

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 12 月 31 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	14,113,896,204.22	1.074356	1.074356	15,163,358,919.89	2.49%
CYQCDZS7DB	12,033,755,592.97	1.076549	1.076549	12,954,938,363.48	2.60%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：104.58%

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	164,061.15	5.84%	1,149,284.69	39.79%
同业存单	-	0.00%	274,485.53	9.50%
拆放同业及买入返售	70,100.00	2.49%	209,953.55	7.27%
债券	61,177.83	2.18%	1,172,984.05	40.61%
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%	81,420.97	2.82%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	2,516,222.53	89.50%	-	0.00%
合计	2,811,561.51	100%	2,888,128.80	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	212,383.49	7.35%
2	ALAX51-20241231-1：交易所逆回购	69,428.81	2.40%
3	2028017：20 农业银行永续债 01	63,193.70	2.19%
4	2028006：20 邮储银行永续债	57,416.49	1.99%
5	RBBZ21020240131DQ240131041：存放同业	54,773.05	1.90%
6	100201030110024123101：存放同业	54,459.79	1.89%
7	ALAX51-20240830-1：存放同业	53,197.19	1.84%
8	TRADE_8339453：交易所逆回购	50,000.00	1.73%
9	ALAX51-20240927-3：存放同业	46,258.45	1.60%

10	ALAX51-20240628-1：存放同业	46,258.36	1.60%
----	------------------------	-----------	-------

注：本表列示穿透后投资规模占比较高的前十名资产

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

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1月1日至2024年12月31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 (香港)有 限公司	292480030	24 中银香港债 01BC	3,477	347,651.80
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	152,124	14,886,446.35
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	112404029	24 中国银行 CD029	3,042,481	299,697,411.92
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	144048	中合 03 优	6,438	643,803.75
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	262298	工瑞 8A1	92,208	9,220,828.35

中银国际证 券股份有 限公 司	263295	工鑫 15B3	783,740	78,374,035.00
中银国际证 券股份有 限公 司	263460	工瑞 8A32	46,415	4,641,459.30

本产品于 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	082400671	24 山西建投 6ABN002 优 先	1,278	127,768.00
中国银行股份有限公司	082400682	24 中交建筑 1ABN001 优 先 B	33,300	3,330,294.03
中国银行股份有限公司	082480307	24 澄熙 ABN006 优先	123,996	12,400,410.78
中国银行股份有限公司	082480316	24 星澜 ABN002 优先	123,604	12,362,782.52
中国银行股份有限公司	082480333	24 澄熙 ABN009 优先	122,944	12,296,751.61
中国银行股份有限公司	082480400	24 中建新疆 2ABN001 优 先(乡村振兴)	66,615	6,662,792.94
中国银行股份有限公司	082480415	24 广能莱州 ABN001 优先	15,675	1,567,481.40
中国银行股份有限公司	082480504	24 邦鑫 ABN002 优先	10,123	1,012,296.80

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	082481227	24 星炳 ABN009 优先	16,650	1,665,121.47
中国银行股份有限公司	082482116	24 山东高速 ABN001 优先	11,658	1,165,752.70
中国银行股份有限公司	082482129	24 和盛 ABN001 优先 A1	63,565	6,356,871.15
中国银行股份有限公司	082482130	24 和盛 ABN001 优先 A2	84,753	8,475,858.71
中国银行股份有限公司	082482197	24 聚润京能 ABN002 优先 (绿色)	42,891	4,289,356.70
中国银行股份有限公司	082482245	24 电投融和 1ABN001(绿色) 优先	59,204	5,921,467.85
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	47,917	5,013,472.21
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	11,282	1,159,183.50
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	26,205	2,733,108.66
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	30,362	3,185,390.74
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	092280139	22 交行二级资本债 02A	6,775	702,337.71
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	102001446	20 陕有色 MTN002	35,117	3,704,777.23
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	102100597	21 陕有色 MTN002	11,826	1,250,170.55
中国银行股份有限公司	102100780	21 中电国际 MTN001	19,420	2,009,974.08
中国银行股份有限公司	102100780	21 中电国际 MTN001	42,140	4,360,466.99
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	102400792	24 夏商 MTN002	7,860	786,018.00
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	102401039	24 京能国际 MTN005(BC)	3,343	334,348.00
中国银行股份有限公司	102401052	24 北部湾投 MTN005B	3,433	343,322.00
中国银行股份有限公司	102480529	24 徐工租赁 MTN001	35,743	3,667,966.80
中国银行股份有限公司	102480721	24 合高建设 MTN001	5,247	529,126.53
中国银行股份有限公司	102481117	24 光大环境 MTN001	13,500	1,358,178.15
中国银行股份有限公司	102481117	24 光大环境 MTN001	20,250	2,037,267.22
中国银行股份有限公司	102481117	24 光大环境 MTN001	6,750	679,089.07
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	102482130	24 青岛华通 MTN001	39,716	3,971,896.35
中国银行股份有限公司	102482178	24 桂交投 MTN011B	5,240	524,012.00
中国银行股份有限公司	102482695	24 北部湾 MTN009	7,513	751,335.30

中国银行股份有限公司	102482742	24 广州控股 MTN002A	12,654	1,265,371.00
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	102482743	24 广州控股 MTN002B	12,654	1,265,371.00
中国银行股份有限公司	102482772	24 豫水利 MTN002	7,592	759,222.60
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	102484494	24 津城建 MTN034	8,269	826,929.00
中国银行股份有限公司	102484638	24 保利发展 MTN006	1,633	163,260.70
中国银行股份有限公司	102484807	24 漳州交通 MTN004	1,657	165,736.30
中国银行股份有限公司	102484823	24 宁夏国资 MTN002	3,315	331,472.60

中国银行股份有限公司	102484837	24 乌江水电 MTN001	8,287	828,681.50
中国银行股份有限公司	102484838	24 贵州高速 MTN012	9,944	994,417.80
中国银行股份有限公司	102485098	24 中陕核工 MTN003	28,354	2,835,399.50
中国银行股份有限公司	102485191	24 桂铁投 MTN001	8,691	869,129.50
中国银行股份有限公司	132480102	24 郑州地铁 GN002	8,287	828,681.50
中国银行股份有限公司	1920059	19 江苏银行二 级	12,535	1,294,528.95
中国银行股份有限公司	1920059	19 江苏银行二 级	2,507	258,905.79
中国银行股份有限公司	1920059	19 江苏银行二 级	25,069	2,589,057.91
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	1928031	19 广发银行永 续债	1,000,000	103,252,435.62
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	100,000	10,325,243.56
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	12,764	1,321,893.28
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	25,069	2,597,313.22
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	51,412	5,329,343.85
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	68,550	7,105,791.80
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	7,023	726,677.08
中国银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	7,521	779,160.87
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永 续债	100,000	10,233,168.22
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永 续债	100,000	10,233,168.22
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	1928036	19 中信银行永 续债	300,000	30,699,504.66

中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	500,000	51,165,841.10
中国银行股份有限公司	1928038	19 平安银行永续债 01	500,000	51,085,947.26
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	199085	24 湖南债 60	11,860	1,185,979.10
中国银行股份有限公司	199085	24 湖南债 60	7,640	763,962.60
中国银行股份有限公司	2020022	20 南京银行二级 01	23,606	2,394,745.65
中国银行股份有限公司	2020022	20 南京银行二级 01	500,000	52,083,164.75
中国银行股份有限公司	2020044	20 宁波银行二级	16,980	1,723,332.01
中国银行股份有限公司	2020044	20 宁波银行二级	23,569	2,491,176.38
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	29,922	3,142,788.81
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	2023001	20 人民财险	21,070	2,136,783.14
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	2023005	20 平安人寿	6,473	656,250.31

中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	60,042	6,171,135.61
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	2023016	20 中财再保险	11,837	1,242,740.95
中国银行股份有限公司	2023021	20 中邮人寿 02	143,063	15,138,022.99
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	100,000	10,147,300.27
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永 续债 01	200,000	20,304,127.67
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	2028003	20 平安银行永 续债 01	44,129	4,514,195.45
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永 续债 01	500,000	50,763,693.15
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永 续债 01	500,000	50,763,693.15
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永 续债 01	61,326	6,331,720.42
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	23,803	2,496,490.27
中国银行股份有限公司	2028024	20 中信银行二 级	42,451	4,301,966.67
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	16,712	1,710,756.75
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	19,420	2,056,112.48
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	33,425	3,427,637.16
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	2028037	20 光大银行永续债	7,023	743,457.85
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	7,194	737,581.31
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	18,384	1,881,471.26
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	400,000	42,096,272.13
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	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	466,788	47,714,170.30
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	47,688	4,880,312.86
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	1,740,464.07
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	1,742,834.28
中国银行股份有限公司	2028044	20 广发银行二级 01	16,980	1,733,796.96
中国银行股份有限公司	2028044	20 广发银行二级 01	16,980	1,733,043.04
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	25,470	2,601,080.04
中国银行股份有限公司	2028044	20 广发银行二级 01	25,470	2,601,355.12
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	2028044	20 广发银行二级 01	8,490	866,530.01
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	2128011	21 邮储银行永 续债 01	16,980	1,751,356.27
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永 续债 01	190,750	20,147,705.31
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永 续债 01	238,438	25,184,631.64
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永 续债 01	42,451	4,378,925.55
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永 续债 01	47,688	5,036,234.86
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永 续债 01	61,432	6,511,035.09
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永 续债 01	61,432	6,512,227.46
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永 续债 01	8,490	875,686.62
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永 续债 01	92,148	9,768,341.19
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	2128017	21 中信银行永 续债	1,000,000	107,101,631.15
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永 续债	16,980	1,749,872.19
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永 续债	476,875	50,041,461.84
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永 续债	65,030	7,015,169.62
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永 续债	7,194	755,349.89
中国银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永 续债	100,000	10,620,493.22
中国银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永 续债	17,986	1,871,771.68
中国银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永 续债	30,716	3,218,513.34
中国银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永 续债	300,000	31,861,479.67
中国银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永 续债	400,000	42,481,972.90

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	11,219	1,186,984.83
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	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	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	2228001	22 邮储银行永续债 01	33,656	3,560,195.24
中国银行股份有限公司	2228001	22 邮储银行永续债 01	56,093	5,934,924.13
中国银行股份有限公司	231814	24 湖南 16	6,555	655,553.20
中国银行股份有限公司	231814	24 湖南 16	6,555	655,553.20
中国银行股份有限公司	231814	24 湖南 16	6,555	655,553.20
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	640,610.91
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	231917	24 广东 64	6,364	640,292.71

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	11,803	1,185,418.91
中国银行股份有限公司	232480014	24 交行二级资本债 01A	11,803	1,185,418.91
中国银行股份有限公司	232480014	24 交行二级资本债 01A	22,563	2,288,108.40
中国银行股份有限公司	232480014	24 交行二级资本债 01A	23,615	2,378,491.07
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	924,000.85
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	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	11,282	1,122,906.21
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	232480052	24 浦发银行二级资本债 01A	22,563	2,234,313.94
中国银行股份有限公司	2405201	24 陕西债 05	68,776	7,327,116.28
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	2405393	24 陕西债 14	137,553	14,747,259.45
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	2420017	24 杭州银行小微债	79,861	7,987,539.20

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	14,685	1,551,934.88
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	22,027	2,326,648.98
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	5,444	573,101.90
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	11,282	1,138,111.66
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	242400009	24 农行永续债 02	22,437	2,298,493.27
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	22,437	2,307,715.41
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	22,563	2,276,223.32
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	33,656	3,451,541.00
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	242400029	24 民生银行永续债 02	16,813	1,681,317.00
中国银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	11,219	1,128,184.98
中国银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	22,200	2,233,659.81
中国银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	22,437	2,256,482.14
中国银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	23,720	2,372,107.63
中国银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	29,550	2,955,040.30
中国银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	37,000	3,723,199.24
中国银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	37,000	3,723,199.24

中国银行股份有限公司	2471229	24 辽宁债 30	8,691	869,129.50
中国银行股份有限公司	2471248	24 黑龙江债 41	3,477	347,547.50
中国银行股份有限公司	2471268	24 安徽债 78	11,660	1,165,979.60
中国银行股份有限公司	2471328	24 吉林债 52	18,401	1,840,134.00
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	986,322.03
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	272380006	23 中财再保险资本补充债 01	23,716	2,519,191.23
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	272480020	24 中华财险资本补充债	32,949	3,294,932.00
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	22,240	2,342,889.12
中国银行股份有限公司	282400001	24 太保寿险永续债 01	11,930	1,204,378.37
中国银行股份有限公司	282400001	24 太保寿险永续债 01	13,060	1,306,020.00
中国银行股份有限公司	292480030	24 中银香港债 01BC	3,477	347,651.80
中国银行股份有限公司	UL536164	24 美团美月 ABN003 优先 A	992,467	99,252,776.47
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	11,219	1,170,944.39

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	11,219	1,160,796.96
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	11,219	1,169,525.40
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	11,282	1,158,149.46
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	092280086	22 农行永续债 02	33,656	3,481,072.59
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	11,219	1,160,051.55

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	11,282	1,183,241.31
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	190311	19 进出 11	2,368	242,410.44
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	190311	19 进出 11	5,960	608,523.42
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	1928013	19 民生银行永续债	500,000	52,173,831.51
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	21,677	2,250,976.71
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	23,674	2,461,758.13

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	32,367	3,359,941.99
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	42,638	4,429,108.20
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	52,053	5,407,338.34
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	8,569	890,818.84
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	12,947	1,315,510.74
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	2020016	20 江苏银行永续债	6,473	657,755.37
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	61,014	6,233,466.34

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	100,000	10,129,290.55
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	11,837	1,205,240.07
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	200,000	20,535,453.15
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	200,000	20,263,506.85
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	200,000	20,979,425.25
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	23,674	2,410,480.14

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	25,894	2,632,388.66
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	300,000	30,803,179.73
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	32,515	3,307,500.88
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	400,000	40,493,367.67
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	2028006	20 邮储银行永续债	500,000	51,334,182.88
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	600,000	62,920,929.84
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	600,000	60,740,051.51

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	71,837	7,307,685.51
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	800,000	81,029,036.71
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	900,000	94,381,394.75
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	1,000,000	104,133,824.66
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	100,000	10,405,037.12
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	200,000	20,811,441.10
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	200,000	20,811,441.10

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	200,000	20,809,101.10
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	219,165	22,709,064.99
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	234,673	23,969,102.45
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	234,673	23,969,102.45
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	300,000	31,217,161.64
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	400,000	41,630,295.89
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	400,000	41,630,295.89
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	400,000	41,630,295.89
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	500,000	52,028,602.74
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	500,000	52,037,869.86
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	95,375	9,739,824.41
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	2028032	20 农业银行永续债 02	25,470	2,592,091.53
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	26,740	2,739,559.32
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	16,712	1,704,814.94
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	186,893	19,055,838.47
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	233,617	23,819,798.09
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	2028041	20 工商银行二级 01	33,425	3,415,118.89
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	46,723	4,763,959.62

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	49,871	5,233,349.73
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2028049	20 工商银行二级 02	12,467	1,324,378.47
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	2128002	21 工商银行二级 01	16,980	1,741,536.57
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2128002	21 工商银行二级 01	42,451	4,352,334.43
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	10,121	1,085,385.27

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	153,580	16,088,374.84
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	20,241	2,170,770.54
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	2128021	21 工商银行永续债 01	43,353	4,644,568.28
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	500,000	53,101,970.55
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	500,000	53,101,970.55
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	9,408	1,009,384.43
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2128028	21 邮储银行二级 01	143,063	14,697,788.30

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2128028	21 邮储银行二级 01	17,986	1,842,627.98
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2128028	21 邮储银行二级 01	95,375	9,796,780.17
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	121,837	13,023,517.36
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	152,297	16,279,396.71

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	153,580	15,843,692.60
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	22,437	2,370,512.01
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	33,845	3,551,701.38
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	2228024	22 工商银行二级 03	79,861	8,298,095.37
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	232280007	22 工行二级资本债 05A	11,219	1,221,908.84
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	232280007	22 工行二级资本债 05A	11,282	1,209,855.43

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	232280008	22 工行二级资本债 05B	25,307	2,863,255.32
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	33,876	3,549,250.79
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)	22,437	2,279,355.47
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	232480073	24 工行二级资本债 02BC	13,102	1,336,616.18
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	232480073	24 工行二级资本债 02BC	13,102	1,336,920.16
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	232480073	24 工行二级资本债 02BC	33,656	3,414,876.97
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	242380033	23 招行永续债 01	13,531	1,427,308.52
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	11,258	1,161,238.63
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	11,258	1,159,286.53
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	5,444	548,753.67
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	5,444	548,503.80
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	5,444	548,753.67
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	11,258	1,139,541.61

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	22,200	2,275,668.58
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	33,751	3,358,515.46
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	40,501	4,033,964.86
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	11,219	1,139,637.60
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	11,219	1,139,637.60
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	11,282	1,123,351.22

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	14,738	1,492,925.07
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	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	22,027	2,239,446.25
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	22,437	2,270,205.78
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	22,563	2,246,197.01
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	33,845	3,369,295.51
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	242400020	24 交行永续债 01BC	7,342	746,235.38
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	7,642	770,107.16
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242400031	24 平安银行永 续债 01	16,673	1,667,260.00
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242400031	24 平安银行永 续债 01	56,290	5,629,342.33
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	11,219	1,141,461.66
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	11,258	1,131,034.72
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	14,800	1,506,998.13
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	22,200	2,260,497.20
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	22,437	2,291,177.29
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	22,516	2,255,960.54
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	30,567	3,097,827.55
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	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	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
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242480070	24 招行永续债 01BC	11,860	1,194,339.07
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242480070	24 招行永续债 01BC	8,407	840,658.50
中银国际证券股份有限公司	092200008	22 农行二级资本债 02A	11,282	1,153,863.31
中银国际证券股份有限公司	092200008	22 农行二级资本债 02A	22,437	2,313,816.17
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	1928006	19 工商银行二级 01	8,344	879,843.00
中银国际证券股份有限公司	1928008	19 农业银行二级 03	33,656	3,818,068.09
中银国际证券股份有限公司	1928011	19 工商银行二级 03	32,367	3,377,102.94
中银国际证券股份有限公司	1928014	19 华夏银行永续债	21,319	2,227,223.86
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	1928020	19 交通银行二级 02	44,875	5,023,451.79

中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	200,000	20,685,427.40
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	28,093	2,909,849.12
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	54,791	5,640,020.61
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	54,791	5,640,416.61
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	500,000	51,554,248.63
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	13,013	1,344,666.91
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	20,241	2,091,671.05
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	200,000	20,610,256.07
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	47,039	4,860,685.85
中银国际证 券股份有限 公司	1928025	19 交通银行永 续债	59,506	6,152,918.03
中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	23,606	2,387,678.11
中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	35,409	3,580,642.58
中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	54,791	5,542,711.13
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	422,412	43,129,586.69
中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二 级	46,935	4,792,176.30
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	16,980	1,718,370.38
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	37,631	3,960,480.51
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	50,941	5,154,535.49
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	500,000	52,312,960.27
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	8,490	859,457.72
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	9,408	990,120.13
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	93,869	9,597,055.30
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	2028033	20 建设银行二 级	11,893	1,253,031.52
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	11,893	1,253,031.52
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	38,292	4,026,124.05
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	212480013	24 交行债 01	79,861	7,994,962.35
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	232480011	24 农行二级资 本债 02A	11,801	1,179,699.43
中银国际证 券股份有限 公司	232480011	24 农行二级资 本债 02A	22,437	2,303,612.57

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	240137	23 吉高 03	12,917	1,349,606.35
中银国际证 券股份有限 公司	240951	24 建工 K2	119,858	11,985,826.20
中银国际证 券股份有限 公司	240951	24 建工 K2	159,358	15,983,258.27
中银国际证 券股份有限 公司	240981	24 中化 05	643,392	64,339,208.00
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	242400011	24 广发银行永 续债 01	152,536	15,253,587.00
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	50,051	5,005,094.00
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	934,602.68
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
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	242480004	24 华夏银行永 续债 01	78,602	7,860,180.00
中银国际证 券股份有限 公司	256057	24 奉投 02	15,608	1,560,819.60

中银国际证 券股份有 限公司	256057	24 奉投 02	2,090	209,003.20
----------------------	--------	----------	-------	------------

本产品于 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	106,424,149	110,000,000.00
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	106,434,446	110,000,000.00
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	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	144,425,188	150,000,000.00
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	163,681,879	170,000,000.00
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	192,752,506	200,000,000.00
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	22,263,092	23,000,000.00
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	232,400,504	240,000,000.00

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	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	289,575,290	300,000,000.00
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	289,952,798	301,000,000.00
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	326,139,089	340,000,000.00
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	384,319,754	400,000,000.00
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	399,653,313	415,000,000.00
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	433,359,014	450,000,000.00
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	469,924,812	500,000,000.00
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	480,676,793	500,000,000.00
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	67,346,546	70,000,000.00
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	67,711,356	70,000,000.00
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	77,406,870	80,000,000.00
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
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	96,311,278	100,000,000.00

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	96,422,717	100,000,000.00
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	96,646,371	100,000,000.00
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	96,777,315	100,000,000.00
中银基金管 理有限公司	018581	中银纯债债券 D	1,137,032	1,291,668.41
中银基金管 理有限公司	018581	中银纯债债券 D	5,927,680	6,765,261.35

本产品于 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	43,323,313.66
产品托管费	中国银行股份有限公司	5,924,829.55
14 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	3,948,243.03
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	中银国际证券股份有限公 司	149,166,356.10
1 日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	101,719,792.01
28 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	5,243,660.00
3 日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	17,773,443.60
7 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	36,990,511.77
7 日质押式逆回购	中银基金管理有限公司	71,669,052.73
分销买入	中银国际证券股份有限公 司	243,783,329.66
分销买入	中国银行股份有限公司	182,637,240.00
存放同业	中国银行股份有限公司	547,912,910.00
现券买入	中国银行股份有限公司	260,040,511.55
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	14,594.37
--------	--------------	-----------

八、后市展望及下阶段投资策略

目前信用债的信用利差、套息空间均处于较低水平，且信用债估值已体现后续的降息预期，保护空间相对不足。目前机构交易拥挤度较高，止盈情绪有所增加。短期内货币宽松可能受到稳汇率和防空转的掣肘，但整体以宽松为主。机构行为方面，短期理财规模难有明显增加，对信用债配置力量的支持或有限。基金公司配置力度也有所下降。但在资产荒的大背景下市场或延续震荡。在后续投资策略上，产品管理人将合理控制产品的杠杆与久期水平，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 2024 年年度理财产品托管人报告

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》、《理财公司理财产品流动性风险管理办法》、《中国人民银行关于规范现金管理类理财产品管理有关事项的通知》等相关法律法规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
2025 年 3 月 13 日