	25,468	2,584,846.32
中银国际证券股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	360,949	36,765,327.90
中银国际证券股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	42,446	4,308,201.04
中银国际证券股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	445,826	45,535,146.39
中银国际证券股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	492,922	50,330,874.62

中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	99,456	10,175,241.67
中银国际证 券股份有限 公司	2120110	21 北京银行永 续债 02	9,231	981,755.68
中银国际证 券股份有限 公司	232380053	23 农行二级资 本债 02B	10,445	1,173,104.49
中银国际证 券股份有限 公司	232480012	24 农行二级资 本债 02B	2,089	215,078.26
中银国际证 券股份有限 公司	232480012	24 农行二级资 本债 02B	4,178	430,156.52
中银国际证 券股份有限 公司	232480012	24 农行二级资 本债 02B	4,178	430,156.52
中银国际证 券股份有限 公司	232480039	24 广发银行二 级资本债 01A	22,205	2,220,465.00
中银国际证 券股份有限 公司	232480040	24 广发银行二 级资本债 01B	13,323	1,332,279.00
中银国际证 券股份有限 公司	232480040	24 广发银行二 级资本债 01B	2,089	209,213.47
中银国际证 券股份有限 公司	232480040	24 广发银行二 级资本债 01B	8,356	836,853.88
中银国际证 券股份有限 公司	232480067	24 华夏银行永 续债 02	497,280	49,728,033.00
中银国际证 券股份有限 公司	232480067	24 华夏银行永 续债 02	53,038	5,303,824.00
中银国际证 券股份有限 公司	241328	24 吉高 02	154,365	15,414,395.52
中银国际证 券股份有限 公司	241328	24 吉高 02	38,591	3,853,598.88

中银国际证券股份有限公司	241328	24 吉高 02	38,591	3,853,598.88
中银国际证券股份有限公司	2420028	24 重庆银行小微债 01	58,446	5,857,656.19
中银国际证券股份有限公司	2420028	24 重庆银行小微债 01	97,409	9,764,153.26
中银国际证券股份有限公司	242480002	24 兴业银行永续债 01	36,925	3,756,150.85
中银国际证券股份有限公司	242480002	24 兴业银行永续债 01	36,925	3,758,323.96
中银国际证券股份有限公司	242480002	24 兴业银行永续债 01	46,156	4,670,517.93
中银国际证券股份有限公司	242480002	24 兴业银行永续债 01	9,269	934,811.24
中银国际证券股份有限公司	242480002	24 兴业银行永续债 01	9,269	934,602.68
中银国际证券股份有限公司	242480002	24 兴业银行永续债 01	9,269	934,611.95

本产品于 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 9 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	DXZYLCZ YZQ20226 0	中银证券-中银理财 60 号单一资产管理计划	12,144,216	12,766,000.00
中银国际证券股份有限公司	DXZYLCZ YZQ20226 0	中银证券-中银理财 60 号单一资产管理计划	26,628,626	28,000,000.00

中银国际证券股份有限公司	DXZYLCZ YZQ20226 0	中银证券-中 银理财 60 号 单一资产管理 计划	47,501,425	50,000,000.00
中银国际证券股份有限公司	DXZYLCZ YZQ20226 0	中银证券-中 银理财 60 号 单一资产管理 计划	6,655,890	7,000,000.00
中银国际证券股份有限公司	DXZYLCZ YZQ20226 0	中银证券-中 银理财 60 号 单一资产管理 计划	6,657,790	7,000,000.00
中银国际证券股份有限公司	DXZYLCZ YZQ20226 0	中银证券-中 银理财 60 号 单一资产管理 计划	6,659,056	7,000,000.00
中银国际证券股份有限公司	DXZYLCZ YZQ20226 0	中银证券-中 银理财 60 号 单一资产管理 计划	606,895,242	639,000,000.00
中银国际证券股份有限公司	DXZYLCZ YZQ20226 0	中银证券-中 银理财 60 号 单一资产管理 计划	8,085,997	8,500,000.00
中银国际证券股份有限公司	DXZYLCZ YZQ20226 0	中银证券-中 银理财 60 号 单一资产管理 计划	8,563,273	9,000,000.00
中银国际证券股份有限公司	DXZYLCZ YZQ20226 0	中银证券-中 银理财 60 号 单一资产管理 计划	9,501,188	10,000,000.00
中银国际证券股份有限公司	DXZYLCZ YZQ20226 0	中银证券-中 银理财 60 号 单一资产管理 计划	9,509,319	10,000,000.00

本产品于 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 9 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	17,118,345.02
产品托管费	中国银行股份有限公司	2,350,348.04

14 日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	6,050,816.19
1 日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	101,559,606.00
1 日质押式逆回购	中银国际证券股份有限公司	6,096,805.00
7 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	2,335,545.72
7 日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	63,576,762.73
分销买入	中银国际证券股份有限公司	201,158,377.26
分销买入	中国银行股份有限公司	132,853,851.20
现券买入	中国银行股份有限公司	37,569,868.28
现券卖出	中国银行股份有限公司	398,188.91
证券交易佣金	中银国际证券股份有限公司	1,673.56

八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市，9 月末中央政治局会议提出有效落实存量政策，加力推出增量政策，加大财政货币政策逆周期调节力度。货币方面，降准降息落地，存量房贷利率下调，提振市场预期。财政方面，保证必要的财政支出，更好发挥政府投资带动作用。受此影响全市场风险偏好明显提振，债券市场短期内有一定调整压力。债券投资方面以稳健为主，降息之后期限利差走阔，长端利率较此前定价更为合理，将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，转债市场受股市回暖提振估值明显修复，投资价值有所提升。