

# 中银理财“福”（18个月）最短持有期固收增强理财产品 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：中国农业银行股份有限公司

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	FCYQZQ18M
理财产品名称	中银理财“福”（18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	Z7001023000024
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	2023-02-28
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
FCYQZQ18MA	15,033,647,434.50	1.059816	1.059816	15,932,907,205.97	0.28%
FCYQZQ18ML	518,095,909.47	1.061895	1.061895	550,163,517.03	0.31%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：109.79%

### 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	102,774.88	6.23%	112,699.97	6.30%
同业存单	-	0.00%	22,146.63	1.24%
拆放同业及买入返售	-	0.00%	794.10	0.04%
债券	70,869.29	4.30%	1,563,869.40	87.39%
非标准化债权类资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	28,799.23	1.61%
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%	61,253.18	3.42%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	1,474,790.32	89.47%	-	0.00%
合计	1,648,434.48	100%	1,789,562.51	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	112,699.97	6.30%
2	242480007：24 工行永续债 01	16,413.34	0.92%
3	242400009：24 农行永续债 02	15,554.91	0.87%
4	242400004：24 邮储永续债 01	12,775.38	0.71%
5	232480067：24 华夏银行永续债 02	12,204.37	0.68%
6	242480004：24 华夏银行永续债 01	11,873.75	0.66%
7	242400016：24 民生银行永续债 01	11,551.35	0.65%
8	2128016：21 民生银行永续债 01	11,039.49	0.62%
9	240981：24 中化 05	11,022.64	0.62%
10	2028006：20 邮储银行永续债	10,275.71	0.57%

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“福”（18个月）最短持有期固收增强理财产品
账号	11200801040023821
开户行	中国农业银行股份有限公司北京崇文支行

## 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

今年三季度以来，国内债券市场波动加大，债券收益率呈现“W”型走势，尤其在季末，受政策支持力度可能超预期影响，债券收益率加速上行。报告期内，投资经理积极把握债券市场投资机会，对稳健类债券资产积极投资布局，在努力控制净值回撤的同时提升产品收益表现。

### （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）

中国农业银行股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	28,939	2,985,534.25
中国农业银行股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	28,939	2,985,534.25
中国农业银行股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	28,939	2,985,534.25
中国农业银行股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	13,080	1,362,041.03
中国农业银行股份有限公司	1928023	19 农业银行永续债 02	19,620	2,037,700.16
中国农业银行股份有限公司	2028032	20 农业银行永续债 02	54,161	5,546,770.99
中国农业银行股份有限公司	2128038	21 农业银行永续债 01	77,097	8,213,462.27
中国农业银行股份有限公司	2228011	22 农业银行永续债 01	148,453	15,625,385.82
中国农业银行股份有限公司	2228011	22 农业银行永续债 01	25,699	2,702,478.54
中国农业银行股份有限公司	2228011	22 农业银行永续债 01	51,398	5,404,957.07
中国农业银行股份有限公司	2228011	22 农业银行永续债 01	51,398	5,404,957.07
中国农业银行股份有限公司	232380053	23 农行二级资本债 02B	31,959	3,589,445.66
中国农业银行股份有限公司	232380053	23 农行二级资本债 02B	89,038	10,000,257.34
中国农业银行股份有限公司	232480012	24 农行二级资本债 02B	17,808	1,833,458.11

中国农业银行股份有限公司	232480012	24 农行二级资本债 02B	31,959	3,290,464.45
中国农业银行股份有限公司	232480012	24 农行二级资本债 02B	35,615	3,666,916.22
中国农业银行股份有限公司	232480012	24 农行二级资本债 02B	35,615	3,666,916.22
中国农业银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	6,540	659,157.48
中银国际证券股份有限公司	263011	工瑞 9A31	1,560	155,953.70

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）
中国农业银行股份有限公司	012482125	24 新投 SCP002	51,989	5,198,891.00
中国农业银行股份有限公司	012482304	24 浙小商 SCP003	11,112	1,111,175.00
中国农业银行股份有限公司	012482664	24 杭商贸 SCP005	114,855	11,485,534.80
中国农业银行股份有限公司	032480927	24 鄂文旅 PPN001	31,966	3,196,604.00
中国农业银行股份有限公司	032480927	24 鄂文旅 PPN001	85,258	8,525,839.00
中国农业银行股份有限公司	102300467	23 中原豫资 MTN002	15,766	1,651,855.45
中国农业银行股份有限公司	102483198	24 南山开发 MTN002	18,977	1,897,732.50

中国农业银行股份有限公司	102483198	24 南山开发 MTN002	59,200	5,919,993.00
中国农业银行股份有限公司	102483484	24 中建三局 MTN001	115,038	11,503,840.00
中国农业银行股份有限公司	102483607	24 福瑞能源 MTN003	4,379	437,909.20
中国农业银行股份有限公司	102483868	24 甘国投 MTN006	17,070	1,707,000.10
中国农业银行股份有限公司	102483924	24 五矿集 MTN003	7,970	796,980.50
中国农业银行股份有限公司	102484148	24 华东勘测 MTN001(科创 票据)	23,635	2,363,528.20
中国农业银行股份有限公司	102484148	24 华东勘测 MTN001(科创 票据)	49,749	4,974,906.90
中国农业银行股份有限公司	102484148	24 华东勘测 MTN001(科创 票据)	86,816	8,681,581.20
中国农业银行股份有限公司	102484203	24 桂交投 MTN018A	33,166	3,316,604.60
中国农业银行股份有限公司	102484203	24 桂交投 MTN018A	57,877	5,787,720.80
中国农业银行股份有限公司	102484204	24 桂交投 MTN018B	33,166	3,316,604.60
中国农业银行股份有限公司	132480074	24 乌江水电 GN002	115,171	11,517,136.00
中国农业银行股份有限公司	132480074	24 乌江水电 GN002	133,880	13,388,030.50
中国农业银行股份有限公司	132480074	24 乌江水电 GN002	51,640	5,164,002.90

中国农业银行股份有限公司	2028025	20 浦发银行二级 01	31,193	3,290,787.45
中国农业银行股份有限公司	2028025	20 浦发银行二级 01	72,784	7,678,504.04
中国农业银行股份有限公司	2128033	21 建设银行二级 03	102,796	10,912,152.64
中国农业银行股份有限公司	2128033	21 建设银行二级 03	51,398	5,456,076.32
中国农业银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	092280139	22 交行二级资本债 02A	86,816	9,147,885.72
中国农业银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	092280140	22 交行二级资本债 02B	31,959	3,556,604.83
中国农业银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	102400896	24 华润电力 MTN001	3,117	311,712.80
中国农业银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	102400896	24 华润电力 MTN001	70,872	7,087,226.00
中国农业银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	102400896	24 华润电力 MTN001	92,031	9,203,072.00
中国农业银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	102480276	24 中海企业 MTN001A	19,620	2,012,215.48

中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102482968	24 川投资 MTN003	23,734	2,382,110.08
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102483012	24 粤电发 MTN002	1,886	188,610.50
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102483012	24 粤电发 MTN002	18,977	1,897,725.60
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102483012	24 粤电发 MTN002	41,287	4,128,679.40
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102483222	24 兴湘投资 MTN002	584	58,445.90
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102483341	24 厦国贸控 MTN011	11,468	1,146,771.40
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102483341	24 厦国贸控 MTN011	18,431	1,843,140.80
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102483341	24 厦国贸控 MTN011	6,392	639,180.80

中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102483441	24 甘国投 MTN005	31,959	3,195,904.00
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102483873	24 中陕核工 MTN002	1,644	164,449.00
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102483873	24 中陕核工 MTN002	10,862	1,086,242.10
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102483944	24 晋能煤业 MTN012(科创票据)	3,188	318,792.20
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	198536	24 河北债 46	7,910	791,148.80
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	198952	24 安徽 13	3,270	332,139.14
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	55,559	5,706,950.51
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	231738	24 江西 13	1,308	133,807.90

中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	231738	24 江西 13	5,461	558,828.86
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	231876	24 安徽 45	7,883	788,389.78
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	231920	24 广东 67	23,691	2,374,255.18
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	231930	24 四川 36	7,877	787,802.15
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	232188	24 广东 39	1,308	132,326.59
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	232188	24 广东 39	780	78,807.11
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资本债 02A	157,773	15,778,738.79
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资本债 02A	17,530	1,753,193.20

中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资本债 02A	175,303	17,535,946.43
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	232480034	24 建行二级资本债 02B	2,422	242,178.00
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	232480035	24 平安银行二级资本债 01A	19,641	1,978,901.82
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	232480035	24 平安银行二级资本债 01A	19,641	1,984,274.33
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	232480037	24 交行二级资本债 02A	157,866	15,786,648.00
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	232480037	24 交行二级资本债 02A	50,606	5,060,620.00
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	232480037	24 交行二级资本债 02A	54,409	5,441,919.50
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	232480038	24 交行二级资本债 02B	27,197	2,719,664.50

中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	232480038	24 交行二级资本债 02B	31,959	3,234,600.36
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	232480038	24 交行二级资本债 02B	45,341	4,535,003.72
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	232480038	24 交行二级资本债 02B	89,038	9,011,652.21
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2405171	24 浙江债 15	20,889	2,144,096.17
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2405282	24 山东债 16	3,956	415,806.63
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2405415	24 北京债 31	26,112	2,639,232.48
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2405422	24 北京债 38	26,112	2,639,232.48
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2405536	24 河北债 36	26,112	2,647,282.92

中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2405579	24 厦门债 26	7,911	791,279.22
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2405633	24 陕西债 20	31,642	3,164,569.89
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2405687	24 湖北债 55	7,903	790,537.10
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2405806	24 江苏债 20	31,587	3,167,379.30
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	242400016	24 民生银行永续债 01	127,864	12,786,416.00
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	242400016	24 民生银行永续债 01	344,267	34,426,686.00
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	242400016	24 民生银行永续债 01	38,318	3,831,817.50
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	242400016	24 民生银行永续债 01	52,223	5,222,344.00

中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	242400016	24 民生银行永续债 01	621,925	62,192,534.40
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	272480003	24 东方二级资本债 01BC	31,629	3,162,876.00
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	272480003	24 东方二级资本债 01BC	9,481	948,054.40
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	272480003	24 东方二级资本债 01BC	98,665	9,866,524.50
中国农业银行股份有限公司，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	169,945	17,428,638.31
中国农业银行股份有限公司，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	10,398	1,100,507.20
中国农业银行股份有限公司，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	51,989	5,502,536.00

中国农业银行股份有限公司，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	113,658	12,278,188.57
中国农业银行股份有限公司，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	113,658	12,278,188.57
中国农业银行股份有限公司，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	148,453	15,776,609.93
中国农业银行股份有限公司，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	25,699	2,705,805.03
中国农业银行股份有限公司，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	52,591	5,762,056.36

中国农业银行股份有限公司，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	87,652	9,602,812.63
中国农业银行股份有限公司，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	89,038	9,875,691.67
中国农业银行股份有限公司，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	127,864	12,786,416.00
中国农业银行股份有限公司，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	31,493	3,149,344.00
中国农业银行股份有限公司，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	454,632	45,463,210.00

中国农业银行股份有限公司，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	253,030	25,303,008.00
中国农业银行股份有限公司，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	27,205	2,732,497.38
中国农业银行股份有限公司，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	45,341	4,554,162.31
中国农业银行股份有限公司，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	697,686	69,768,555.00
中国农业银行股份有限公司，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	825,736	82,573,588.00

中国农业银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	1928025	19 交通银行永续债	13,080	1,357,458.90
中国农业银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	1928025	19 交通银行永续债	62,411	6,476,124.84
中国银行股份有限公司	012480781	24 恒安国际 SCP001	23,734	2,393,210.51
中国银行股份有限公司	012482260	24 冀建投 SCP002	2,938	293,835.00
中国银行股份有限公司	012482462	24 莆田国资 SCP003	55,709	5,570,915.50
中国银行股份有限公司	012482544	24 华电江苏 SCP014	59,688	5,968,818.50
中国银行股份有限公司	032480659	24 龙城发展 PPN002A	69,948	6,994,846.80
中国银行股份有限公司	032480809	24 经开国控 PPN003	2,922	292,229.50
中国银行股份有限公司	032480837	24 龙城发展 PPN003A	25,810	2,581,049.60
中国银行股份有限公司	032480838	24 龙城发展 PPN003B	12,784	1,278,361.60
中国银行股份有限公司	032480838	24 龙城发展 PPN003B	35,436	3,543,613.00
中国银行股份有限公司	042480496	24 永川高新 CP002	46,534	4,653,423.00
中国银行股份有限公司	082400590	24 惠丰 ABN003 优先 A1	3,188	318,792.20
中国银行股份有限公司	082480693	24 邦鑫 ABN003 优先	1,695	169,524.60
中国银行股份有限公司	082480693	24 邦鑫 ABN003 优先	10,398	1,039,778.20
中国银行股份有限公司	082480714	24 邦鑫 ABN004 优先	377	37,722.10
中国银行股份有限公司	082480785	24 扬帆4号 ABN001 优先 A	3,896	389,641.00

中国银行股份有限公司	082480801	24 惠行 6 号 ABN001 优先 A	5,524	552,419.00
中国银行股份有限公司	082480806	24 星炳 ABN004 优先	33,335	3,333,525.00
中国银行股份有限公司	082480876	24 晋租 2 号 ABN002 优先 (绿色)	1,095	109,526.00
中国银行股份有限公司	082480894	24 睿鸿 ABN009 优先	11,142	1,114,183.10
中国银行股份有限公司	082480926	24 睿鸿 ABN011 优先	23,875	2,387,527.40
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	86,816	8,964,144.31
中国银行股份有限公司	102000920	20 闽交运 MTN001	15,766	1,604,038.32
中国银行股份有限公司	102100118	21 陕有色 MTN001	39,385	4,189,149.75
中国银行股份有限公司	102400853	24 金辉集团 MTN001	761	76,149.20
中国银行股份有限公司	102400871	24 鲁宏桥 MTN008(科创 票据)	6,535	653,672.04
中国银行股份有限公司	102400886	24 鲁宏桥 MTN009(科创 票据)	19,626	1,962,754.16
中国银行股份有限公司	102482828	24 厦国贸控 MTN009	24,291	2,429,117.80
中国银行股份有限公司	102482828	24 厦国贸控 MTN009	39,482	3,948,241.20
中国银行股份有限公司	102482828	24 厦国贸控 MTN009	47,602	4,760,153.20
中国银行股份有限公司	102482828	24 厦国贸控 MTN009	6,283	628,270.40
中国银行股份有限公司	102482834	24 京住总集 MTN001	121,345	12,134,480.50
中国银行股份有限公司	102482882	24 供销 MTN001	1,210	120,979.56
中国银行股份有限公司	102482905	24 甘国投 MTN004	69,948	6,994,846.80
中国银行股份有限公司	102482985	24 青岛地铁 MTN001A	116,281	11,628,092.50
中国银行股份有限公司	102483017	24 中石油 MTN002	11,317	1,131,663.00

中国银行股份有限公司	102483033	24 华为 MTN001	2,330	233,011.50
中国银行股份有限公司	102483051	24 厦国贸控 MTN010	12,140	1,213,959.00
中国银行股份有限公司	102483051	24 厦国贸控 MTN010	464	46,398.60
中国银行股份有限公司	102483090	24 香格里拉 MTN002B(BC )	459	45,897.30
中国银行股份有限公司	102483319	24 吉利汽车 MTN001	114,968	11,496,779.50
中国银行股份有限公司	102483351	24 武汉国投 MTN003A	19,175	1,917,659.03
中国银行股份有限公司	102483351	24 武汉国投 MTN003A	51,621	5,162,099.20
中国银行股份有限公司	102483359	24 鲁能源 MTN002A	184,314	18,431,408.00
中国银行股份有限公司	102483390	24 宁夏国资 MTN001	23,008	2,300,768.00
中国银行股份有限公司	102483530	24 中兴通讯 MTN001(科创 票据)	2,191	219,052.00
中国银行股份有限公司	102483539	24 徐工集团 MTN002(科创 票据)	92,031	9,203,072.00
中国银行股份有限公司	102483604	24 赣投 MTN001	2,190	218,961.00
中国银行股份有限公司	102483618	24 云能投 MTN019	5,474	547,386.50
中国银行股份有限公司	102483627	24 陕延油 MTN012B	113,101	11,310,068.00
中国银行股份有限公司	102483649	24 渝医药 MTN004	12,786	1,278,641.60
中国银行股份有限公司	102483649	24 渝医药 MTN004	34,403	3,440,314.20
中国银行股份有限公司	102483713	24 广州凯得 MTN001B(绿 色混合型科创 票据)	12,786	1,278,641.60
中国银行股份有限公司	102483821	24 北部湾 MTN010	34,403	3,440,314.20
中国银行股份有限公司	102483821	24 北部湾 MTN010	85,350	8,535,000.50

中国银行股份有限公司	102483902	24 甘交建 MTN001	22,935	2,293,542.80
中国银行股份有限公司	102483902	24 甘交建 MTN001	23,337	2,333,736.00
中国银行股份有限公司	102483902	24 甘交建 MTN001	68,195	6,819,481.50
中国银行股份有限公司	102483947	24 红狮 MTN003	6,376	637,584.40
中国银行股份有限公司	102483962	24 荣盛 MTN003	11,155	1,115,537.50
中国银行股份有限公司	102483982	24 洪市政 MTN007	7,909	790,884.50
中国银行股份有限公司	102484024	24 晋城国资 MTN002	50,861	5,086,092.90
中国银行股份有限公司	102484024	24 晋城国资 MTN002	91,203	9,120,311.20
中国银行股份有限公司	102484039	24 中建四局 MTN001(科创 票据)	27,163	2,716,274.00
中国银行股份有限公司	102484080	24 中色 MTN003	114,011	11,401,083.00
中国银行股份有限公司	102484083	24 中船租 MTN001	16,954	1,695,364.30
中国银行股份有限公司	102484083	24 中船租 MTN001	45,604	4,560,433.20
中国银行股份有限公司	102484185	24 闽建工 MTN003	33,166	3,316,604.60
中国银行股份有限公司	102484185	24 闽建工 MTN003	57,877	5,787,720.80
中国银行股份有限公司	102484254	24 南航股 MTN009	126,017	12,601,743.20
中国银行股份有限公司	102484314	24 云南交投 MTN004	29,691	2,969,069.30
中国银行股份有限公司	102484314	24 云南交投 MTN004	46,682	4,668,160.20
中国银行股份有限公司	102484314	24 云南交投 MTN004	69,144	6,914,382.30
中国银行股份有限公司	1920091	19 南京银行二 级	15,794	1,632,448.11
中国银行股份有限公司	1920091	19 南京银行二 级	31,645	3,264,962.82
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	32,700	3,402,531.99

中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	39,007	4,057,666.56
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	26,160	2,706,933.37
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	39,007	4,036,224.05
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永续债	6,540	676,770.52
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	32,700	3,378,019.80
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	7,911	818,548.45
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	15,752	1,610,741.48
中国银行股份有限公司	232400025	24 恒丰银行二级资本债 02	18,857	1,885,722.30
中国银行股份有限公司	232400025	24 恒丰银行二级资本债 02	46,632	4,663,231.20
中国银行股份有限公司	232400025	24 恒丰银行二级资本债 02	726	72,583.20
中国银行股份有限公司	232400034	24 杭州银行二级资本债 01	35,436	3,543,613.00
中国银行股份有限公司	232400034	24 杭州银行二级资本债 01	46,015	4,601,536.00
中国银行股份有限公司	232480050	24 上海银行二级资本债 01	534,231	53,423,061.00
中国银行股份有限公司	2422043	24 中邮消费金融债 01	39,467	3,946,662.00
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	6,540	659,157.48
中国银行股份有限公司	2426008	24 南洋银行 06	3,262	326,216.10
中国银行股份有限公司	2426010	24 南洋银行 08	17,880	1,787,981.80
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	28,939	2,985,534.25
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	28,939	2,985,534.25

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	28,939	2,985,534.25
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	270,807	27,761,941.67
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	54,161	5,546,770.99
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	34,140	3,554,746.33
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	77,097	8,213,462.27
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	148,453	15,625,385.82
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	25,699	2,702,478.54
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	51,398	5,404,957.07

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	51,398	5,404,957.07
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	51,210	5,121,000.30
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	68,195	6,819,481.50
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	112,640	11,263,967.00
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	19,180	1,917,962.40
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	33,989	3,398,896.20
中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	13,080	1,362,041.03
中银国际证券股份有限公司	1928023	19 农业银行永续债 02	19,620	2,037,700.16
中银国际证券股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	105,093	10,733,476.83
中银国际证券股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	128,495	13,119,825.07

中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	24,273	2,477,798.24
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	24,273	2,477,589.50
中银国际证 券股份有限 公司	232380053	23 农行二级资 本债 02B	31,959	3,589,445.66
中银国际证 券股份有限 公司	232380053	23 农行二级资 本债 02B	89,038	10,000,257.34
中银国际证 券股份有限 公司	232480012	24 农行二级资 本债 02B	17,808	1,833,458.11
中银国际证 券股份有限 公司	232480012	24 农行二级资 本债 02B	31,959	3,290,464.45
中银国际证 券股份有限 公司	232480012	24 农行二级资 本债 02B	35,615	3,666,916.22
中银国际证 券股份有限 公司	232480012	24 农行二级资 本债 02B	35,615	3,666,916.22
中银国际证 券股份有限 公司	232480039	24 广发银行二 级资本债 01A	189,286	18,928,600.00
中银国际证 券股份有限 公司	232480039	24 广发银行二 级资本债 01A	52,223	5,222,344.00
中银国际证 券股份有限 公司	232480039	24 广发银行二 级资本债 01A	63,918	6,391,808.00
中银国际证 券股份有限 公司	232480040	24 广发银行二 级资本债 01B	113,572	11,357,160.00
中银国际证 券股份有限 公司	232480040	24 广发银行二 级资本债 01B	17,808	1,783,463.08
中银国际证 券股份有限 公司	232480040	24 广发银行二 级资本债 01B	31,334	3,133,406.40

中银国际证 券股份有限 公司	232480040	24 广发银行二 级资本债 01B	38,351	3,835,084.80
中银国际证 券股份有限 公司	232480040	24 广发银行二 级资本债 01B	71,231	7,133,852.30
中银国际证 券股份有限 公司	232480054	24 重庆银行二 级资本债 01	3,164	314,882.89
中银国际证 券股份有限 公司	232480054	24 重庆银行二 级资本债 01	4,745	472,324.34
中银国际证 券股份有限 公司	232480063	24 东莞银行二 级资本债 02	30,936	3,093,640.00
中银国际证 券股份有限 公司	232480067	24 华夏银行永 续债 02	296,907	29,690,693.00
中银国际证 券股份有限 公司	232480067	24 华夏银行永 续债 02	460,959	46,095,882.00
中银国际证 券股份有限 公司	232480067	24 华夏银行永 续债 02	497,937	49,793,708.80
中银国际证 券股份有限 公司	242400018	24 北京农商行 永续债 01	54,739	5,473,865.00
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	13,080	1,317,261.27
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	13,094	1,330,122.21
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	31,966	3,235,066.15
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	31,966	3,235,066.15
中银国际证 券股份有限 公司	255516	24 漳龙 05	7,119	711,919.00

中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	22,188	2,309,129.10
----------------------	--------	-------	--------	--------------

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	ZYGJZGH HZ5820220 815	中银证券中国 红-汇中 58 号 集合资产管理 计划	10,624,734	10,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202129	中银证券中国 红-汇中 29 号 集合资产管理 计划	61,744,730	70,000,000.00

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	3,933,595.47
分销买入	中国银行股份有限公司	798,255,819.20
分销买入	中银国际证券股份有限公 司	131,766,067.80
现券买入	中国银行股份有限公司	12,654,928.13

## 八、后市展望及下阶段投资策略

随着央行降准、降息落地及债券市场收益率的连续调整，预计债券类资产的配置价值较前期有明显上升，可在合意点位上逐步加仓，力争提升产品的票息收益，同时，积极利用国债等利率品种进行波段交易。