中银理财-（7 个月）最短持有期固收增强理财产品 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	CYQZQ7M
理财产品名称	中银理财-（7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	Z7001022000511
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	2022-10-25
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
CYQZQ7MA	4,817,733,526.56	1.083012	1.083012	5,217,667,536.44	4.25%
CYQZQ7MB	8,320,341,257.04	1.085075	1.085075	9,028,201,616.01	4.35%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：106.32%

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	106,845.27	7.50%	214,318.18	14.28%
同业存单	-	0.00%	6,231.52	0.42%
拆放同业及买入返售	27,253.00	1.91%	53,783.56	3.58%
债券	58,087.07	4.08%	1,041,117.47	69.36%
非标准化债权类资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	34,061.98	2.27%
境外投资资产	-	0.00%	90,985.52	6.06%
商品类资产	-	0.00%	-	0.00%
另类资产	-	0.00%	-	0.00%
公募基金	1,577.78	0.11%	60,632.61	4.04%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	1,230,541.45	86.40%	-	0.00%
合计	1,424,304.58	100%	1,501,130.83	100%

注：报告期末本理财产品持仓金融衍生品 0.22 万元。

四、产品持仓前十项资产

序号	资产名称	持仓（万元）	持仓比例
1	CNY：现金及银行存款	214,318.18	14.28%
2	019733：24 国债 02	32,841.05	2.19%
3	TRADE_8338054：交易所逆回购	27,253.00	1.82%
4	UL555448：24 聚润京能 ABN002 优先(绿色)	19,138.70	1.27%
5	360036：工行优 2	15,627.20	1.04%
6	252204：23 广安 04	15,253.50	1.02%
7	102382196：23 中色 MTN002A	15,102.00	1.01%
8	XS2647834881：BCHINA 4.4772 11/05/26	14,368.74	0.96%

9	115796: 23 信投 C7	13,085.59	0.87%
10	2028022: 20 民生银行二级	12,111.60	0.81%

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（7 个月最短持有期固收增强）
账号	744576271667
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，债券市场延续牛市格局，利率债收益率中枢显著下行，主要由经济基本面弱修复、资金面宽松及机构资产荒下的供需矛盾驱动。期间受政策预期反复（如特别国债发行、收益率曲线管理）及阶段性风险偏好回升影响，收益率出现数次快速上行，但趋势性回调后均重回下行通道。信用债表现尤为突出，信用利差、期限利差持续压缩至历史低位，城投债、二永品种利差收窄最为显著，资金追逐高票息资产逻辑贯穿全年。权益市场全年呈现“先抑后扬”特征，A 股与港股节奏分化，港股年初受海外流动性宽松预期提振率先触底反弹，恒生指数于 3 月见底后快速修复，全年涨幅超 30%，弹性显著高于 A 股。低估值、高股息红利资产（能源、电信）及外资回补仓位的互联网龙头引领反弹，地产链超跌反弹亦贡献超额收益。A 股受国内经济数据波动及存量资金博弈影响，筑底时间更长，主要指数于 9 月末创阶段新低后，在政策组合拳驱动下实现快速反弹，但全年仍录得结构性行情，红利策略及 AI 产业链相对占优，中小盘风格波动剧烈。

在资产配置上，本产品底仓长期持有中高等级信用债，滚动置换性价比更高新券，同时积极把握债券收益率波动机会，捕捉波段交易机会，以期获取资本利得增厚收益，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。权益持仓维持超配港股，于市场见底前净增持权益仓位，并在结构上进一步切换至港股，较好的把握了年度反弹机会，有效对冲了债市急跌。本产品权益持仓主要特征为：低估值、高股息、股价相对低位、产业资本持续回购/增持，且调整时间与空间较为充分的大盘蓝筹风格，以及行业中观维度精选的兼具股债对冲属性、盈利反转、股东回报提升的行业。

(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）
营口港务集团有限公司	102485025	24 营口港 MTN001	126,528	12,652,825.50
中国银行（香港）有限公司	292480030	24 中银香港债 01BC	33,850	3,384,986.00
中国银行股份有限公司	XS2760410535	BCHIN 3.84 01/30/2027	999	1,006,055.55
中国银行股份有限公司	XS2779781488	BCHIN 4.05 03/05/2026	36,070	36,036,815.60
中国银行股份有限公司	XS2780484460	BCHIN 3.65 03/07/2027	1,002	1,003,773.37
中国银行股份有限公司	XS2780484460	BCHIN 3.65 03/07/2027	36,015	36,098,346.60
中国银行股份有限公司	XS2787204036	BCHIN 4.05 03/14/2027	13,000	13,070,200.00
中国银行股份有限公司	XS2791420123	BCHINA 4 03/21/27	1,001	1,006,444.29
中国银行股份有限公司	XS2800257631	BCHINA 5.8 04/09/27	360,000	36,194,400.00

中国银行股份有限公司	XS2805154007	BCHINA 5.2 04/16/27	10,000	10,054,000.00
中国银行股份有限公司	XS2811394951	BCHIN 5.9 04/25/27	3,600	36,196,560.00
中国银行股份有限公司	XS2811479273	BCHIN 5 04/26/27	5,000	50,270,000.00
中国银行股份有限公司	XS2817186906	BCHIN 4.36 05/08/27	13,775	13,870,047.50
中国银行股份有限公司	XS2868768461	BCHINA 4.8 07/25/2027	3,600	36,194,400.00
中国银行股份有限公司	XS2940283315	.BCHIN 4.2 11/08/2026 Corp	150,000	15,116,135.43
中银国际证券股份有限公司	261474	中建保 2A	4,882	488,219.52
中银国际证券股份有限公司	261474	中建保 2A	500,000	50,000,000.00
中银国际证券股份有限公司	261635	工瑞 5 优	2,910	291,042.25
中银国际证券股份有限公司	262776	中恒 07A2	200,000	20,000,000.00
中银集团投资有限公司	102484979	24 中银投资 MTN002B(BC)	17,357	1,735,663.60

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	012480222	24 中核汇能 SCP001	4,276	427,632.90
中国银行股份有限公司	012480781	24 恒安国际 SCP001	13,942	1,393,203.27
中国银行股份有限公司	012480875	24 鲁商 SCP004	4,157	415,680.96
中国银行股份有限公司	012482077	24 滨建投 SCP008	2,078	207,760.70
中国银行股份有限公司	012482260	24 冀建投 SCP002	48,624	4,862,404.00

中国银行股份有限公司	012483982	24 牧原食品 SCP002(绿色)	8,939	893,901.90
中国银行股份有限公司	032280230	22 洛阳城投 PPN002	54,009	5,508,694.95
中国银行股份有限公司	032480809	24 经开国控 PPN003	48,358	4,835,837.00
中国银行股份有限公司	032480986	24 连云城建 PPN001	90,473	9,047,252.40
中国银行股份有限公司	032481533	24 海安开投 PPN005	21,870	2,187,042.40
中国银行股份有限公司	042480135	24 鄂文旅 CP002	123,767	12,376,671.30
中国银行股份有限公司	082400573	24 惠丰 ABN001 优先 A1	1,072	107,198.00
中国银行股份有限公司	082400583	24 惠丰 ABN002 优先 A2	388	38,789.20
中国银行股份有限公司	082400590	24 惠丰 ABN003 优先 A1	18,301	1,830,091.60
中国银行股份有限公司	082400598	24 惠丰 ABN004 优先 A1	3,686	368,606.00
中国银行股份有限公司	082400611	24 惠丰 ABN005 优先 A2	765	76,481.20
中国银行股份有限公司	082400614	24 惠丰 ABN006 优先 A1	4,249	424,853.10
中国银行股份有限公司	082400615	24 惠丰 ABN006 优先 A2	809	80,924.40
中国银行股份有限公司	082400619	24 惠丰 ABN007 优先 A2	407	40,655.00
中国银行股份有限公司	082400682	24 中交建筑 1ABN001 优 先 B	370	36,975.60
中国银行股份有限公司	082400682	24 中交建筑 1ABN001 优 先 B	75,712	7,571,231.20
中国银行股份有限公司	082400743	24 中水 1 号 ABN001 优先	147,027	14,702,683.80

中国银行股份有限公司	082400743	24 中水 1 号 ABN001 优先	2,083	208,326.00
中国银行股份有限公司	082400756	24 电建租赁 ABN001	1,000,000	100,000,000.00
中国银行股份有限公司	082480001	24 惠行 ABN001 优先 A	1,397	139,728.50
中国银行股份有限公司	082480014	24 无锡国联 ABN001 优先 (类 REITs)	10,492	1,049,157.00
中国银行股份有限公司	082480025	24 星睿 ABN001 优先	16,179	1,618,305.69
中国银行股份有限公司	082480025	24 星睿 ABN001 优先	3,886	388,583.70
中国银行股份有限公司	082480054	24 晋租 1 号 ABN001 优先 (绿色)	13,877	1,387,720.40
中国银行股份有限公司	082480078	24 聚润京能 ABN001 优先 (绿色)	78,230	7,822,960.20
中国银行股份有限公司	082480078	24 聚润京能 ABN001 优先 (绿色)	9,957	995,710.50
中国银行股份有限公司	082480438	24 澄欣 ABN001 优先	3,862	386,194.20
中国银行股份有限公司	082480602	24 星睿 ABN006 优先	1,931	193,097.10
中国银行股份有限公司	082480684	24 美团美月 ABN004 优先 A	5,264	526,424.00
中国银行股份有限公司	082480687	24 扬帆 2 号 ABN001 优先 A	3,562	356,161.20
中国银行股份有限公司	082480690	24 惠行 5 号 ABN001 优先 A	2,352	235,208.70
中国银行股份有限公司	082480693	24 邦鑫 ABN003 优先	72,799	7,279,877.50
中国银行股份有限公司	082480695	24 和煦 ABN004 优先 A	18,003	1,800,299.00
中国银行股份有限公司	082480714	24 邦鑫 ABN004 优先	10,133	1,013,314.90

中国银行股份有限公司	082480769	24 星炳 ABN003 优先	1,356	135,569.76
中国银行股份有限公司	082480785	24 扬帆 4 号 ABN001 优先 A	46,631	4,663,052.50
中国银行股份有限公司	082480801	24 惠行 6 号 ABN001 优先 A	45,813	4,581,259.50
中国银行股份有限公司	082480817	24 扬帆 5 号 ABN001 优先 A	444	44,421.20
中国银行股份有限公司	082480869	24 星炳 ABN005 优先	4,956	495,633.60
中国银行股份有限公司	082480876	24 晋租 2 号 ABN002 优先 (绿色)	8,941	894,073.70
中国银行股份有限公司	082480894	24 睿鸿 ABN009 优先	1,859	185,903.20
中国银行股份有限公司	082480901	24 澄景 ABN001 优先	4,502	450,231.60
中国银行股份有限公司	082480926	24 睿鸿 ABN011 优先	1,777	177,684.80
中国银行股份有限公司	082480950	24 星澜 ABN006 优先	4,288	428,792.00
中国银行股份有限公司	082480958	24 扬帆 6 号 ABN001 优先 A	1,203	120,318.24
中国银行股份有限公司	082480982	24 星炳 ABN008 优先	1,417	141,693.95
中国银行股份有限公司	082481054	24 致远 1 号 ABN001 优先 A	3,834	383,388.62
中国银行股份有限公司	082481077	24 澄景 ABN004 优先	3,237	323,697.60
中国银行股份有限公司	082481086	24 致远 2 号 ABN001 优先 A	4,015	401,526.30
中国银行股份有限公司	082481093	24 扬帆 7 号 ABN001 优先 A	351	35,055.80
中国银行股份有限公司	082481144	24 星澜 ABN007 优先	1,869	186,870.00
中国银行股份有限公司	082481144	24 星澜 ABN007 优先	158,327	15,832,691.70

中国银行股份有限公司	082481147	24 星昭 ABN003 优先	701	70,111.60
中国银行股份有限公司	082481161	24 蔚能电池 ABN002 优先	60,570	6,056,984.96
中国银行股份有限公司	082481252	24 星澜 ABN008 优先	28,195	2,819,518.20
中国银行股份有限公司	082481252	24 星澜 ABN008 优先	542	54,158.70
中国银行股份有限公司	082482116	24 山东高速 ABN001 优先	132,716	13,271,603.10
中国银行股份有限公司	082482116	24 山东高速 ABN001 优先	2,006	200,572.90
中国银行股份有限公司	082482116	24 山东高速 ABN001 优先	700,000	70,000,000.00
中国银行股份有限公司	082482197	24 聚润京能 ABN002 优先 (绿色)	2,044	204,386.40
中国银行股份有限公司	082482236	24 康富不动产 2ABN001 优 先	3,844	384,351.00
中国银行股份有限公司	082482236	24 康富不动产 2ABN001 优 先	300,000	30,000,000.00
中国银行股份有限公司	082482236	24 康富不动产 2ABN001 优 先	39,507	3,950,712.90
中国银行股份有限公司	082482245	24 电投融和 1ABN001(绿 色)优先	1,169	116,915.40
中国银行股份有限公司	102280604	22 桂铁投 MTN002	573	58,776.59
中国银行股份有限公司	102281556	22 川水电 MTN001	141,614	14,487,969.23
中国银行股份有限公司	102380408	23 海尔金控 MTN001	36,567	3,833,867.50
中国银行股份有限公司	102382878	23 中交天航 MTN002(科创 票据)	6,615	691,850.88
中国银行股份有限公司	102383134	23 中交天航 MTN003(科创 票据)	13,229	1,333,112.42
中国银行股份有限公司	102400761	24 夏商 MTN001	2,171	217,149.63

中国银行股份有限公司	102400761	24 夏商 MTN001	8,684	868,529.69
中国银行股份有限公司	102400775	24 晋路桥 MTN001(科创 票据)	23,386	2,338,623.00
中国银行股份有限公司	102400787	24 华润 MTN004	21,958	2,195,770.60
中国银行股份有限公司	102400853	24 金辉集团 MTN001	20,456	2,045,569.60
中国银行股份有限公司	102400896	24 华润电力 MTN001	37,304	3,730,442.00
中国银行股份有限公司	102400896	24 华润电力 MTN001	6,817	681,822.67
中国银行股份有限公司	102400948	24 康控 MTN001	28,647	2,864,721.40
中国银行股份有限公司	102400950	24 大唐集 MTN010	143,236	14,323,607.00
中国银行股份有限公司	102400989	24 大悦城 MTN003	37,856	3,785,615.60
中国银行股份有限公司	102400989	24 大悦城 MTN003	96,987	9,698,744.00
中国银行股份有限公司	102401027	24 中粮置业 MTN001	43,593	4,359,692.69
中国银行股份有限公司	102401039	24 京能国际 MTN005(BC)	37,825	3,782,504.60
中国银行股份有限公司	102480362	24 厦国贸控 MTN001	32,328	3,232,799.20
中国银行股份有限公司	102480364	24 云建投 MTN002	3,416	341,587.50
中国银行股份有限公司	102480464	24 陕延油 MTN005	96,944	9,694,436.40
中国银行股份有限公司	102480518	24 北部湾 MTN003	13,993	1,399,257.90
中国银行股份有限公司	102480546	24 津城建 MTN009	139,866	13,986,609.00
中国银行股份有限公司	102480612	24 云建投 MTN004	108,256	10,825,612.80
中国银行股份有限公司	102480612	24 云建投 MTN004	8,682	868,180.00
中国银行股份有限公司	102480753	24 沈阳地铁 MTN002	12,962	1,296,200.80
中国银行股份有限公司	102480773	24 国新租赁 MTN002	1,106	110,634.50

中国银行股份有限公司	102480777	24 北部湾投 MTN001	26,077	2,607,653.40
中国银行股份有限公司	102480777	24 北部湾投 MTN001	86,710	8,671,701.33
中国银行股份有限公司	102480803	24 湘建工 MTN001(科创 票据)	38,640	3,863,970.90
中国银行股份有限公司	102480861	24 厦门海翼 MTN001	41,564	4,156,427.40
中国银行股份有限公司	102480910	24 江西交投 MTN004	68,950	6,895,039.00
中国银行股份有限公司	102480928	24 皖能源 MTN002	12,453	1,245,272.40
中国银行股份有限公司	102480985	24 兴业资产 MTN001	100,000	10,000,758.90
中国银行股份有限公司	102481040	24 青岛城投 MTN003	13,761	1,376,126.30
中国银行股份有限公司	102481056	24 西部矿业 MTN001(可持 续挂钩)	13,776	1,377,564.70
中国银行股份有限公司	102481133	24 厦国贸控 MTN004	41,136	4,113,937.33
中国银行股份有限公司	102481207	24 鄂联投 MTN002	27,424	2,742,410.00
中国银行股份有限公司	102481215	24 保利发展 MTN003	41,136	4,113,615.00
中国银行股份有限公司	102481311	24 吴中国太 MTN001	24,905	2,490,544.80
中国银行股份有限公司	102481317	24 武商市集 MTN002	12,412	1,241,187.10
中国银行股份有限公司	102481323	24 厦国贸控 MTN005	49,647	4,964,748.40
中国银行股份有限公司	102481333	24 福州古厝 MTN003	24,824	2,482,374.20
中国银行股份有限公司	102481436	24 联发集 MTN003	37,126	3,712,559.70
中国银行股份有限公司	102481596	24 中国绿发 MTN001	124,435	12,443,541.00
中国银行股份有限公司	102481752	24 中铁置业 MTN001	49,404	4,940,362.40
中国银行股份有限公司	102481872	24 通汇投资 MTN002	44,426	4,442,638.55
中国银行股份有限公司	102481936	24 泉州城建 MTN001	121,922	12,192,165.00

中国银行股份有限公司	102482024	24 鲁高速 MTN005	58,534	5,853,424.00
中国银行股份有限公司	102482086	24 云南交投 MTN001	147,950	14,795,046.50
中国银行股份有限公司	102482095	24 保利发展 MTN004	146,496	14,649,557.00
中国银行股份有限公司	102482128	24 香格里拉 MTN001BC	21,958	2,195,770.60
中国银行股份有限公司	102482128	24 香格里拉 MTN001BC	500,000	50,003,424.66
中国银行股份有限公司	102482135	24 南山开发 MTN001A	54,894	5,489,426.50
中国银行股份有限公司	102482363	24 云建投 MTN012	88,533	8,853,297.60
中国银行股份有限公司	102482377	24 两江产业 MTN002(科创 票据)	6,052	606,122.10
中国银行股份有限公司	102482377	24 两江产业 MTN002(科创 票据)	9,077	909,183.15
中国银行股份有限公司	102482410	24 湖北宏泰 MTN002	87,832	8,783,199.20
中国银行股份有限公司	102482834	24 京住总集 MTN001	500,000	50,003,369.86
中国银行股份有限公司	102482882	24 供销 MTN001	51,949	5,195,214.50
中国银行股份有限公司	102483012	24 粤电发 MTN002	50,666	5,066,574.50
中国银行股份有限公司	102483017	24 中石油 MTN002	303,994	30,399,447.00
中国银行股份有限公司	102483033	24 华为 MTN001	50,098	5,009,777.50
中国银行股份有限公司	102483051	24 厦国贸控 MTN010	9,976	997,577.20
中国银行股份有限公司	102483090	24 香格里拉 MTN002B(BC)	9,868	986,797.60
中国银行股份有限公司	102483222	24 兴湘投资 MTN002	9,672	967,167.40
中国银行股份有限公司	102483358	24 首都机场 MTN002B	34,085	3,408,725.78
中国银行股份有限公司	102483530	24 中兴通讯 MTN001(科创 票据)	17,881	1,788,147.40

中国银行股份有限公司	102483604	24 赣投 MTN001	17,874	1,787,404.60
中国银行股份有限公司	102483604	24 赣投 MTN001	20,293	2,029,257.60
中国银行股份有限公司	102483618	24 云能投 MTN019	44,684	4,468,380.00
中国银行股份有限公司	102483618	24 云能投 MTN019	46,242	4,464,347.29
中国银行股份有限公司	102483625	24 浦东开发 MTN003	41,730	4,173,032.40
中国银行股份有限公司	102483627	24 陕延油 MTN012B	476,313	47,631,282.50
中国银行股份有限公司	102483779	24 赣水投 MTN005A	155,021	15,502,102.40
中国银行股份有限公司	102483779	24 赣水投 MTN005A	33,824	3,382,650.34
中国银行股份有限公司	102483830	24 保定长城 MTN001	44,090	4,386,824.58
中国银行股份有限公司	102483873	24 中陕核工 MTN002	8,684	868,489.06
中国银行股份有限公司	102483873	24 中陕核工 MTN002	8,734	873,391.30
中国银行股份有限公司	102483902	24 甘交建 MTN001	141,617	14,161,701.00
中国银行股份有限公司	102483944	24 晋能煤业 MTN012(科创 票据)	18,301	1,830,091.60
中国银行股份有限公司	102483944	24 晋能煤业 MTN012(科创 票据)	71,137	7,113,685.60
中国银行股份有限公司	102483947	24 红狮 MTN003	36,602	3,660,183.20
中国银行股份有限公司	102483962	24 荣盛 MTN003	64,040	6,403,971.00
中国银行股份有限公司	102483982	24 洪市政 MTN007	45,402	4,540,233.00
中国银行股份有限公司	102484039	24 中建四局 MTN001(科创 票据)	114,589	11,458,885.60
中国银行股份有限公司	102484039	24 中建四局 MTN001(科创 票据)	27,059	2,706,813.43
中国银行股份有限公司	102484044	24 电建河北 MTN001	200,530	20,053,049.80

中国银行股份有限公司	102484062	24 淮河能源 MTN002	114,589	11,458,885.60
中国银行股份有限公司	102484089	24 云能投 MTN021	28,647	2,864,721.40
中国银行股份有限公司	102484110	24 华电云南 MTN001(两 新)	143,236	14,323,607.00
中国银行股份有限公司	102484140	24 云南发电 MTN002(绿 色)	114,589	11,458,885.60
中国银行股份有限公司	102484199	24 豫航空港 MTN019	113,091	11,309,065.50
中国银行股份有限公司	102484250	24 奔驰财务 MTN001A(BC)	226,181	22,618,131.00
中国银行股份有限公司	102484433	24 龙岩高速 MTN001(革命 老区)	18,928	1,892,807.80
中国银行股份有限公司	102484446	24 鲁商 MTN005	35,268	3,526,816.00
中国银行股份有限公司	102484451	24 河钢集 MTN018	35,268	3,526,816.00
中国银行股份有限公司	102484495	24 大通开发 MTN001	28,370	2,836,953.60
中国银行股份有限公司	102484541	24 沈阳地铁 MTN007	47,283	4,728,256.00
中国银行股份有限公司	102484635	24 益航资产 MTN001	94,797	9,479,716.50
中国银行股份有限公司	102484688	24 凌源钢铁 MTN001	91,264	9,126,448.00
中国银行股份有限公司	102484783	24 鲁商 MTN006	52,225	5,222,454.00
中国银行股份有限公司	102484796	24 湘建工 MTN003	26,129	2,612,916.60
中国银行股份有限公司	102484796	24 湘建工 MTN003	37,919	3,791,886.60
中国银行股份有限公司	102484830	24 悦达 MTN005	17,406	1,740,616.40
中国银行股份有限公司	102484919	24 鲁高速 MTN008	94,563	9,456,261.50
中国银行股份有限公司	102484979	24 中银投资 MTN002B(BC)	17,357	1,735,663.60

中国银行股份有限公司	102484992	24 青国投 MTN001	147,531	14,753,140.60
中国银行股份有限公司	102485002	24 漳州发展 MTN001	16,936	1,693,568.00
中国银行股份有限公司	102485005	24 中色 MTN005	50,611	5,061,130.20
中国银行股份有限公司	102485434	24 云建投 MTN018	25,700	2,570,040.30
中国银行股份有限公司	102485505	24 新投创业 MTN001(科创 票据)	43,569	4,356,929.50
中国银行股份有限公司	132480009	24 河钢集 GN002	161,574	16,157,394.00
中国银行股份有限公司	132480020	24 南京地铁 GN002(碳中和 债)	27,504	2,750,371.40
中国银行股份有限公司	132480026	24 新奥天然气 GN001	13,776	1,377,564.70
中国银行股份有限公司	132480027	24 金融城建 GN001	13,776	1,377,564.70
中国银行股份有限公司	132480056	24 河钢集 GN005	285,090	28,508,963.60
中国银行股份有限公司	132480083	24 华能水电 GN004(乡村振 兴)	176,746	17,674,564.50
中国银行股份有限公司	132480083	24 华能水电 GN004(乡村振 兴)	33,824	3,382,599.37
中国银行股份有限公司	132480154	24 三峡 GN003(碳中和 债)	8,439	843,935.30
中国银行股份有限公司	198513	24 深圳债 21	1,380	137,587.05
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永 续债 01	17,369	1,776,153.28
中国银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永 续债 01	4,342	444,051.35
中国银行股份有限公司	2028024	20 中信银行二 级	13,026	1,369,449.37
中国银行股份有限公司	2028024	20 中信银行二 级	2,968	313,033.93
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永 续债	21,711	2,310,473.20

中国银行股份有限公司	212480009	24 上海银行债 01	200,000	20,000,000.00
中国银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永 续债	199,533	20,740,412.99
中国银行股份有限公司	232380026	23 厦门国际二 级资本债 01	13,229	1,407,711.32
中国银行股份有限公司	232400025	24 恒丰银行二 级资本债 02	31,169	3,116,934.00
中国银行股份有限公司	232480014	24 交行二级资 本债 01A	476,313	48,525,651.83
中国银行股份有限公司	232480014	24 交行二级资 本债 01A	498,003	50,371,680.95
中国银行股份有限公司	232480020	24 兴业银行二 级资本债 01	199,201	20,188,102.78
中国银行股份有限公司	232480020	24 兴业银行二 级资本债 01	298,802	30,282,154.17
中国银行股份有限公司	232480020	24 兴业银行二 级资本债 01	34,370	3,436,999.50
中国银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资 本债 02A	155,021	15,541,325.90
中国银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资 本债 02A	233,224	23,353,337.33
中国银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资 本债 02A	46,645	4,670,667.47
中国银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资 本债 02A	498,003	49,800,334.00
中国银行股份有限公司	232480034	24 建行二级资 本债 02B	103,998	10,399,825.00
中国银行股份有限公司	2422004	24 兴业消费金 融债 01	14,107	1,410,654.20
中国银行股份有限公司	2422007	24 招银金租债 01	26,077	2,607,653.40
中国银行股份有限公司	2422013	24 兴业消费金 融债 02	13,216	1,321,569.20
中国银行股份有限公司	2422015	24 招联消费金 融债 03	11,956	1,195,649.00
中国银行股份有限公司	2422024	24 招联消费金 融债 04	38,080	3,807,975.90
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	13,026	1,377,589.61
中国银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	8,684	918,088.64
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	21,095	2,167,396.63

中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	138,560	13,856,032.00
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	206,851	20,685,117.00
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	13,026	1,313,145.17
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	206,890	20,689,041.00
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	498,003	50,335,633.70
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	498,831	50,285,384.80
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	548,943	54,894,265.00
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	8,684	876,219.69
中国银行股份有限公司	242400016	24 民生银行永 续债 01	190,525	19,046,068.81
中国银行股份有限公司	242400016	24 民生银行永 续债 01	190,525	19,041,629.58
中国银行股份有限公司	242400016	24 民生银行永 续债 01	312,796	31,279,580.50
中国银行股份有限公司	242400016	24 民生银行永 续债 01	476,313	47,615,172.04
中国银行股份有限公司	242400016	24 民生银行永 续债 01	95,263	9,521,919.83
中国银行股份有限公司	242400029	24 民生银行永 续债 02	34,817	3,481,664.40
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永 续债 01	13,026	1,306,378.50
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永 续债 01	21,711	2,198,492.25
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永 续债 01	218,853	21,885,256.00
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永 续债 01	4,342	437,317.73
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永 续债 01	4,342	436,926.07
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永 续债 01	4,342	439,476.47
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永 续债 01	4,342	436,814.95
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永 续债 01	8,684	878,055.71

中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	8,684	858,965.75
中国银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	164,812	16,481,154.00
中国银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	245,110	24,511,032.00
中国银行股份有限公司	2426008	24 南洋银行 06	70,137	7,013,688.50
中国银行股份有限公司	2426010	24 南洋银行 08	99,947	9,994,717.70
中国银行股份有限公司	2489031	24 汇聚融 1A2_bc	13,855	1,385,475.80
中国银行股份有限公司	262480001	24 江苏金租绿债 01	15,912	1,591,215.40
中国银行股份有限公司	262480003	24 江苏金租绿债 02	13,038	1,303,826.70
中国银行股份有限公司	272480003	24 东方二级资本债 01BC	156,885	15,688,467.20
中国银行股份有限公司	272480020	24 中华财险资本补充债	8,684	864,982.16
中国银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	28,127	2,865,464.77
中国银行股份有限公司	282400001	24 太保寿险永续债 01	53,657	5,365,708.00
中国银行股份有限公司	282480002	24 泰康人寿永续债 01	12,399	1,268,017.22
中国银行股份有限公司	282480002	24 泰康人寿永续债 01	300,000	30,000,000.00
中国银行股份有限公司	282480002	24 泰康人寿永续债 01	399,065	39,906,505.60
中国银行股份有限公司	282480011	24 平安人寿永续债 01	24,799	2,485,340.12
中国银行股份有限公司	282480011	24 平安人寿永续债 01	6,200	621,335.03
中国银行股份有限公司	292480005	24 创兴银行二级资本债 01BC	21,688	2,168,803.80
中国银行股份有限公司	292480021	24 大华银行债 01	94,640	9,464,039.00
中国银行股份有限公司	292480030	24 中银香港债 01BC	33,850	3,384,986.00
中国银行股份有限公司	UL526620	24 星睿 ABN002 优先	13,061	1,306,098.30

中国银行股份有限公司	UL543338	24 鲁高速 MTN007	94,797	9,479,716.50
中国银行股份有限公司	UL555448	24 聚润京能 ABN002 优先 (绿色)	1,900,000	190,000,000.00
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	285,788	30,196,906.87
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	95,263	10,065,635.62
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	95,263	10,063,666.17
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	21,711	2,214,987.04
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	306,656	31,053,928.22
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	122,662	12,774,309.74
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	153,328	15,967,768.92

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	21,711	2,203,054.82
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	30,666	3,193,577.44
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	18,003	1,918,357.28
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	41,032	4,337,169.26
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	20,516	2,143,282.46
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	498,831	51,837,633.06
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	54,009	5,636,598.06
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	25,248	2,686,680.76

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	37,872	4,030,021.14
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	476,313	50,060,491.70
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2228018	22 邮储银行二级 02	116,266	12,951,323.46
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2228018	22 邮储银行二级 02	232,532	25,902,646.91
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242400004	24 邮储永续债 01	1,000,000	100,000,000.00
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	137,901	13,790,078.00
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	298,802	30,629,469.75
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	99,601	10,209,823.25

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	99,601	10,209,823.25
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	206,890	20,689,041.00
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	25,664	2,566,419.00
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	13,026	1,319,748.27
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	17,369	1,760,016.54
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	44,536	4,453,643.60
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	387,553	38,755,256.00
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	67,648	6,764,791.00

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	191,110	19,111,022.00
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	67,648	6,764,791.00
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	52,312	5,231,172.60
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	18,155	1,815,464.40
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	46,645	4,692,679.46
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	997,663	99,766,264.00
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	189,594	18,959,433.00
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	64,912	6,491,213.00
中银国际亚洲有限公司	01896	猫眼娱乐	25,619	188,701.96
中银国际亚洲有限公司	01896	猫眼娱乐	25,679	188,428.75

中银国际亚洲有限公司	01896	猫眼娱乐	50,384	396,881.61
中银国际亚洲有限公司	01896	猫眼娱乐	50,962	396,178.98
中银国际亚洲有限公司	09988	阿里巴巴-W	7,068	692,996.41
中银国际亚洲有限公司	09988	阿里巴巴-W	7,543	664,963.29
中银国际证券股份有限公司	113052	兴业转债	7,904	846,468.36
中银国际证券股份有限公司	115444	23 华租 Y1	4,342	441,049.55
中银国际证券股份有限公司	115778	23 交租 Y1	13,026	1,317,760.18
中银国际证券股份有限公司	137883	22 华租 Y2	4,342	450,829.71
中银国际证券股份有限公司	148717	24 中航 K4	59,083	5,916,672.54
中银国际证券股份有限公司	1928008	19 农业银行二级 03	199,201	22,296,509.76
中银国际证券股份有限公司	1928008	19 农业银行二级 03	199,201	22,286,241.88
中银国际证券股份有限公司	1928008	19 农业银行二级 03	99,601	11,143,120.94
中银国际证券股份有限公司	1928021	19 农业银行永续债 01	144,024	15,006,592.67
中银国际证券股份有限公司	2028013	20 农业银行二级 01	153,328	15,867,067.46
中银国际证券股份有限公司	2028018	20 交通银行二级	122,662	12,714,363.19
中银国际证券股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	153,328	16,040,969.71

中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	1,484	157,173.26
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	108,018	11,449,846.45
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	30,666	3,210,983.96
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	61,331	6,421,967.92
中银国际证 券股份有限 公司	232380074	23 农行二级资 本债 03B	34,482	3,762,319.65
中银国际证 券股份有限 公司	232480011	24 农行二级资 本债 02A	498,003	50,281,548.49
中银国际证 券股份有限 公司	232480011	24 农行二级资 本债 02A	498,831	50,233,994.24
中银国际证 券股份有限 公司	232480039	24 广发银行二 级资本债 01A	15,129	1,512,976.94
中银国际证 券股份有限 公司	232480054	24 重庆银行二 级资本债 01	18,161	1,807,649.16
中银国际证 券股份有限 公司	232480054	24 重庆银行二 级资本债 01	27,241	2,711,473.74
中银国际证 券股份有限 公司	232480063	24 东莞银行二 级资本债 02	187,730	18,772,986.00
中银国际证 券股份有限 公司	232480067	24 华夏银行永 续债 02	135,296	13,529,582.00
中银国际证 券股份有限 公司	232480067	24 华夏银行永 续债 02	452,363	45,236,262.00
中银国际证 券股份有限 公司	241072	凯盛 YK07	4,342	439,519.04

中银国际证 券股份有限 公司	241205	GC 华租 Y5	4,342	434,839.52
中银国际证 券股份有限 公司	241218	凯盛 YK09	13,026	1,303,065.50
中银国际证 券股份有限 公司	2420002	24 北部湾银行 小微债 01	16,185	1,618,507.30
中银国际证 券股份有限 公司	2420049	24 东莞银行 03	18,253	1,825,289.60
中银国际证 券股份有限 公司	2422017	24 汇通金租债 01	245,052	24,505,204.00
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	13,026	1,312,413.37
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	17,369	1,737,675.29
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	199,201	20,007,477.66
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	298,802	29,996,050.44
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	439,160	43,915,996.00
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	67,854	6,713,440.49
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	8,684	873,178.47
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	8,684	873,319.05
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	99,601	10,003,738.82

中银国际证 券股份有限 公司	242400018	24 北京农商行 永续债 01	446,838	44,683,800.00
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	137,927	13,792,694.00
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	200,000	20,243,610.68
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	21,711	2,188,942.31
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	298,802	30,132,925.91
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	99,601	10,048,800.63
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	99,601	10,044,308.64
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	116,266	11,772,153.17
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	13,026	1,316,653.34
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	199,201	20,089,863.78
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	21,711	2,175,101.37
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	233,224	23,591,854.20
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	298,802	30,134,795.67
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	379,541	37,954,066.50

中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	77,511	7,848,102.11
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	8,684	874,176.97
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	93,290	9,436,741.68
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	997,944	100,867,929.50
中银国际证 券股份有限 公司	253444	24 岷交 D1	64,387	6,438,656.50
中银国际证 券股份有限 公司	254165	24 厦国 K1	48,291	4,829,064.75
中银国际证 券股份有限 公司	255516	24 漳龙 05	58,115	5,811,479.05
中银国际证 券股份有限 公司	360034	光大优 3	110,402	11,756,733.47
中银国际证 券股份有限 公司	360034	光大优 3	217,133	22,644,801.09
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	105,890	10,624,975.01
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	161,013	16,320,326.33
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	217,133	22,039,000.01
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	79,020	8,182,548.96
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	79,031	8,203,466.59

中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	80,507	8,160,163.17
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	1,181	34,652.33
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	2,909	86,724.18
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	738	21,637.82
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	499	21,586.06
中银国际证 券股份有限 公司	601808	中海油服	3,439	61,262.97
中银国际证 券股份有限 公司	601808	中海油服	3,559	60,950.67

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	ZYLCWXJ G202104	中银证券中国 红-汇中 6 号 集合资产管理 计划	207,486,816	240,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCWXJ G202104	中银证券中国 红-汇中 6 号 集合资产管理 计划	519,570,488	600,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202124	中银证券中国 红-汇中 24 号 集合资产管理 计划	142,766,209	157,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202124	中银证券中国 红-汇中 24 号 集合资产管理 计划	181,471,736	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202124	中银证券中国 红-汇中 24 号 集合资产管理 计划	9,134,923	10,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202128	中银证券中国 红-汇中 28 号 集合资产管理 计划	140,313,006	156,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202128	中银证券中国 红-汇中 28 号 集合资产管理 计划	60,522,220	70,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202128	中银证券中国 红-汇中 28 号 集合资产管理 计划	89,952,325	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	104,771,883	110,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	127,364,319	134,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	130,341,681	140,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	139,340,455	150,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	139,821,029	150,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	147,943,584	150,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	167,519,777	180,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	185,916,148	199,990,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	186,723,929	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	19,280,825	20,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	193,911,189	200,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	215,114,104	230,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	231,117,685	250,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	28,066,236	30,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	28,084,628	30,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	337,837,838	350,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	344,115,623	350,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	46,816,479	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	48,202,063	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	48,581,422	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	52,083,333	56,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	55,897,149	60,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	56,069,526	60,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	58,021,468	60,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	74,899,354	80,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	74,934,432	80,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	92,438,528	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	93,231,400	100,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	93,257,484	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	93,283,582	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	96,899,225	100,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q78	中银证券-中 银理财 78 号 单一资产管理 计划	984,640	1,000,000.00

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	30,387,292.89
产品托管费	中国银行股份有限公司	2,549,134.97
分销买入	中国银行股份有限公司	2,034,242,413.77
分销买入	中银国际证券股份有限公 司	275,412,099.07
现券买入	中国银行股份有限公司	170,690,682.34
现券买入	中银基金管理有限公司	11,756,733.47
现券买入	中银国际证券有限公司	7,271,635.15
现券买入	中银国际证券股份有限公 司	6,729,698.75

八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市，在新旧动能转换、追求高质量发展的背景下，叠加地缘政治等一系列不确定性因素，预计经济依然需要有力的货币政策予以支撑，债券市场收益率或仍处于下行区间。但当前利率的绝对收益率水平较低，票息保护空间不足，市场面对波动时脆弱性增加。股市方面，定价逻辑基于 EPS 的传统经济个股整体表现较弱，估值也难言便宜，经历

了 2024 年的普涨之后，依靠宽基 ETF 轻松跑赢主动选股的难度大幅上升。而通过工程师红利和制造业优势展开的科技发展、制造业出海或将成为结构性行情主线，港、美股上市的中国企业也有望重新获得关注和估值修复，当前依然有大量优质公司整体估值在较低水平，在流动性宽裕和资产荒的背景下，仍具备较高吸引力，同时有助于防范固收类资产的非线性风险。在投资策略上，精选优质票息资产，控制产品的杠杆与久期，做好风险对冲，动态地对股债仓位进行调整，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