

中银理财-稳富固收增强（6个月滚续）2号 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	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	11,335,612,371.90	1.074724	1.074724	12,182,659,179.36	0.17%
WFZQ6M02B	21,931,181,388.20	1.077218	1.077218	23,624,675,921.65	0.20%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：107.77%

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	225,945.32	6.31%	394,014.90	10.34%
同业存单	-	0.00%	123,083.60	3.23%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	33,197.54	0.87%
债券	214,616.04	6.00%	2,964,470.46	77.78%
非标准化债权类 资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	157,322.12	4.13%
境外投资资产	-	0.00%	39,954.73	1.05%
商品类资产	-	0.00%	-	0.00%
另类资产	-	0.00%	-	0.00%
公募基金	8,357.17	0.23%	99,515.98	2.61%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	3,130,565.42	87.46%	-	0.00%
合计	3,579,483.95	100%	3,811,559.34	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	266,718.89	7.00%
2	360036：工行优 2	37,771.24	0.99%
3	254697：24 交房 01	30,556.32	0.80%
4	092100012：21 长城资本债 01BC	29,821.91	0.78%
5	2223009：22 国任财险	27,301.19	0.72%
6	092280003：22 中国信达债 01	26,324.83	0.69%
7	242400004：24 邮储永续债 01	24,958.34	0.65%
8	148728：24 金街 01	21,047.78	0.55%
9	1928038：19 平安银行永续债 01	20,365.47	0.53%
10	019727：23 国债 24	20,012.34	0.53%

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，债券市场收益率水平波动加大，但整体仍震荡下行，长端利率创出历史新低，信用债收益率紧跟利率下行。投资经理积极抓住市场调整机会，捕捉交易机会，以期追求较好的资本利得收益；同时，投资经理积极拓展低波动资产，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）

中银国际证 券股份有 限公 司	261474	中建保 2A	6,581	658,121.40
中银国际证 券股份有 限公 司	263295	工鑫 15B3	6,951	695,101.00

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	94,779	9,556,949.72
中国银行股份有限公司	012482260	24 冀建投 SCP002	128,749	12,874,912.50
中国银行股份有限公司	012482462	24 莆田国资 SCP003	244,971	24,497,112.50
中国银行股份有限公司	012482544	24 华电江苏 SCP014	262,468	26,246,819.50
中国银行股份有限公司	032480659	24 龙城发展 PPN002A	35,922	3,592,228.20
中国银行股份有限公司	032480809	24 经开国控 PPN003	128,046	12,804,567.50
中国银行股份有限公司	032480838	24 龙城发展 PPN003B	10,106	1,010,628.40
中国银行股份有限公司	042480496	24 永川高新 CP002	23,898	2,389,781.80
中国银行股份有限公司	082400590	24 惠丰 ABN003 优先 A1	51,914	5,191,393.20
中国银行股份有限公司	082400628	24 申金磐硕 ABN002 优先 (碳中和债)	3,719	371,923.58
中国银行股份有限公司	082480693	24 邦鑫 ABN003 优先	189,381	18,938,054.80
中国银行股份有限公司	082480693	24 邦鑫 ABN003 优先	45,722	4,572,240.30
中国银行股份有限公司	082480714	24 邦鑫 ABN004 优先	26,361	2,636,062.70
中国银行股份有限公司	082480785	24 扬帆 4 号 ABN001 优先 A	123,471	12,347,060.00

中国银行股份有限公司	082480801	24 惠行 6 号 ABN001 优先 A	121,305	12,130,484.50
中国银行股份有限公司	082480806	24 星炳 ABN004 优先	146,586	14,658,585.00
中国银行股份有限公司	082480876	24 晋租 2 号 ABN002 优先 (绿色)	24,051	2,405,065.70
中国银行股份有限公司	082480876	24 晋租 2 号 ABN002 优先 (绿色)	700	69,960.90
中国银行股份有限公司	082480894	24 睿鸿 ABN009 优先	48,994	4,899,422.50
中国银行股份有限公司	082480926	24 睿鸿 ABN011 优先	104,987	10,498,727.80
中国银行股份有限公司	092280014	22 上海银行二 级资本债 01	228,721	24,603,745.60
中国银行股份有限公司	092280033	22 宁波银行二 级资本债 01	103,760	11,008,137.28
中国银行股份有限公司	092280080	22 光大银行二 级资本债 01A	155,002	16,383,749.87
中国银行股份有限公司	092280080	22 光大银行二 级资本债 01A	51,667	5,461,249.95
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	343,081	36,323,038.58
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	51,880	5,488,867.02
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	51,880	5,488,867.02
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	51,880	5,481,227.32
中国银行股份有限公司	092280139	22 交行二级资 本债 02A	103,760	10,849,681.63
中国银行股份有限公司	092280139	22 交行二级资 本债 02A	72,871	7,669,370.39
中国银行股份有限公司	092280140	22 交行二级资 本债 02B	25,266	2,811,728.58
中国银行股份有限公司	102000920	20 闽交运 MTN001	62,958	6,405,502.04
中国银行股份有限公司	102100118	21 陕有色 MTN001	157,279	16,728,780.10
中国银行股份有限公司	102281782	22 舟山交投 MTN001	51,667	5,329,504.81

中国银行股份有限公司	102400853	24 金辉集团 MTN001	53,214	5,321,395.60
中国银行股份有限公司	102400871	24 鲁宏桥 MTN008(科创 票据)	40,199	4,020,939.42
中国银行股份有限公司	102400886	24 鲁宏桥 MTN009(科创 票据)	120,726	12,073,508.42
中国银行股份有限公司	102400896	24 华润电力 MTN001	47,263	4,726,270.00
中国银行股份有限公司	102400896	24 华润电力 MTN001	98,776	9,877,648.00
中国银行股份有限公司	102480276	24 中海企业 MTN001A	105,818	10,852,757.66
中国银行股份有限公司	102482828	24 厦国贸控 MTN009	24,446	2,444,593.40
中国银行股份有限公司	102482834	24 京住总集 MTN001	51,245	5,124,541.50
中国银行股份有限公司	102482871	24 皖投集 MTN004	51,667	5,186,260.19
中国银行股份有限公司	102482882	24 供销 MTN001	135,141	13,514,960.67
中国银行股份有限公司	102482882	24 供销 MTN001	446,291	44,629,109.50
中国银行股份有限公司	102482905	24 甘国投 MTN004	35,922	3,592,228.20
中国银行股份有限公司	102482968	24 川投资 MTN003	94,779	9,512,621.74
中国银行股份有限公司	102482985	24 青岛地铁 MTN001A	59,716	5,971,648.00
中国银行股份有限公司	102483012	24 粤电发 MTN002	131,803	13,180,313.50
中国银行股份有限公司	102483012	24 粤电发 MTN002	15,003	1,500,276.30
中国银行股份有限公司	102483017	24 中石油 MTN002	790,819	79,081,881.00
中国银行股份有限公司	102483033	24 华为 MTN001	132,651	13,265,136.00
中国银行股份有限公司	102483051	24 厦国贸控 MTN010	26,414	2,641,434.00
中国银行股份有限公司	102483090	24 香格里拉 MTN002B(BC)	26,129	2,612,891.30

中国银行股份有限公司	102483184	24 京住总集 MTN002	183,757	18,380,857.51
中国银行股份有限公司	102483184	24 京住总集 MTN002	91,878	9,190,428.76
中国银行股份有限公司	102483222	24 兴湘投资 MTN002	25,609	2,560,913.50
中国银行股份有限公司	102483314	24 相城城建 MTN005	51,667	5,163,772.51
中国银行股份有限公司	102483319	24 吉利汽车 MTN001	59,042	5,904,211.50
中国银行股份有限公司	102483341	24 厦国贸控 MTN011	5,053	505,314.20
中国银行股份有限公司	102483351	24 武汉国投 MTN003A	15,159	1,516,034.80
中国银行股份有限公司	102483390	24 宁夏国资 MTN001	11,816	1,181,567.50
中国银行股份有限公司	102483441	24 甘国投 MTN005	25,266	2,526,571.00
中国银行股份有限公司	102483530	24 中兴通讯 MTN001(科创 票据)	48,101	4,810,131.40
中国银行股份有限公司	102483539	24 徐工集团 MTN002(科创 票据)	47,263	4,726,270.00
中国银行股份有限公司	102483604	24 赣投 MTN001	48,081	4,808,133.20
中国银行股份有限公司	102483618	24 云能投 MTN019	120,452	12,045,167.50
中国银行股份有限公司	102483625	24 浦东开发 MTN003	101,500	10,150,037.10
中国银行股份有限公司	102483627	24 陕延油 MTN012B	58,083	5,808,325.50
中国银行股份有限公司	102483649	24 渝医药 MTN004	10,108	1,010,849.60
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)	10,108	1,010,849.60
中国银行股份有限公司	102483873	24 中陕核工 MTN002	26,847	2,684,674.20
中国银行股份有限公司	102483873	24 中陕核工 MTN002	47,960	4,796,316.43
中国银行股份有限公司	102483902	24 甘交建 MTN001	35,022	3,502,168.80

中国银行股份有限公司	102483902	24 甘交建 MTN001	381,749	38,174,925.00
中国银行股份有限公司	102483944	24 晋能煤业 MTN012(科创 票据)	51,914	5,191,393.20
中国银行股份有限公司	102483947	24 红狮 MTN003	103,828	10,382,786.40
中国银行股份有限公司	102483962	24 荣盛 MTN003	181,660	18,166,047.90
中国银行股份有限公司	102483982	24 洪市政 MTN007	131,032	13,103,175.00
中国银行股份有限公司	102484024	24 晋城国资 MTN002	46,838	4,683,768.00
中国银行股份有限公司	102484039	24 中建四局 MTN001(科创 票据)	20,091	2,009,065.60
中国银行股份有限公司	102484044	24 电建河北 MTN001	13,303	1,330,422.12
中国银行股份有限公司	102484080	24 中色 MTN003	58,551	5,855,066.50
中国银行股份有限公司	102484083	24 中船租 MTN001	23,420	2,342,026.60
中国银行股份有限公司	102484314	24 云南交投 MTN004	35,509	3,550,905.30
中国银行股份有限公司	1920091	19 南京银行二 级	126,372	13,038,170.05
中国银行股份有限公司	1920091	19 南京银行二 级	63,070	6,518,952.42
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	176,363	18,351,342.29
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	210,380	21,884,769.42
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	141,091	14,599,674.92
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	210,380	21,769,120.58
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	35,273	3,650,119.25
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永 续债	176,363	18,219,137.37
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永 续债	31,593	3,268,758.16
中国银行股份有限公司	198536	24 河北债 46	31,589	3,159,341.40

中国银行股份有限公司	198541	24 湖南债 27	119,122	11,928,789.71
中国银行股份有限公司	198541	24 湖南债 27	148,903	14,895,173.63
中国银行股份有限公司	198541	24 湖南债 27	29,781	2,982,197.43
中国银行股份有限公司	198952	24 安徽 13	17,636	1,791,371.58
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	62,904	6,432,269.43
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	244,310	25,095,302.74
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	348,269	35,744,106.44
中国银行股份有限公司	2128025	21 建设银行二级 01	58,603	6,201,166.17
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	207,520	21,939,115.96
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	415,040	43,880,593.68
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	51,880	5,479,797.51
中国银行股份有限公司	2223008	22 仁和人寿	103,335	10,969,212.61
中国银行股份有限公司	2228001	22 邮储银行永续债 01	103,760	10,862,923.14
中国银行股份有限公司	2228001	22 邮储银行永续债 01	103,760	10,873,898.83
中国银行股份有限公司	2228001	22 邮储银行永续债 01	155,640	16,294,384.72
中国银行股份有限公司	2228001	22 邮储银行永续债 01	155,640	16,294,384.72
中国银行股份有限公司	2305918	23 厦门债 16	207,557	22,747,362.62
中国银行股份有限公司	231738	24 江西 13	29,453	3,014,008.33
中国银行股份有限公司	231738	24 江西 13	7,055	721,684.50
中国银行股份有限公司	231876	24 安徽 45	31,479	3,148,324.01
中国银行股份有限公司	231917	24 广东 64	208,464	20,995,082.17
中国银行股份有限公司	231917	24 广东 64	29,781	2,999,297.45

中国银行股份有限公司	231917	24 广东 64	29,781	2,996,319.39
中国银行股份有限公司	231917	24 广东 64	29,781	2,997,808.42
中国银行股份有限公司	231917	24 广东 64	29,781	2,999,297.45
中国银行股份有限公司	231917	24 广东 64	59,561	5,998,594.90
中国银行股份有限公司	231917	24 广东 64	59,561	5,998,594.90
中国银行股份有限公司	231920	24 广东 67	94,605	9,481,254.85
中国银行股份有限公司	231925	24 重庆 27	595,612	59,830,970.76
中国银行股份有限公司	231930	24 四川 36	29,664	2,966,729.06
中国银行股份有限公司	231930	24 四川 36	31,456	3,145,977.04
中国银行股份有限公司	231971	24 青岛 56	30,168	3,017,963.64
中国银行股份有限公司	232188	24 广东 39	4,208	425,041.18
中国银行股份有限公司	232188	24 广东 39	7,055	713,695.14
中国银行股份有限公司	232380009	23 建行二级资本债 01A	51,880	5,476,951.14
中国银行股份有限公司	232400014	24 民生银行二级资本债 01	138,372	13,931,103.90
中国银行股份有限公司	232400014	24 民生银行二级资本债 01	69,186	6,957,906.92
中国银行股份有限公司	232400025	24 恒丰银行二级资本债 02	14,908	1,490,786.70
中国银行股份有限公司	232400025	24 恒丰银行二级资本债 02	23,948	2,394,818.80
中国银行股份有限公司	232400025	24 恒丰银行二级资本债 02	81,085	8,108,469.90
中国银行股份有限公司	232400034	24 杭州银行二级资本债 01	23,631	2,363,135.00
中国银行股份有限公司	232480014	24 交行二级资本债 01A	51,880	5,253,717.08
中国银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资本债 02A	103,335	10,417,897.62
中国银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资本债 02A	103,335	10,419,065.30

中国银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资本债 02A	51,667	5,203,120.74
中国银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资本债 02A	51,667	5,171,639.46
中国银行股份有限公司	232480034	24 建行二级资本债 02B	270,544	27,054,364.00
中国银行股份有限公司	232480035	24 平安银行二级资本债 01A	120,820	12,172,837.48
中国银行股份有限公司	232480035	24 平安银行二级资本债 01A	120,820	12,205,885.51
中国银行股份有限公司	232480035	24 平安银行二级资本债 01A	121,452	12,229,708.00
中国银行股份有限公司	232480035	24 平安银行二级资本债 01A	51,667	5,219,646.01
中国银行股份有限公司	232480037	24 交行二级资本债 02A	40,008	4,000,750.40
中国银行股份有限公司	232480038	24 交行二级资本债 02B	25,266	2,557,163.00
中国银行股份有限公司	232480052	24 浦发银行二级资本债 01A	144,044	14,406,935.86
中国银行股份有限公司	2405282	24 山东债 16	15,796	1,660,465.33
中国银行股份有限公司	2405579	24 厦门债 26	30,396	3,040,420.26
中国银行股份有限公司	2405579	24 厦门债 26	31,590	3,159,862.14
中国银行股份有限公司	2405616	24 青岛债 41	30,276	3,028,010.51
中国银行股份有限公司	2405628	24 新疆债 29	90,636	9,061,406.41
中国银行股份有限公司	2405633	24 陕西债 20	126,357	12,637,264.49
中国银行股份有限公司	2405633	24 陕西债 20	60,424	6,042,418.00
中国银行股份有限公司	2405637	24 山西债 23	29,565	2,956,867.27
中国银行股份有限公司	2405638	24 山西债 24	59,561	6,068,603.16
中国银行股份有限公司	2405674	24 江西债 46	29,781	2,976,065.60
中国银行股份有限公司	2405687	24 湖北债 55	29,781	2,978,832.22
中国银行股份有限公司	2405687	24 湖北债 55	31,561	3,156,898.63

中国银行股份有限公司	2405763	24 河南债 37	446,391	44,807,102.53
中国银行股份有限公司	2405763	24 河南债 37	59,519	5,974,280.34
中国银行股份有限公司	2405766	24 河南债 40	89,278	8,943,564.86
中国银行股份有限公司	2405806	24 江苏债 20	126,140	12,648,484.71
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	51,667	5,581,397.95
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	103,335	10,722,681.77
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	103,335	10,709,423.93
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	114,360	11,773,593.62
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	139,308	14,203,275.50
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	211,760	21,658,208.00
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	57,180	5,885,521.69
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	103,335	10,534,564.62
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	35,273	3,555,124.40
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	47,960	4,839,009.61
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	57,180	5,781,093.03
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	57,180	5,781,093.03
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	71,940	7,251,973.62
中国银行股份有限公司	242400016	24 民生银行永 续债 01	101,085	10,108,496.00
中国银行股份有限公司	242400016	24 民生银行永 续债 01	319,392	31,939,196.40
中国银行股份有限公司	242400016	24 民生银行永 续债 01	381,519	38,151,885.00
中国银行股份有限公司	242400016	24 民生银行永 续债 01	841,423	84,142,331.00
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永 续债 01	119,899	12,141,390.11

中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	23,980	2,415,130.28
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	23,980	2,427,052.09
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	23,980	2,412,967.30
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	23,980	2,412,353.61
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	47,960	4,849,149.22
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	71,940	7,214,604.04
中国银行股份有限公司	2426008	24 南洋银行 06	185,712	18,571,190.40
中国银行股份有限公司	2426010	24 南洋银行 08	288,449	28,844,895.20
中国银行股份有限公司	2489277	24 长金 2 优先	334	33,402.81
中国银行股份有限公司	272380002	23 太平洋财险 债 01	51,667	5,506,661.18
中国银行股份有限公司	272380002	23 太平洋财险 债 01	51,667	5,520,451.55
中国银行股份有限公司	272380007	23 人民人寿资本补充 债 01	57,180	5,968,778.23
中国银行股份有限公司	272380007	23 人民人寿资本补充 债 01	68,907	7,189,877.17
中国银行股份有限公司	272480003	24 东方二级资本 债 01BC	25,005	2,500,460.50
中国银行股份有限公司	272480003	24 东方二级资本 债 01BC	415,407	41,540,696.00
中国银行股份有限公司	282480002	24 泰康人寿永续 债 01	22,600	2,260,022.40
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	285,901	30,120,847.55
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	114,360	12,090,910.41

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	155,640	16,420,715.43
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	103,760	10,840,745.06
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	51,880	5,426,901.03
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	228,612	24,196,426.57
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	45,722	4,839,285.31
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	155,002	16,767,393.33
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	51,667	5,590,288.46
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	51,880	5,600,292.46

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	58,369	6,305,507.09
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	58,369	6,305,507.09
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	103,760	11,041,917.02
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	311,280	33,125,751.06
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	103,760	11,010,818.12
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	51,880	5,478,570.44
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	51,880	5,479,794.81
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	155,002	16,336,353.68

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	51,880	5,456,411.90
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	57,180	6,019,107.26
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	103,335	10,844,532.52
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	103,760	10,847,020.44
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	114,360	11,972,210.42
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	207,520	21,699,394.91
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	51,667	5,422,922.44
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	155,640	16,312,448.99

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	103,335	11,100,701.34
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	51,880	5,201,303.01
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	103,335	10,594,138.78
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)	103,335	10,344,374.27
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)	155,002	15,520,188.46
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)	206,669	20,816,866.31
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	35,022	3,502,168.80
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	215,011	22,356,084.32

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	51,880	5,323,642.94
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	258,337	26,151,572.33
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	138,372	13,986,009.77
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	71,940	7,288,439.91
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	95,919	9,719,864.82
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	15,163	1,516,274.40
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	57,847	5,784,650.00
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	76,309	7,630,861.00

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	101,085	10,108,496.00
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	103,335	10,409,332.17
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	103,335	10,399,184.84
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	233,478	23,347,792.00
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	258,337	25,856,669.59
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	284,296	28,581,601.13
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	515,165	51,516,538.00
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	76,309	7,630,861.00

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	103,335	10,378,464.39
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	183,757	18,390,578.23
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	200,037	20,003,684.00
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	206,669	20,925,231.01
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	206,669	20,670,932.24
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	206,669	20,906,527.42
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	358,299	35,829,888.00
中银国际亚洲有限公司	01896	猫眼娱乐	25,284	186,241.11
中银国际亚洲有限公司	01896	猫眼娱乐	25,345	185,971.46
中银国际亚洲有限公司	01896	猫眼娱乐	49,727	391,705.94
中银国际亚洲有限公司	01896	猫眼娱乐	50,298	391,012.47

中银国际证 券股份有限 公司	115444	23 华租 Y1	23,980	2,435,739.61
中银国际证 券股份有限 公司	137883	22 华租 Y2	23,980	2,489,751.48
中银国际证 券股份有限 公司	1928020	19 交通银行二 级 02	103,335	11,503,142.02
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	70,545	7,346,082.65
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	105,818	10,990,207.67
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	336,607	34,928,572.03
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	70,545	7,321,369.19
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	106,734	10,895,677.90
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	106,734	10,894,759.99
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	462,127	47,198,560.94
中银国际证 券股份有限 公司	2120110	21 北京银行永 续债 02	51,667	5,494,893.67
中银国际证 券股份有限 公司	232380004	23 农行二级资 本债 01A	114,360	12,088,989.78
中银国际证 券股份有限 公司	232380053	23 农行二级资 本债 02B	25,266	2,837,691.41
中银国际证 券股份有限 公司	232480011	24 农行二级资 本债 02A	127,279	12,885,085.83

中银国际证 券股份有限 公司	232480012	24 农行二级资 本债 02B	25,266	2,601,327.22
中银国际证 券股份有限 公司	232480039	24 广发银行二 级资本债 01A	50,531	5,053,142.00
中银国际证 券股份有限 公司	232480040	24 广发银行二 级资本债 01B	30,319	3,031,885.20
中银国际证 券股份有限 公司	232480054	24 重庆银行二 级资本债 01	52,413	5,216,900.39
中银国际证 券股份有限 公司	232480054	24 重庆银行二 级资本债 01	78,619	7,825,350.59
中银国际证 券股份有限 公司	232480063	24 东莞银行二 级资本债 02	506,053	50,605,314.00
中银国际证 券股份有限 公司	232480067	24 华夏银行永 续债 02	236,727	23,672,702.00
中银国际证 券股份有限 公司	241205	GC 华租 Y5	23,980	2,401,444.12
中银国际证 券股份有限 公司	241218	凯盛 YK09	71,940	7,196,307.63
中银国际证 券股份有限 公司	241328	24 吉高 02	1,384	138,222.73
中银国际证 券股份有限 公司	241328	24 吉高 02	288,684	28,868,409.00
中银国际证 券股份有限 公司	241328	24 吉高 02	346	34,555.68
中银国际证 券股份有限 公司	241328	24 吉高 02	346	34,555.68
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	183,757	18,409,100.90

中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	275,635	27,582,201.41
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	47,960	4,822,214.17
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	47,960	4,822,990.53
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	71,940	7,247,932.19
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	95,919	9,596,483.05
中银国际证 券股份有限 公司	242400018	24 北京农商行 永续债 01	1,204,517	120,451,675.00
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	119,899	12,088,649.66
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	171,541	17,325,809.44
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	206,669	21,023,203.63
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	206,669	21,035,366.55
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	258,337	26,140,922.83
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	51,880	5,232,145.14
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	51,880	5,230,977.84
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	51,880	5,231,029.72

中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	138,372	13,971,287.02
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	25,271	2,557,530.84
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	25,271	2,557,530.84
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	47,960	4,827,728.49
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	70,545	7,104,565.84
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	71,940	7,271,347.85
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	80,547	8,181,993.33
中银国际证 券股份有限 公司	255516	24 漳龙 05	156,329	15,632,927.05
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	117,980	12,278,147.38
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	20,353	599,602.44
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	68,813	2,830,649.12
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	186,473	1,049,841.96
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	55,111	299,801.22

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	资产管理产品	报告期内买入资产管理产品
-------	------	--------	--------------

	产品代码	简称	数量（单位：份）	总金额（单位：元）
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	41,431,594	47,000,000.00
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	708,968,451	800,000,000.00

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	22,830,363.96
产品托管费	中国银行股份有限公司	1,945,178.06
7 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	10,929,439.44
分销买入	中国银行股份有限公司	1,101,681,850.89
分销买入	中银国际证券股份有限公司	161,110,526.45
现券买入	中国银行股份有限公司	17,272,204.77

八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市，9 月中央政治局会议强调进一步加大财政货币政策的逆周期调节力度。货币政策方面，降准降息落地，存量房贷利率下调，提振市场预期。财政政策方面，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，权益市场情绪有所好转，债券市场短期内面临一定调整压力。债券投资方面以稳健为主，配置时兼顾收益性和流动性两个方面，后续将继续择机配置性价比较高的固定收益资产，保持产品的合理杠杆水平，控制产品久期风险。权益方面，股票市场反弹，转债估值明显修复，投资价值有所提升，后续将继续关注权益资产的配置机会。