

中银理财“福”（1年）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：中国农业银行股份有限公司

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	FCYQZQ1Y
理财产品名称	中银理财“福”（1年）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	Z7001023000023
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
FCYQZQ1YA	8,493,543,678.99	1.075189	1.075189	9,132,164,851.89	4.32%
FCYQZQ1YL	744,279,416.32	1.076909	1.076909	801,521,824.98	4.41%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：109.82%

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	96,701.93	9.73%	118,742.74	11.02%
同业存单	-	0.00%	659.68	0.06%
拆放同业及买入返售	-	0.00%	2,375.68	0.22%
债券	34,193.86	3.44%	892,197.97	82.77%
非标准化债权类资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	13,102.64	1.22%
境外投资资产	-	0.00%	26,308.58	2.44%
商品类资产	-	0.00%	-	0.00%
另类资产	-	0.00%	-	0.00%
公募基金	10,979.50	1.11%	24,592.86	2.28%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	851,590.39	85.72%	-	0.00%
合计	993,465.69	100%	1,077,980.16	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	115,525.94	10.72%
2	092280003：22 中国信达债 01	15,956.71	1.48%
3	240208：24 国开 08	11,031.70	1.02%
4	242400016：24 民生银行永续债 01	9,955.84	0.92%
5	968117.OF：易方达（香港）精选债券 M 类（人民币）	8,999.17	0.83%
6	220208：22 国开 08	8,994.25	0.83%
7	242400011：24 广发银行永续债 01	7,345.18	0.68%
8	242400005：24 农行永续债 01	6,685.81	0.62%
9	242480082：24 农行永续债 03BC	6,633.96	0.62%

10	2128016: 21 民生银行永续债 01	6,333.92	0.59%
----	------------------------	----------	-------

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”（1年）最短持有期固收增强理财产品
账号	11200801040023813
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

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。报告期内，权益市场震荡上行，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，全年红利资产和AI产业链相对占优，中小盘风格波动剧烈。

（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）
中国农业银行股份有限公司	092200008	22 农行二级资本债 02A	17,578	1,809,578.68
中国农业银行股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	10,828	1,132,662.55
中国农业银行股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	12,948	1,339,290.05
中国农业银行股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	14,437	1,511,236.90
中国农业银行股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	3,609	377,809.23
中国农业银行股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	5,112	527,355.07
中国农业银行股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	5,112	527,355.07
中国农业银行股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	5,112	527,355.07
中国农业银行股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	7,219	755,108.37
中国农业银行股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	7,219	755,108.37
中国农业银行股份有限公司	1928008	19 农业银行二级 03	10,828	1,195,317.90
中国农业银行股份有限公司	1928008	19 农业银行二级 03	10,828	1,195,317.90
中国农业银行股份有限公司	1928008	19 农业银行二级 03	14,437	1,593,757.20

中国农业银行股份有限公司	1928008	19 农业银行二级 03	3,614	398,491.32
中国农业银行股份有限公司	1928008	19 农业银行二级 03	32,527	3,586,421.91
中国农业银行股份有限公司	2028017	20 农业银行永续债 01	3,511	365,541.67
中国农业银行股份有限公司	2028017	20 农业银行永续债 01	7,021	730,956.01
中国农业银行股份有限公司	2028032	20 农业银行永续债 02	109,273	11,195,325.17
中国农业银行股份有限公司	2028032	20 农业银行永续债 02	13,359	1,368,095.64
中国农业银行股份有限公司	2128038	21 农业银行永续债 01	19,016	2,025,827.71
中国农业银行股份有限公司	2128038	21 农业银行永续债 01	3,516	366,509.34
中国农业银行股份有限公司	2128038	21 农业银行永续债 01	7,031	733,018.69
中国农业银行股份有限公司	2228011	22 农业银行永续债 01	12,677	1,333,117.69
中国农业银行股份有限公司	2228011	22 农业银行永续债 01	12,677	1,333,117.69
中国农业银行股份有限公司	2228011	22 农业银行永续债 01	14,437	1,499,240.00
中国农业银行股份有限公司	2228011	22 农业银行永续债 01	26,222	2,760,017.10
中国农业银行股份有限公司	2228011	22 农业银行永续债 01	6,339	666,558.84

中国农业银行股份有限公司	232380052	23 农行二级资本债 02A	92,965	9,692,928.08
中国农业银行股份有限公司	232380053	23 农行二级资本债 02B	19,308	2,168,545.18
中国农业银行股份有限公司	232380053	23 农行二级资本债 02B	35,536	3,991,233.62
中国农业银行股份有限公司	232480004	24 农行二级资本债 01A	92,970	9,382,852.40
中国农业银行股份有限公司	232480012	24 农行二级资本债 02B	14,215	1,463,514.27
中国农业银行股份有限公司	232480012	24 农行二级资本债 02B	14,215	1,463,514.27
中国农业银行股份有限公司	232480012	24 农行二级资本债 02B	19,308	1,987,917.21
中国农业银行股份有限公司	232480012	24 农行二级资本债 02B	7,107	731,757.13
中国农业银行股份有限公司	242380017	23 农行永续债 01	14,437	1,519,727.86
中国农业银行股份有限公司	242380017	23 农行永续债 01	18,047	1,898,921.71
中国农业银行股份有限公司	242380017	23 农行永续债 01	18,047	1,899,534.03
中国农业银行股份有限公司	242380017	23 农行永续债 01	3,609	379,931.96
中国农业银行股份有限公司	242380017	23 农行永续债 01	7,219	759,813.61
中国农业银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	10,780	1,078,044.00

中国农业银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	18,047	1,833,133.81
中国农业银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	18,047	1,830,805.42
中国农业银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	18,047	1,833,133.81
中国农业银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	18,593	1,861,694.04
中国农业银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	18,593	1,861,694.04
中国农业银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	3,609	366,324.23
中国农业银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	37,186	3,720,818.53
中国农业银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	37,188	3,722,435.24
中国农业银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	55,779	5,581,227.80
中国农业银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	55,782	5,583,652.86
中国农业银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	7,219	732,648.45
中国农业银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	7,219	732,648.45
中国农业银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	74,372	7,446,776.16
中国农业银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	74,372	7,446,776.16

中国农业银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	92,965	9,302,046.34
中国农业银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	249,141	24,914,055.00
中国农业银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	102,167	10,216,705.80
中国农业银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	120,759	12,075,897.30
中国农业银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	245,316	24,531,590.00
中国农业银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	88,765	8,876,505.80
中国农业银行股份有限公司	HK000108 9769	AGRBK 0 03/17/25	14	13,593,758.76
中国农业银行股份有限公司	XS2956032 754	AGRBK 2.77 03/10/25	4	4,114,122.57
中国农业银行股份有限公司	XS2961928 640	AGRBK 0 03/13/25	7	6,795,360.69
中国农业银行股份有限公司	XS2964228 196	AGRBK 3 03/19/25	7	6,839,429.99
中国农业银行股份有限公司	XS2967735 577	AGRBK 0 03/24/25	8	3,802,885.07
中国银行(香港)有限公司	292480030	24 中银香港债 01BC	10,443	1,044,294.80
中国银行(香港)有限公司	292480030	24 中银香港债 01BC	14,207	1,420,693.80
中国银行(香港)有限公司	292480030	24 中银香港债 01BC	50,384	5,038,427.20

中银国际控 股有限公司	XS2959368 270	BCHINA 5.68129 06/08/27	2	1,642,669.94
中银集团投 资有限公司	102484979	24 中银投资 MTN002B(BC)	25,672	2,567,189.00

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）
中国农业银 行股份有限 公司	012480815	24 浙小商 SCP001	2,169	216,945.80
中国农业银 行股份有限 公司	012482664	24 杭商贸 SCP005	20,288	2,028,767.60
中国农业银 行股份有限 公司	032480927	24 鄂文旅 PPN001	24,984	2,498,357.00
中国农业银 行股份有限 公司	032480927	24 鄂文旅 PPN001	37,966	3,796,592.50
中国农业银 行股份有限 公司	102280555	22 湘交水建 MTN001	23,566	2,414,444.90
中国农业银 行股份有限 公司	102401000	24 济南高新 MTN004	41,627	4,162,725.90
中国农业银 行股份有限 公司	102480267	24 保利发展 MTN001A	1,066	106,576.40
中国农业银 行股份有限 公司	102480570	24 象屿股份 MTN001	5,368	536,750.50
中国农业银 行股份有限 公司	102480756	24 厦国贸控 MTN003	5,042	504,243.00
中国农业银 行股份有限 公司	102481390	24 北部湾 MTN006	974	97,413.80

中国农业银行股份有限公司	102481934	24 广州智装 MTN001	14,437	1,443,737.20
中国农业银行股份有限公司	102482247	24 桂投资 MTN005	14,738	1,473,781.20
中国农业银行股份有限公司	102483198	24 南山开发 MTN002	11,465	1,146,505.20
中国农业银行股份有限公司	102483198	24 南山开发 MTN002	9,916	991,593.30
中国农业银行股份有限公司	102483607	24 福瑞能源 MTN003	48,926	4,892,580.00
中国农业银行股份有限公司	102483868	24 甘国投 MTN006	7,601	760,134.50
中国农业银行股份有限公司	102483924	24 五矿集 MTN003	65,630	6,563,003.00
中国农业银行股份有限公司	102484148	24 华东勘测 MTN001(科创 票据)	15,335	1,533,486.30
中国农业银行股份有限公司	102484148	24 华东勘测 MTN001(科创 票据)	21,252	2,125,248.90
中国农业银行股份有限公司	102484203	24 桂交投 MTN018A	10,223	1,022,324.20
中国农业银行股份有限公司	102484203	24 桂交投 MTN018A	14,168	1,416,832.60
中国农业银行股份有限公司	102484204	24 桂交投 MTN018B	14,168	1,416,832.60
中国农业银行股份有限公司	102484441	24 西部矿业 MTN002	13,517	1,351,712.00
中国农业银行股份有限公司	102484441	24 西部矿业 MTN002	51,755	5,175,541.60

中国农业银行股份有限公司	102484441	24 西部矿业 MTN002	82,722	8,272,171.00
中国农业银行股份有限公司	102484824	24 甬开投 MTN001	10,077	1,007,726.20
中国农业银行股份有限公司	102484824	24 甬开投 MTN001	20,238	2,023,761.20
中国农业银行股份有限公司	102484824	24 甬开投 MTN001	47,410	4,741,017.40
中国农业银行股份有限公司	102484840	24 桂交投 MTN021	27,092	2,709,152.80
中国农业银行股份有限公司	132480029	24 河钢集 GN004	18,047	1,822,813.71
中国农业银行股份有限公司	132480074	24 乌江水电 GN002	22,996	2,299,552.50
中国农业银行股份有限公司	132480074	24 乌江水电 GN002	33,021	3,302,120.50
中国农业银行股份有限公司	2028034	20 浦发银行二级 03	136,591	13,969,226.20
中国农业银行股份有限公司	2028034	20 浦发银行二级 03	136,591	13,947,276.61
中国农业银行股份有限公司	2128033	21 建设银行二级 03	12,677	1,345,726.11
中国农业银行股份有限公司	2128033	21 建设银行二级 03	25,354	2,691,452.21
中国农业银行股份有限公司	232380069	23 建行二级资本债 02A	18,593	1,950,627.98
中国农业银行股份有限公司	232380069	23 建行二级资本债 02A	37,186	3,902,346.48

中国农业银行股份有限公司	232380069	23 建行二级资本债 02A	55,779	5,853,519.72
中国农业银行股份有限公司	232380069	23 建行二级资本债 02A	92,970	9,755,768.23
中国农业银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	082482116	24 山东高速 ABN001 优先	18,983	1,898,254.40
中国农业银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	082482116	24 山东高速 ABN001 优先	34,501	3,450,119.40
中国农业银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	082482116	24 山东高速 ABN001 优先	47,639	4,763,896.20
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	15,335	1,615,852.82
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	17,553	1,800,692.85
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	19,308	2,148,704.56
中国农业银行股份有限公司, 中国银行股份有限公司	102400775	24 晋路桥 MTN001(科创票据)	9,303	930,347.60

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	31,560	3,155,972.00
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	42,490	4,248,974.00
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102480136	24 津城建 MTN004	45,701	4,728,042.99
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102480362	24 厦国贸控 MTN001	11,089	1,108,874.10
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102480362	24 厦国贸控 MTN001	2,127	212,658.80
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102481323	24 厦国贸控 MTN005	4,045	404,495.60
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102481523	24 桂交投 MTN008B	17,929	1,792,936.00
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102482024	24 鲁高速 MTN005	18,207	1,820,682.50

中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102482024	24 鲁高速 MTN005	20,277	2,027,652.00
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102482300	24 湘建工 MTN002(科创 票据)	3,684	368,445.30
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	11,465	1,146,501.30
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	41,981	4,198,143.50
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	5,189	518,852.60
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	9,853	985,264.10
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	3,862	386,157.80
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	46,171	4,617,126.90

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	5,714	571,440.10
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	19,308	1,930,789.00
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	12,611	1,261,054.80
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	49,012	4,901,247.50
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)	26,252	2,625,201.20
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	132480154	24 三峡 GN003(碳中和 债)	12,482	1,248,249.60
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	199084	24 湖南债 59	139,846	13,984,604.00
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	199084	24 湖南债 59	52,215	5,221,474.00

中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永续债	14,723	1,536,582.41
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	17,578	1,825,391.28
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	21,064	2,185,782.77
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	7,806	780,704.40
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	70,257	7,026,339.64
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	78,063	7,808,831.69
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	84,241	8,424,063.00
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	26,442	2,644,248.80

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	30,573	3,057,347.20
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	110,412	11,041,220.00
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	19,308	1,954,167.20
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	35,536	3,596,668.37
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	91,934	9,436,134.42
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	114,917	11,615,221.73
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	114,917	11,615,221.73
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	114,917	11,650,651.60

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	153,304	15,330,350.00
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	229,835	22,983,456.00
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	428,113	42,811,335.00
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	99,934	9,993,428.00
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	242400029	24 民生银行永续债 02	15,116	1,511,589.30
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	242400029	24 民生银行永续债 02	50,594	5,059,403.00
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	242400029	24 民生银行永续债 02	51,087	5,108,724.80
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	242400029	24 民生银行永续债 02	68,708	6,870,773.00

中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2471220	24 江苏债 39	13,985	1,397,341.63
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2471229	24 辽宁债 30	100,303	10,030,305.00
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2471229	24 辽宁债 30	35,517	3,551,734.50
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2471245	24 广西债 38	139,846	13,984,604.00
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2471245	24 广西债 38	52,215	5,221,474.00
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2471248	24 黑龙江债 41	14,207	1,420,267.59
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2471248	24 黑龙江债 41	41,954	4,194,122.59
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2471328	24 吉林债 52	75,198	7,519,785.00

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	148,194	14,819,427.20
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	16,526	1,652,634.00
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	19,108	1,910,835.50
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	282400001	24 太保寿险永续债 01	31,734	3,173,399.00
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	292480030	24 中银香港债 01BC	10,443	1,044,294.80
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	292480030	24 中银香港债 01BC	14,207	1,420,693.80
中国农业银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	292480030	24 中银香港债 01BC	50,384	5,038,427.20
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	092280065	22 工行二级资本债 03A	4,316	445,614.80

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	75,677	7,761,047.10
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	8,632	891,229.61
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	092280134	22 工行二级资本债 04A	17,553	1,798,633.49
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	092280134	22 工行二级资本债 04A	3,516	360,166.68
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	092280134	22 工行二级资本债 04A	31,641	3,241,500.11

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	136,591	13,956,027.97
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	68,295	6,966,798.47
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	10,532	1,093,087.51
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	26,222	2,786,728.83
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	6,339	667,379.31

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	2228003	22 兴业银行二级 01	7,021	722,815.81
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	2228024	22 工商银行二级 03	10,532	1,116,043.56
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	232280007	22 工行二级资本债 05A	3,516	368,398.83
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	232280008	22 工行二级资本债 05B	37,432	4,234,763.43
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	232380036	23 工行二级资本债 02A	14,457	1,511,763.00

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	232380036	23 工行二级资本债 02A	18,071	1,889,703.75
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	232380036	23 工行二级资本债 02A	3,614	377,940.75
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	23,419	2,565,868.26
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	35,536	3,941,517.83
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	39,032	4,276,173.40

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	242400004	24 邮储永续债 01	148,744	14,886,853.15
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	242400004	24 邮储永续债 01	21,656	2,198,334.78
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	242400004	24 邮储永续债 01	278,878	27,887,841.00
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	242400004	24 邮储永续债 01	37,186	3,721,713.29
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	242400004	24 邮储永续债 01	7,219	732,614.40

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	242400004	24 邮储永续债 01	7,219	732,450.53
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	242400004	24 邮储永续债 01	7,219	732,614.40
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	242400004	24 邮储永续债 01	92,970	9,304,039.19
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	242400007	24 中信银行永续债 01	18,071	1,799,983.02
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	242400007	24 中信银行永续债 01	204,954	20,495,423.00

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	242400007	24 中信银行永续债 01	25,265	2,518,240.49
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	242400007	24 中信银行永续债 01	3,609	359,914.31
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	242400007	24 中信银行永续债 01	36,093	3,609,343.00
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	242400007	24 中信银行永续债 01	5,163	516,334.00
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	242400007	24 中信银行永续债 01	7,219	719,497.28

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	268,750	26,875,000.00
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	99,934	9,993,428.00
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	242400031	24 平安银行永续债 01	68,133	6,813,326.00
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	242400031	24 平安银行永续债 01	76,758	7,675,817.40
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	103,771	10,377,052.00

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	152,867	15,286,684.00
中国农业银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2228014	22 交通银行二级 01	17,578	1,805,425.67
中国农业银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	2228014	22 交通银行二级 01	7,021	721,345.18
中国银行股份有限公司	012480781	24 恒安国际 SCP001	1,085	108,395.74
中国银行股份有限公司	012480875	24 鲁商 SCP004	323	32,341.32
中国银行股份有限公司	012482260	24 冀建投 SCP002	47,733	4,773,261.00
中国银行股份有限公司	012483982	24 牧原食品 SCP002(绿色)	13,930	1,392,982.60
中国银行股份有限公司	012483982	24 牧原食品 SCP002(绿色)	5,382	538,184.70
中国银行股份有限公司	032400569	24 淮安城资 PPN001	19,360	1,936,198.30
中国银行股份有限公司	032400978	24 龙城发展 PPN006A	4,355	435,519.90
中国银行股份有限公司	032480809	24 经开国控 PPN003	49,263	4,926,320.50
中国银行股份有限公司	032480837	24 龙城发展 PPN003A	6,366	636,608.70
中国银行股份有限公司	032480838	24 龙城发展 PPN003B	15,780	1,577,986.00
中国银行股份有限公司	032480838	24 龙城发展 PPN003B	7,723	772,315.60
中国银行股份有限公司	042480135	24 鄂文旅 CP002	9,629	962,945.10

中国银行股份有限公司	082400590	24 惠丰 ABN003 优先 A1	26,252	2,625,201.20
中国银行股份有限公司	082480014	24 无锡国联 ABN001 优先 (类 REITs)	10,605	1,060,549.41
中国银行股份有限公司	082480025	24 星睿 ABN001 优先	1,064	106,454.79
中国银行股份有限公司	082480054	24 晋租 1 号 ABN001 优先 (绿色)	1,080	107,969.20
中国银行股份有限公司	082480078	24 聚润京能 ABN001 优先 (绿色)	6,087	608,652.00
中国银行股份有限公司	082480164	24 美团美月 ABN002 优先 A	7,123	712,340.59
中国银行股份有限公司	082480178	24 星睿 ABN005 优先	10,828	1,082,872.63
中国银行股份有限公司	082480185	24 晋租 2 号 ABN001 优先 (绿色)	3,561	356,170.79
中国银行股份有限公司	082480693	24 邦鑫 ABN003 优先	58,968	5,896,844.10
中国银行股份有限公司	082480714	24 邦鑫 ABN004 优先	8,396	839,628.70
中国银行股份有限公司	082480785	24 扬帆 4 号 ABN001 优先 A	53,112	5,311,217.50
中国银行股份有限公司	082480801	24 惠行 6 号 ABN001 优先 A	60,660	6,066,004.00
中国银行股份有限公司	082480876	24 晋租 2 号 ABN002 优先 (绿色)	12,237	1,223,689.40
中国银行股份有限公司	082481252	24 星澜 ABN008 优先	41,371	4,137,142.80
中国银行股份有限公司	082482236	24 康富不动产 2ABN001 优 先	10,521	1,052,133.00
中国银行股份有限公司	082482236	24 康富不动产 2ABN001 优 先	8,632	863,232.60

中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	12,948	1,341,152.79
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	15,335	1,583,397.33
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	28,875	3,025,847.40
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	36,093	3,782,065.86
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	4,355	450,312.64
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	7,219	756,461.85
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	8,710	900,453.11
中国银行股份有限公司	102380408	23 海尔金控 MTN001	9,243	969,112.58
中国银行股份有限公司	102400761	24 夏商 MTN001	18,207	1,820,682.50
中国银行股份有限公司	102400787	24 华润 MTN004	9,966	996,562.20
中国银行股份有限公司	102400853	24 金辉集团 MTN001	16,570	1,656,951.60
中国银行股份有限公司	102400989	24 大悦城 MTN003	142,312	14,231,186.20
中国银行股份有限公司	102401027	24 中粮置业 MTN001	63,965	6,397,075.29
中国银行股份有限公司	102401039	24 京能国际 MTN005(BC)	10,266	1,026,622.00
中国银行股份有限公司	102401039	24 京能国际 MTN005(BC)	13,663	1,366,327.20
中国银行股份有限公司	102401051	24 北部湾投 MTN005A	5,133	513,311.00
中国银行股份有限公司	102401052	24 北部湾投 MTN005B	14,030	1,402,999.60
中国银行股份有限公司	102480464	24 陕延油 MTN005	6,377	637,716.00
中国银行股份有限公司	102480518	24 北部湾 MTN003	1,089	108,866.80
中国银行股份有限公司	102480546	24 津城建 MTN009	10,882	1,088,204.00
中国银行股份有限公司	102480612	24 云建投 MTN004	8,423	842,268.00
中国银行股份有限公司	102480638	24 光大控股 MTN001A	3,736	373,597.13

中国银行股份有限公司	102480753	24 沈阳地铁 MTN002	1,008	100,848.60
中国银行股份有限公司	102480753	24 沈阳地铁 MTN002	21,465	2,146,491.90
中国银行股份有限公司	102480777	24 北部湾投 MTN001	2,029	202,884.00
中国银行股份有限公司	102480803	24 湘建工 MTN001(科创 票据)	3,006	300,629.40
中国银行股份有限公司	102480861	24 厦门海翼 MTN001	3,234	323,383.50
中国银行股份有限公司	102480868	24 河南资产 MTN001	3,477	347,685.73
中国银行股份有限公司	102480928	24 皖能源 MTN002	1,015	101,456.80
中国银行股份有限公司	102481040	24 青岛城投 MTN003	1,071	107,067.10
中国银行股份有限公司	102481056	24 西部矿业 MTN001(可持 续挂钩)	1,072	107,179.00
中国银行股份有限公司	102481133	24 厦国贸控 MTN004	3,201	320,077.68
中国银行股份有限公司	102481207	24 鄂联投 MTN002	2,134	213,368.40
中国银行股份有限公司	102481210	24 粤财投资 MTN001A	3,511	351,075.82
中国银行股份有限公司	102481215	24 保利发展 MTN003	3,201	320,052.60
中国银行股份有限公司	102481215	24 保利发展 MTN003	55,782	5,578,656.24
中国银行股份有限公司	102481311	24 吴中国太 MTN001	2,029	202,913.60
中国银行股份有限公司	102481317	24 武商贸集 MTN002	1,011	101,123.90
中国银行股份有限公司	102481333	24 福州古厝 MTN003	2,022	202,247.80
中国银行股份有限公司	102481402	24 中飞租赁 MTN001A	3,398	339,790.50
中国银行股份有限公司	102481436	24 联发集 MTN003	3,549	354,865.80
中国银行股份有限公司	102481596	24 中国绿发 MTN001	20,075	2,007,535.00

中国银行股份有限公司	102481691	24 瀚蓝 MTN003(绿色)	3,561	356,171.57
中国银行股份有限公司	102481752	24 中铁置业 MTN001	9,939	993,944.00
中国银行股份有限公司	102481872	24 通汇投资 MTN002	8,938	893,807.95
中国银行股份有限公司	102481903	24 山东海洋 MTN001	25,265	2,526,720.07
中国银行股份有限公司	102481932	24 豫水利 MTN001	18,047	1,804,671.50
中国银行股份有限公司	102481936	24 泉州城建 MTN001	30,819	3,081,896.00
中国银行股份有限公司	102481944	24 光大控股 MTN002B	12,948	1,335,673.62
中国银行股份有限公司	102482010	24 中交三航 MTN002(科创 票据)	18,207	1,820,682.50
中国银行股份有限公司	102482086	24 云南交投 MTN001	60,240	6,024,011.50
中国银行股份有限公司	102482095	24 保利发展 MTN004	60,332	6,033,209.00
中国银行股份有限公司	102482128	24 香格里拉 MTN001BC	9,966	996,562.20
中国银行股份有限公司	102482135	24 南山开发 MTN001A	24,914	2,491,405.50
中国银行股份有限公司	102482262	24 电建市政 MTN001(科创 票据)	18,422	1,842,226.50
中国银行股份有限公司	102482273	24 厦国贸控 MTN008	3,684	368,445.30
中国银行股份有限公司	102482363	24 云建投 MTN012	53,597	5,359,735.20
中国银行股份有限公司	102482410	24 湖北宏泰 MTN002	54,400	5,439,995.20
中国银行股份有限公司	102482742	24 广州控股 MTN002A	18,716	1,871,607.50
中国银行股份有限公司	102482828	24 厦国贸控 MTN009	11,926	1,192,605.60
中国银行股份有限公司	102482828	24 厦国贸控 MTN009	3,796	379,566.30
中国银行股份有限公司	102482882	24 供销 MTN001	42,080	4,208,225.85

中国银行股份有限公司	102483017	24 中石油 MTN002	251,889	25,188,861.00
中国银行股份有限公司	102483033	24 华为 MTN001	42,906	4,290,627.50
中国银行股份有限公司	102483051	24 厦国贸控 MTN010	13,324	1,332,438.70
中国银行股份有限公司	102483051	24 厦国贸控 MTN010	8,914	891,418.60
中国银行股份有限公司	102483090	24 香格里拉 MTN002B(BC)	8,909	890,943.60
中国银行股份有限公司	102483351	24 武汉国投 MTN003A	11,585	1,158,543.86
中国银行股份有限公司	102483351	24 武汉国投 MTN003A	12,732	1,273,217.40
中国银行股份有限公司	102483359	24 鲁能源 MTN002A	57,144	5,714,401.00
中国银行股份有限公司	102483530	24 中兴通讯 MTN001(科创 票据)	24,474	2,447,378.80
中国银行股份有限公司	102483604	24 赣投 MTN001	24,464	2,446,362.00
中国银行股份有限公司	102483618	24 云能投 MTN019	61,157	6,115,725.00
中国银行股份有限公司	102483618	24 云能投 MTN019	67,851	6,550,637.76
中国银行股份有限公司	102483649	24 渝医药 MTN004	138,514	13,851,380.70
中国银行股份有限公司	102483649	24 渝医药 MTN004	9,993	999,342.80
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)	9,993	999,342.80
中国银行股份有限公司	102483821	24 北部湾 MTN010	138,514	13,851,380.70
中国银行股份有限公司	102483821	24 北部湾 MTN010	38,007	3,800,672.50
中国银行股份有限公司	102483830	24 保定长城 MTN001	64,694	6,436,886.31
中国银行股份有限公司	102483902	24 甘交建 MTN001	199,150	19,914,985.50
中国银行股份有限公司	102483902	24 甘交建 MTN001	92,343	9,234,253.80

中国银行股份有限公司	102483947	24 红狮 MTN003	52,504	5,250,402.40
中国银行股份有限公司	102483962	24 荣盛 MTN003	91,863	9,186,268.70
中国银行股份有限公司	102483982	24 洪市政 MTN007	65,128	6,512,802.50
中国银行股份有限公司	102484024	24 晋城国资 MTN002	21,727	2,172,746.70
中国银行股份有限公司	102484039	24 中建四局 MTN001(科创 票据)	19,862	1,986,196.00
中国银行股份有限公司	102484083	24 中船租 MTN001	7,242	724,248.90
中国银行股份有限公司	102484185	24 闽建工 MTN003	10,223	1,022,324.20
中国银行股份有限公司	102484185	24 闽建工 MTN003	14,168	1,416,832.60
中国银行股份有限公司	102484254	24 南航股 MTN009	53,834	5,383,385.60
中国银行股份有限公司	102484314	24 云南交投 MTN004	20,320	2,031,966.00
中国银行股份有限公司	102484314	24 云南交投 MTN004	5,244	524,446.70
中国银行股份有限公司	102484446	24 鲁商 MTN005	51,750	5,174,976.80
中国银行股份有限公司	102484451	24 河钢集 MTN018	51,750	5,174,976.80
中国银行股份有限公司	102484494	24 津城建 MTN034	206,804	20,680,427.50
中国银行股份有限公司	102484494	24 津城建 MTN034	23,728	2,372,818.00
中国银行股份有限公司	102484494	24 津城建 MTN034	33,793	3,379,280.00
中国银行股份有限公司	102484495	24 大通开发 MTN001	41,627	4,162,725.90
中国银行股份有限公司	102484541	24 沈阳地铁 MTN007	69,379	6,937,876.50
中国银行股份有限公司	102484638	24 保利发展 MTN006	6,672	667,171.50
中国银行股份有限公司	102484688	24 凌源钢铁 MTN001	133,914	13,391,443.00
中国银行股份有限公司	102484688	24 凌源钢铁 MTN001	206,804	20,680,427.50

中国银行股份有限公司	102484688	24 凌源钢铁 MTN001	23,728	2,372,818.00
中国银行股份有限公司	102484783	24 鲁商 MTN006	76,630	7,663,024.20
中国银行股份有限公司	102484796	24 湘建工 MTN003	38,340	3,833,991.60
中国银行股份有限公司	102484807	24 漳州交通 MTN004	5,059	505,940.30
中国银行股份有限公司	102484807	24 漳州交通 MTN004	6,773	677,288.20
中国银行股份有限公司	102484823	24 宁夏国资 MTN002	13,546	1,354,576.40
中国银行股份有限公司	102484823	24 宁夏国资 MTN002	15,178	1,517,820.90
中国银行股份有限公司	102484830	24 悦达 MTN005	25,540	2,554,045.80
中国银行股份有限公司	102484837	24 乌江水电 MTN001	25,297	2,529,701.50
中国银行股份有限公司	102484837	24 乌江水电 MTN001	33,864	3,386,441.00
中国银行股份有限公司	102484838	24 贵州高速 MTN012	15,178	1,517,820.90
中国银行股份有限公司	102484838	24 贵州高速 MTN012	40,637	4,063,729.20
中国银行股份有限公司	102484979	24 中银投资 MTN002B(BC)	25,672	2,567,189.00
中国银行股份有限公司	102484992	24 青国投 MTN001	218,211	21,821,106.50
中国银行股份有限公司	102485002	24 漳州发展 MTN001	25,208	2,520,813.60
中国银行股份有限公司	102485191	24 桂铁投 MTN001	21,581	2,158,081.50
中国银行股份有限公司	102485191	24 桂铁投 MTN001	35,517	3,551,734.50
中国银行股份有限公司	102485240	24 安徽建工 MTN001(科创 票据)	4,316	431,616.30
中国银行股份有限公司	102485434	24 云建投 MTN018	12,987	1,298,732.70
中国银行股份有限公司	102485434	24 云建投 MTN018	128,398	12,839,763.30
中国银行股份有限公司	102485434	24 云建投 MTN018	40,049	4,004,938.20

中国银行股份有限公司	102485461	24 蜀道投资 MTN021	12,987	1,298,732.70
中国银行股份有限公司	102485461	24 蜀道投资 MTN021	16,023	1,602,251.10
中国银行股份有限公司	102485505	24 新投创业 MTN001(科创 票据)	69,515	6,951,521.50
中国银行股份有限公司	132480009	24 河钢集 GN002	10,629	1,062,860.00
中国银行股份有限公司	132480020	24 南京地铁 GN002(碳中和 债)	2,140	213,987.80
中国银行股份有限公司	132480025	24 新创建 GN001BC	20,258	2,025,803.30
中国银行股份有限公司	132480026	24 新奥天然气 GN001	1,072	107,179.00
中国银行股份有限公司	132480026	24 新奥天然气 GN001	3,516	351,637.97
中国银行股份有限公司	132480027	24 金融城建 GN001	1,072	107,179.00
中国银行股份有限公司	132480056	24 河钢集 GN005	176,574	17,657,419.00
中国银行股份有限公司	132480102	24 郑州地铁 GN002	25,297	2,529,701.50
中国银行股份有限公司	132480102	24 郑州地铁 GN002	33,864	3,386,441.00
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	136,591	14,007,184.43
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	68,295	6,991,079.93
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永 续债	7,021	739,502.30
中国银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永 续债	75,125	7,688,711.97
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永 续债 01	14,723	1,555,106.00
中国银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永 续债 01	3,516	379,875.77
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永 续债	14,723	1,544,985.43
中国银行股份有限公司	232400025	24 恒丰银行二 级资本债 02	11,392	1,139,249.40
中国银行股份有限公司	232400025	24 恒丰银行二 级资本债 02	25,248	2,524,777.80

中国银行股份有限公司	232400034	24 杭州银行二级资本债 01	15,780	1,577,986.00
中国银行股份有限公司	232480020	24 兴业银行二级资本债 01	10,924	1,092,409.50
中国银行股份有限公司	232480020	24 兴业银行二级资本债 01	11,584	1,158,448.50
中国银行股份有限公司	232480050	24 上海银行二级资本债 01	213,218	21,321,843.00
中国银行股份有限公司	2422004	24 兴业消费金融债 01	1,098	109,753.50
中国银行股份有限公司	2422006	24 光大金租债 01	3,551	355,163.14
中国银行股份有限公司	2422007	24 招银金租债 01	2,029	202,884.00
中国银行股份有限公司	2422013	24 兴业消费金融债 02	1,077	107,672.90
中国银行股份有限公司	2422015	24 招联消费金融债 03	974	97,413.80
中国银行股份有限公司	2422024	24 招联消费金融债 04	7,661	766,121.10
中国银行股份有限公司	2422043	24 中邮消费金融债 01	6,611	661,062.20
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	18,593	1,940,616.33
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	37,186	3,884,698.68
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	74,372	7,765,648.45
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	92,965	9,711,746.69
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	10,780	1,078,044.00
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	18,047	1,830,805.42
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	18,047	1,833,133.81
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	18,047	1,833,133.81
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	18,593	1,861,694.04
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	18,593	1,861,694.04
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	3,609	366,324.23

中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	37,186	3,720,818.53
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	37,188	3,722,435.24
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	55,779	5,581,227.80
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	55,782	5,583,652.86
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	7,219	732,648.45
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	7,219	732,648.45
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	74,372	7,446,776.16
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	74,372	7,446,776.16
中国银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	92,965	9,302,046.34
中国银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	249,141	24,914,055.00
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永 续债 01	135,549	13,554,934.00
中国银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	102,167	10,216,705.80
中国银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	120,759	12,075,897.30
中国银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	245,316	24,531,590.00
中国银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	88,765	8,876,505.80
中国银行股份有限公司	2426003	24 南洋银行 03	3,517	351,754.01
中国银行股份有限公司	2426005	24 华侨银行 01	21,848	2,184,819.00
中国银行股份有限公司	2426008	24 南洋银行 06	60,069	6,006,878.50
中国银行股份有限公司	2426010	24 南洋银行 08	143,840	14,384,022.40
中国银行股份有限公司	2489031	24 汇聚融 1A2_bc	1,078	107,794.50
中国银行股份有限公司	262480001	24 江苏金租绿 债 01	1,047	104,672.80
中国银行股份有限公司	262480003	24 江苏金租绿 债 02	1,014	101,442.00

中国银行股份有限公司	282480011	24 平安人寿永续债 01	4,329	434,032.76
中国银行股份有限公司	282480011	24 平安人寿永续债 01	8,658	868,065.52
中国银行股份有限公司	292480005	24 创兴银行二级资本债 01BC	11,411	1,141,149.40
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	10,828	1,132,662.55
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	12,948	1,339,290.05
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	14,437	1,511,236.90
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	3,609	377,809.23
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	5,112	527,355.07
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	5,112	527,355.07
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	5,112	527,355.07

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	7,219	755,108.37
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	7,219	755,108.37
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	66,794	6,847,405.71
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	3,511	365,541.67
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	7,021	730,956.01
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	109,273	11,195,325.17
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	13,359	1,368,095.64
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	15,203	1,582,943.86

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	4,908	511,902.78
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	9,815	1,023,805.56
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	7,031	732,068.03
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	7,031	732,068.03
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	19,016	2,025,827.71
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	3,516	366,509.34
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	7,031	733,018.69
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	12,677	1,333,117.69

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	12,677	1,333,117.69
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	14,437	1,499,240.00
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	26,222	2,760,017.10
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	6,339	666,558.84
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	22,804	2,280,403.50
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	14,437	1,519,727.86
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	18,047	1,899,534.03
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	18,047	1,898,921.71

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	3,609	379,931.96
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	7,219	759,813.61
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	18,594	1,934,452.78
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	19,174	1,917,367.20
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	14,990	1,499,014.20
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	15,135	1,513,543.00
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242480003	24 广州农商行永续债 01	83,489	8,348,948.00
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	15,116	1,511,589.30

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	34,354	3,435,386.50
中银国际证券股份有限公司	092200008	22 农行二级资本债 02A	17,578	1,809,578.68
中银国际证券股份有限公司	148717	24 中航 K4	16,043	1,606,523.50
中银国际证券股份有限公司	1928008	19 农业银行二级 03	10,828	1,195,317.90
中银国际证券股份有限公司	1928008	19 农业银行二级 03	10,828	1,195,317.90
中银国际证券股份有限公司	1928008	19 农业银行二级 03	14,437	1,593,757.20
中银国际证券股份有限公司	1928008	19 农业银行二级 03	3,614	398,491.32
中银国际证券股份有限公司	1928008	19 农业银行二级 03	32,527	3,586,421.91
中银国际证券股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	14,043	1,468,687.45
中银国际证券股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	3,511	367,149.04
中银国际证券股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	31,693	3,235,968.50
中银国际证券股份有限公司	232380052	23 农行二级资本债 02A	92,965	9,692,928.08
中银国际证券股份有限公司	232380053	23 农行二级资本债 02B	19,308	2,168,545.18
中银国际证券股份有限公司	232380053	23 农行二级资本债 02B	35,536	3,991,233.62

中银国际证 券股份有限 公司	232480004	24 农行二级资 本债 01A	92,970	9,382,852.40
中银国际证 券股份有限 公司	232480012	24 农行二级资 本债 02B	14,215	1,463,514.27
中银国际证 券股份有限 公司	232480012	24 农行二级资 本债 02B	14,215	1,463,514.27
中银国际证 券股份有限 公司	232480012	24 农行二级资 本债 02B	19,308	1,987,917.21
中银国际证 券股份有限 公司	232480012	24 农行二级资 本债 02B	7,107	731,757.13
中银国际证 券股份有限 公司	232480039	24 广发银行二 级资本债 01A	229,835	22,983,456.00
中银国际证 券股份有限 公司	232480039	24 广发银行二 级资本债 01A	38,616	3,861,578.00
中银国际证 券股份有限 公司	232480039	24 广发银行二 级资本债 01A	42,950	4,294,991.00
中银国际证 券股份有限 公司	232480040	24 广发银行二 级资本债 01B	137,901	13,790,073.60
中银国际证 券股份有限 公司	232480040	24 广发银行二 级资本债 01B	23,169	2,316,946.80
中银国际证 券股份有限 公司	232480040	24 广发银行二 级资本债 01B	25,770	2,576,994.60
中银国际证 券股份有限 公司	232480040	24 广发银行二 级资本债 01B	28,429	2,847,213.84
中银国际证 券股份有限 公司	232480040	24 广发银行二 级资本债 01B	7,107	711,803.46
中银国际证 券股份有限 公司	232480054	24 重庆银行二 级资本债 01	26,051	2,593,008.33

中银国际证 券股份有限 公司	232480054	24 重庆银行二 级资本债 01	39,077	3,889,512.49
中银国际证 券股份有限 公司	232480063	24 东莞银行二 级资本债 02	263,996	26,399,634.00
中银国际证 券股份有限 公司	232480067	24 华夏银行永 续债 02	183,009	18,300,930.40
中银国际证 券股份有限 公司	232480067	24 华夏银行永 续债 02	216,743	21,674,304.00
中银国际证 券股份有限 公司	232480067	24 华夏银行永 续债 02	52,445	5,244,467.00
中银国际证 券股份有限 公司	240981	24 中化 05	160,119	16,011,866.00
中银国际证 券股份有限 公司	2420002	24 北部湾银行 小微债 01	1,065	106,468.10
中银国际证 券股份有限 公司	2420049	24 东莞银行 03	26,783	2,678,288.60
中银国际证 券股份有限 公司	2422017	24 汇通金租债 01	45,281	4,528,060.00
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	272,000	27,199,976.00
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	37,314	3,731,449.00
中银国际证 券股份有限 公司	242400018	24 北京农商行 永续债 01	611,573	61,157,250.00
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	14,437	1,437,176.21
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	18,047	1,796,883.53

中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	3,609	359,294.05
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	36,093	3,592,696.96
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	199,701	19,970,114.50
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	24,984	2,528,417.71
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	24,984	2,528,417.71
中银国际证 券股份有限 公司	255516	24 漳龙 05	79,540	7,953,981.10

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	ZYGJZGH HZ5820220 815	中银证券中国 红-汇中 58 号 集合资产管理 计划	29,997,000	30,000,000.00
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	40,076,145	40,000,000.00
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	43,029,260	50,000,000.00
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	13,633,885	15,000,000.00

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	13,674,902	15,000,000.00
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	159,108,990	180,000,000.00
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	18,221,574	20,000,000.00
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	27,205,949	30,000,000.00
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	53,918,045	60,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	13,983,406	15,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	14,000,373	15,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	18,249,840	20,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	18,850,141	20,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	19,069,413	20,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	23,377,595	25,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	23,707,918	25,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	27,992,908	30,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	28,155,795	30,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	28,612,303	30,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	36,429,873	40,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	37,178,176	40,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	42,796,006	45,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	45,306,270	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	46,511,628	50,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	63,222,543	70,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	70,329,670	80,000,000.00

中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	84,594,417	90,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q20220322	中银证券中国 红-汇中 52 号 集合资产管理 计划	9,423,294	10,000,000.00
中银基金管 理有限公司	ZYJJCWQ D08	中银基金-财 稳 8 号 QDII 集合资产管理 计划	318,748,189	330,000,000.00
中银基金管 理有限公司	ZYJJZCXH L20241202	中银基金-中 诚信红利防御 股票指数集合 资产管理计划	49,647,503	50,000,000.00
中银基金管 理有限公司	ZYJJZCXH L20241202	中银基金-中 诚信红利防御 股票指数集合 资产管理计划	9,949,259	10,000,000.00

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	5,179,595.31
7 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	34,880,021.44
分销买入	中国银行股份有限公司	1,022,060,409.37
分销买入	中银国际证券股份有限公司	165,232,472.00
现券买入	中国银行股份有限公司	66,102,189.91
现券卖出	中国农业银行股份有限公司	714,001.64

八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市，在国内经济处于复苏进程，预计债券市场收益率仍将处于震荡下行区间。但当前债券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。债券投资方面以稳健为主，后续将继续择机配置性价比较高的固定收益资产，灵活调整产品久期；择机适当增加可转债和权益品种的配置和交易。

中银理财 2024 年年度托管人报告

一、报告期内本产品托管人遵规守信情况声明

在托管本产品的过程中，本产品托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《商业银行理财业务监督管理办法》等相关法律法规的规定以及产品合同、托管协议的约定，对产品管理人中银理财有限责任公司在报告期内的投资运作，进行了独立的会计核算和投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害产品份额持有人利益的行为。

二、对本产品定期报告中财务信息等内容的意见

本托管人根据《商业银行理财业务监督管理办法》等相关法律法规的规定，以及理财管理人所提供的统计口径，对所托管的理财产品 2024 年年度报告进行了复核，该报告中的财务数据真实、准确、完整，未发现有关损害产品持有人利益的行为。

中国农业银行股份有限公司托管业务部



2025 年 3 月 10 日