

中银理财“福”固收增强（封闭式）养老理财产品 2022 年  
003 期  
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：招商银行股份有限公司

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	YLFFB22003
理财产品名称	中银理财“福”固收增强（封闭式）养老理财产品 2022 年 003 期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000454
产品类型	固定收益类产品
募集方式	公募
产品运作模式	封闭式净值型产品
产品币种	人民币
风险级别	02 二级(中低)
理财产品成立日	2022-09-14
理财产品到期日	2027-09-22

### 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
YLFFB22003A	194,797,239.50	1.085935	1.091935	211,537,314.08	4.27%
YLFFB22003B	1,234,726,206.82	1.085927	1.091927	1,340,823,162.17	4.27%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：115.11%

### 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	1,571.23	1.01%	3,853.02	2.18%
同业存单	-	0.00%	2,107.15	1.19%
拆放同业及买入返售	-	0.00%	578.72	0.33%
债券	-	0.00%	109,937.43	62.11%
非标准化债权类资产	8,641.07	5.57%	54,941.07	31.04%
权益类投资	-	0.00%	3,339.05	1.89%
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%	2,260.91	1.28%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	144,891.52	93.42%	-	0.00%
合计	155,103.82	100%	177,017.34	100%

注：报告期末本理财产品持仓金融衍生品 0.38 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	YLFFB22003-20240321-1：河南航空港投资集团有限公司(112778122)	13,000.00	7.34%
2	YLFFB22003-20240429-1：云瀚信息科技有限公司(63264385)	10,000.00	5.65%
3	YLFFB22003-20241128-1：湖北省联合发展投资集团有限公司	7,000.00	3.95%
4	HTJZ-SD-2024-010：山东汇通金融租赁有限公司	5,393.78	3.05%
5	YLFFB22003-20240613-01：抖音月付非标理财项目	5,200.00	2.94%
6	185981：22 鲁资 06	4,976.14	2.81%
7	194746：22 常城 07	4,961.25	2.80%

8	YLFFB22003-20240528-1: 云瀚信息科技有限公司(63264385)	4,000.00	2.26%
9	YLFFB22003-20240814-1: 中国平煤神马控股集团有限公司(34507)	4,000.00	2.26%
10	CNY: 现金及银行存款	3,853.02	2.18%

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”固收增强（封闭式）养老理财产品 2022 年 003 期
账号	755953000310609
开户行	招商银行股份有限公司北京月坛支行

## 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。

### （二）非标资产投资情况

本产品于 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日期间投资于非标准化债权类资产。根据产品说明书约定，现将产品投资于非标准化债权类资产的具体信息进行披露，详见附表。

融资客户	项目名称	剩余融资 期限 (天)	到期收益 预计(%)	投资模式/ 交易结构	风险状 况
河南航空港 投资集团有 限公司	河南航空港投资集团有 限公司信托贷款非标理 财项目	80	4.61	信托贷款	正常
湖北省联合 发展投资集 团有限公司	湖北省联合发展投资集 团有限公司信托贷款非 标理财项目	686	3.88	信托贷款	正常
山东汇通金 融租赁有限 公司	山东汇通金融租赁有限 公司	170	2.95	同业借款借 出	正常
山东汇通金 融租赁有限 公司	山东汇通金融租赁有限 公司	147	3.15	同业借款借 出	正常
深圳智领星 辰科技有限 公司	深圳智领星辰科技有限 公司其他债权类资产非 标理财项目	529	3.00	其他债权类 资产	正常
云瀚信息科 技有限公司	云瀚信息科技有限公司 其他债权类资产非标理 财项目	148	2.85	其他债权类 资产	正常
云瀚信息科 技有限公司	云瀚信息科技有限公司 其他债权类资产非标理 财项目	119	3.00	其他债权类 资产	正常
中国平煤神 马控股集团 有限公司	中国平煤神马控股集团 有限公司信托贷款非标 理财项目	148	4.03	信托贷款	正常
中国平煤神 马控股集团 有限公司	中国平煤神马控股集团 有限公司信托贷款非标 理财项目	226	3.60	信托贷款	正常
中国中信金 融资产管理 股份有限公 司	中国中信金融资产管理 股份有限公司	163	2.90	同业借款借 出	正常

注：报告期内到期收益预计是管理人根据底层资产在报告期内的资产情况、收益分配情况及费用进行预估的收益。最终以实际到期收益为准。

### (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）
招联消费金融股份有限公司	2422015	24 招联消费金融债 03	182	18,202.60
招联消费金融股份有限公司	2422024	24 招联消费金融债 04	1,609	160,863.00
招商局集团有限公司	102282168	22 招商局 MTN003	3,040	311,052.09
招商银行股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	13,154	1,375,793.82
招商银行股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	13,181	1,387,259.55
招商银行股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	3,289	343,927.08
招商银行股份有限公司	2028023	20 招商银行永续债 01	3,295	346,814.89
招商银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	16,466	1,709,936.63
招商银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	19,731	2,047,533.27
招商银行股份有限公司	242380033	23 招行永续债 01	109	11,348.59
招商银行股份有限公司	242380033	23 招行永续债 01	6,330	667,688.41
招商银行股份有限公司	242480070	24 招行永续债 01BC	2,770	278,988.83
招银金融租赁有限公司	2422007	24 招银金租债 01	574	57,424.40
中国银行（香港）有限公司	292480030	24 中银香港债 01BC	2,421	242,071.60
中银集团投资有限公司	102484979	24 中银投资 MTN002B(BC)	508	50,788.00

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）

招商银行股份有限公司	012480311	24 沪百联 SCP001	29,816	3,001,859.86
招商银行股份有限公司	012481615	24 航天电子 SCP005	5,507	550,740.19
招商银行股份有限公司	012482511	24 航天电子 SCP008	8,253	825,372.54
招商银行股份有限公司	012483036	24 航天电子 SCP009	13,790	1,379,090.74
招商银行股份有限公司	042380398	23 恒力石化 CP001	3,651	377,793.69
招商银行股份有限公司	042380398	23 恒力石化 CP001	5,477	566,657.43
招商银行股份有限公司	082482184	24 川华西 ABN001 优先	1,285	128,468.00
招商银行股份有限公司	102000214	20 湖北广电 (疫情防控 债)MTN001	1,645	168,961.74
招商银行股份有限公司	102102149	21 沪基建 MTN002	1,828	189,682.60
招商银行股份有限公司	102280170	22 重庆水务 MTN001	3,399	352,082.00
招商银行股份有限公司	102280485	22 苏科技城 MTN001	4,561	458,944.57
招商银行股份有限公司	102282168	22 招商局 MTN003	3,040	311,052.09
招商银行股份有限公司	102300361	23 建发集 MTN001	8,561	890,188.23
招商银行股份有限公司	102381191	23 苏交通 MTN001A	9,491	983,590.21
招商银行股份有限公司	102382942	23 晋中公用 MTN002	7,552	798,637.00
招商银行股份有限公司	102383343	23 五冶集 MTN001	37,758	3,860,254.81
招商银行股份有限公司	102400728	24 中交城投 MTN002	15,103	1,510,652.28
招商银行股份有限公司	102400728	24 中交城投 MTN002	2,908	290,826.00
招商银行股份有限公司	102400728	24 中交城投 MTN002	7,552	756,558.29
招商银行股份有限公司	102480512	24 豫交投 MTN001	244	24,434.80
招商银行股份有限公司	102480756	24 厦国贸控 MTN003	1,427	142,721.00

招商银行股份有限公司	102481330	24 鸿商产业 MTN002	945	94,479.50
招商银行股份有限公司	102481443	24 五矿集 MTN001B	6,849	691,880.61
招商银行股份有限公司	102481453	24 珠海港股 MTN003	523	52,328.00
招商银行股份有限公司	102481469	24 陕投集团 MTN002	628	62,793.60
招商银行股份有限公司	102481613	24 鸿商产业 MTN004	1,051	105,132.40
招商银行股份有限公司	102481619	24 佛山建设 MTN001	14,541	1,454,130.00
招商银行股份有限公司	102482002	24 越秀资本 MTN002A	6,237	623,745.20
招商银行股份有限公司	102482020	24 新兴际华 MTN001	22,655	2,265,935.60
招商银行股份有限公司	102482071	24 扬州经开 MTN002	7,797	779,681.50
招商银行股份有限公司	102482725	24 蜀道投资 MTN009	5,541	561,524.82
招商银行股份有限公司	102482749	24 中交二航 MTN002	4,148	414,780.80
招商银行股份有限公司	102482921	24 建安投资 MTN002	161	16,130.60
招商银行股份有限公司	102482927	24 东莞交投 MTN001	4,600	461,065.78
招商银行股份有限公司	102483198	24 南山开发 MTN002	487	48,699.90
招商银行股份有限公司	102483587	24 中交一公 MTN001A(科 创票据)	1,018	101,796.40
招商银行股份有限公司	102483587	24 中交一公 MTN001A(科 创票据)	30,206	3,021,289.88
招商银行股份有限公司	102483997	24 安瑞科控 MTN002	253	25,339.10
招商银行股份有限公司	102483998	24 水利四 MTN001(科创 票据)	22,655	2,265,628.36
招商银行股份有限公司	102483998	24 水利四 MTN001(科创 票据)	507	50,678.20
招商银行股份有限公司	102484738	24 鄂尔国投 MTN001	2,671	267,052.00

招商银行股份有限公司	102485462	24 苏交通 MTN013	13,528	1,352,885.49
招商银行股份有限公司	1920046	19 宁波银行二 级	18,982	1,972,349.21
招商银行股份有限公司	1920046	19 宁波银行二 级	3,040	315,967.12
招商银行股份有限公司	1920046	19 宁波银行二 级	6,080	631,969.51
招商银行股份有限公司	1920046	19 宁波银行二 级	6,591	685,104.14
招商银行股份有限公司	1920066	19 上海银行二 级	16,493	1,710,424.20
招商银行股份有限公司	2020002	20 杭州银行永 续债	22,655	2,328,213.60
招商银行股份有限公司	2028051	20 浦发银行永 续债	13,528	1,394,185.89
招商银行股份有限公司	2028051	20 浦发银行永 续债	16,466	1,731,727.60
招商银行股份有限公司	2028051	20 浦发银行永 续债	16,477	1,746,107.27
招商银行股份有限公司	2028051	20 浦发银行永 续债	22,351	2,306,911.35
招商银行股份有限公司	2028051	20 浦发银行永 续债	8,940	922,764.54
招商银行股份有限公司	2120047	21 宁波银行二 级 01	5,514	589,636.68
中国银行股份有限公司	012480781	24 恒安国际 SCP001	203	20,254.78
中国银行股份有限公司	012480781	24 恒安国际 SCP001	8,289	835,838.73
中国银行股份有限公司	012480875	24 鲁商 SCP004	60	6,043.26
中国银行股份有限公司	012482260	24 冀建投 SCP002	746	74,563.00
中国银行股份有限公司	032400569	24 淮安城资 PPN001	25,044	2,504,643.65
中国银行股份有限公司	032480809	24 经开国控 PPN003	742	74,155.50
中国银行股份有限公司	032480838	24 龙城发展 PPN003B	328	32,805.60
中国银行股份有限公司	042480135	24 鄂文旅 CP002	1,799	179,935.20

中国银行股份有限公司	082400590	24 惠丰 ABN003 优先 A1	521	52,115.20
中国银行股份有限公司	082400806	24 山高通汇 ABN001 优先	1,141	114,075.81
中国银行股份有限公司	082480014	24 无锡国联 ABN001 优先 (类 REITs)	13,280	1,328,163.48
中国银行股份有限公司	082480025	24 星睿 ABN001 优先	270	27,003.31
中国银行股份有限公司	082480054	24 晋租 1 号 ABN001 优先 (绿色)	242	24,195.40
中国银行股份有限公司	082480078	24 聚润京能 ABN001 优先 (绿色)	1,723	172,273.20
中国银行股份有限公司	082480080	24 惠行 1 号 ABN001 优先 A	7,361	736,135.60
中国银行股份有限公司	082480178	24 星睿 ABN005 优先	5,137	513,692.18
中国银行股份有限公司	082480185	24 晋租 2 号 ABN001 优先 (绿色)	2,807	280,717.63
中国银行股份有限公司	082480693	24 邦鑫 ABN003 优先	102	10,154.90
中国银行股份有限公司	082480714	24 邦鑫 ABN004 优先	155	15,538.80
中国银行股份有限公司	082480785	24 扬帆 4 号 ABN001 优先 A	1,599	159,940.50
中国银行股份有限公司	082480801	24 惠行 6 号 ABN001 优先 A	1,284	128,415.00
中国银行股份有限公司	082480876	24 晋租 2 号 ABN002 优先 (绿色)	255	25,460.40
中国银行股份有限公司	082481252	24 星澜 ABN008 优先	842	84,165.90
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	10,635	1,115,764.47
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	13,698	1,435,398.86

中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	17,122	1,794,133.12
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	3,424	358,849.72
中国银行股份有限公司	102000920	20 闽交运 MTN001	5,506	560,217.02
中国银行股份有限公司	102001446	20 陕有色 MTN002	24,591	2,594,305.32
中国银行股份有限公司	102100118	21 陕有色 MTN001	13,755	1,463,077.90
中国银行股份有限公司	102100597	21 陕有色 MTN002	2,762	292,030.70
中国银行股份有限公司	102100780	21 中电国际 MTN001	13,599	1,407,503.24
中国银行股份有限公司	102100780	21 中电国际 MTN001	29,509	3,053,458.28
中国银行股份有限公司	102380408	23 海尔金控 MTN001	1,648	172,755.94
中国银行股份有限公司	102383172	23 中铁置业 MTN002	19,177	1,954,569.68
中国银行股份有限公司	102400690	24 云能投 MTN007	6,822	682,266.30
中国银行股份有限公司	102400761	24 夏商 MTN001	15,103	1,510,497.84
中国银行股份有限公司	102400761	24 夏商 MTN001	3,776	377,654.38
中国银行股份有限公司	102400761	24 夏商 MTN001	7,797	779,681.50
中国银行股份有限公司	102400787	24 华润 MTN004	267	26,669.60
中国银行股份有限公司	102400853	24 金辉集团 MTN001	314	31,368.00
中国银行股份有限公司	102400871	24 鲁宏桥 MTN008(科创 票据)	1,824	182,463.18
中国银行股份有限公司	102400886	24 鲁宏桥 MTN009(科创 票据)	5,478	547,874.43
中国银行股份有限公司	102400896	24 华润电力 MTN001	1,280	127,952.40
中国银行股份有限公司	102400989	24 大悦城 MTN003	2,895	289,518.90
中国银行股份有限公司	102480276	24 中海企业 MTN001A	5,477	561,680.84

中国银行股份有限公司	102480390	24 象屿 MTN001	2,234	223,464.84
中国银行股份有限公司	102480411	24 闽国资 MTN001	1,341	134,067.00
中国银行股份有限公司	102480464	24 陕延油 MTN005	1,618	161,763.00
中国银行股份有限公司	102480518	24 北部湾 MTN003	244	24,396.60
中国银行股份有限公司	102480529	24 徐工租赁 MTN001	8,349	856,810.21
中国银行股份有限公司	102480546	24 津城建 MTN009	2,439	243,862.00
中国银行股份有限公司	102480612	24 云建投 MTN004	2,670	267,019.20
中国银行股份有限公司	102480638	24 光大控股 MTN001A	4,112	411,228.99
中国银行股份有限公司	102480661	24 中建六局 MTN002(科创 票据)	4,231	423,104.56
中国银行股份有限公司	102480700	24 福建港口 MTN001	4,122	412,271.15
中国银行股份有限公司	102480708	24 云南机场 MTN001	20,292	2,029,382.01
中国银行股份有限公司	102480777	24 北部湾投 MTN001	574	57,424.40
中国银行股份有限公司	102480803	24 湘建工 MTN001(科创 票据)	851	85,090.20
中国银行股份有限公司	102480861	24 厦门海翼 MTN001	604	60,427.20
中国银行股份有限公司	102480868	24 河南资产 MTN001	3,827	382,707.50
中国银行股份有限公司	102480928	24 皖能源 MTN002	190	18,958.10
中国银行股份有限公司	102481040	24 青岛城投 MTN003	200	20,006.50
中国银行股份有限公司	102481056	24 西部矿业 MTN001(可持 续挂钩)	200	20,027.40
中国银行股份有限公司	102481056	24 西部矿业 MTN001(可持 续挂钩)	3,835	383,574.18
中国银行股份有限公司	102481091	24 福建漳州 MTN001	7,671	767,262.05

中国银行股份有限公司	102481117	24 光大环境 MTN001	3,158	317,674.84
中国银行股份有限公司	102481117	24 光大环境 MTN001	6,315	635,349.67
中国银行股份有限公司	102481117	24 光大环境 MTN001	9,473	953,024.51
中国银行股份有限公司	102481128	24 山西建投 MTN003A	22,083	2,208,479.40
中国银行股份有限公司	102481133	24 厦国贸控 MTN004	3,680	368,072.44
中国银行股份有限公司	102481133	24 厦国贸控 MTN004	598	59,809.39
中国银行股份有限公司	102481156	24 荣盛 MTN001	11,041	1,104,216.11
中国银行股份有限公司	102481164	24 津城建 MTN014	33,124	3,312,710.03
中国银行股份有限公司	102481165	24 滨建投 MTN007	33,124	3,312,719.10
中国银行股份有限公司	102481195	24 泰州城建 MTN002	3,680	368,073.95
中国银行股份有限公司	102481207	24 鄂联投 MTN002	24,072	2,407,460.13
中国银行股份有限公司	102481207	24 鄂联投 MTN002	399	39,869.80
中国银行股份有限公司	102481210	24 粤财投资 MTN001A	3,288	328,870.55
中国银行股份有限公司	102481210	24 粤财投资 MTN001A	3,439	343,914.11
中国银行股份有限公司	102481215	24 保利发展 MTN003	327	32,727.54
中国银行股份有限公司	102481215	24 保利发展 MTN003	598	59,804.70
中国银行股份有限公司	102481237	24 象屿 MTN002A	3,411	341,122.31
中国银行股份有限公司	102481311	24 吴中国太 MTN001	379	37,916.20
中国银行股份有限公司	102481317	24 武商贸集 MTN002	189	18,895.90
中国银行股份有限公司	102481323	24 厦国贸控 MTN005	756	75,583.60
中国银行股份有限公司	102481333	24 福州古厝 MTN003	378	37,791.80
中国银行股份有限公司	102481402	24 中飞租赁 MTN001A	3,183	318,299.00

中国银行股份有限公司	102481436	24 联发集 MTN003	985	98,451.60
中国银行股份有限公司	102481523	24 桂交投 MTN008B	14,628	1,462,750.00
中国银行股份有限公司	102481752	24 中铁置业 MTN001	2,087	208,699.20
中国银行股份有限公司	102481872	24 通汇投资 MTN002	1,877	187,673.50
中国银行股份有限公司	102481903	24 山东海洋 MTN001	11,985	1,198,623.28
中国银行股份有限公司	102481932	24 豫水利 MTN001	8,561	856,098.50
中国银行股份有限公司	102482010	24 中交三航 MTN002(科创 票据)	7,797	779,681.50
中国银行股份有限公司	102482095	24 保利发展 MTN004	1,779	177,932.30
中国银行股份有限公司	102482128	24 香格里拉 MTN001BC	267	26,669.60
中国银行股份有限公司	102482300	24 湘建工 MTN002(科创 票据)	1,415	141,460.20
中国银行股份有限公司	102482742	24 广州控股 MTN002A	5,459	545,857.00
中国银行股份有限公司	102482882	24 供销 MTN001	17,273	1,727,289.00
中国银行股份有限公司	102482882	24 供销 MTN001	72	7,246.95
中国银行股份有限公司	102482968	24 川投资 MTN003	8,289	831,961.86
中国银行股份有限公司	102483017	24 中石油 MTN002	4,662	466,164.00
中国银行股份有限公司	102483033	24 华为 MTN001	768	76,823.00
中国银行股份有限公司	102483222	24 兴湘投资 MTN002	148	14,831.10
中国银行股份有限公司	102483351	24 武汉国投 MTN003A	492	49,211.39
中国银行股份有限公司	102483441	24 甘国投 MTN005	820	82,014.00
中国银行股份有限公司	102483530	24 中兴通讯 MTN001(科创 票据)	509	50,920.80

中国银行股份有限公司	102483604	24 赣投 MTN001	509	50,899.60
中国银行股份有限公司	102483618	24 云能投 MTN019	1,272	127,245.50
中国银行股份有限公司	102483618	24 云能投 MTN019	993	95,855.08
中国银行股份有限公司	102483830	24 保定长城 MTN001	1,316	130,951.99
中国银行股份有限公司	102483902	24 甘交建 MTN001	4,033	403,281.00
中国银行股份有限公司	102483944	24 晋能煤业 MTN012(科创 票据)	521	52,115.20
中国银行股份有限公司	102483947	24 红狮 MTN003	1,042	104,230.40
中国银行股份有限公司	102483962	24 荣盛 MTN003	1,824	182,364.70
中国银行股份有限公司	102484446	24 鲁商 MTN005	1,053	105,279.60
中国银行股份有限公司	102484451	24 河钢集 MTN018	1,053	105,279.60
中国银行股份有限公司	102484495	24 大通开发 MTN001	847	84,686.40
中国银行股份有限公司	102484688	24 凌源钢铁 MTN001	2,671	267,052.00
中国银行股份有限公司	102484688	24 凌源钢铁 MTN001	40,334	4,033,407.00
中国银行股份有限公司	102484783	24 鲁商 MTN006	1,528	152,816.40
中国银行股份有限公司	102484796	24 湘建工 MTN003	765	76,457.70
中国银行股份有限公司	102484796	24 湘建工 MTN003	8,147	814,651.40
中国银行股份有限公司	102484979	24 中银投资 MTN002B(BC )	508	50,788.00
中国银行股份有限公司	102484992	24 青国投 MTN001	4,317	431,698.00
中国银行股份有限公司	102485002	24 漳州发展 MTN001	1,211	121,112.80
中国银行股份有限公司	102485002	24 漳州发展 MTN001	4,242	424,151.10

中国银行股份有限公司	102485298	24 吉利 MTN006(科创 票据)	22,348	2,234,753.00
中国银行股份有限公司	102485336	24 联发集 MTN004	35,756	3,575,883.99
中国银行股份有限公司	102485434	24 云建投 MTN018	71,512	7,151,209.60
中国银行股份有限公司	102485434	24 云建投 MTN018	977	97,698.60
中国银行股份有限公司	102485505	24 新投创业 MTN001(科创 票据)	1,656	165,626.50
中国银行股份有限公司	102485505	24 新投创业 MTN001(科创 票据)	44,695	4,469,506.00
中国银行股份有限公司	102485525	24 甘交建 MTN002	26,817	2,681,703.60
中国银行股份有限公司	132480009	24 河钢集 GN002	2,696	269,605.00
中国银行股份有限公司	132480009	24 河钢集 GN002	2,929	292,921.51
中国银行股份有限公司	132480015	24 苏州高新 GN001	20,612	2,061,352.94
中国银行股份有限公司	132480020	24 南京地铁 GN002(碳中和 债)	400	39,985.60
中国银行股份有限公司	132480025	24 新创建 GN001BC	8,849	884,876.80
中国银行股份有限公司	132480027	24 金融城建 GN001	200	20,027.40
中国银行股份有限公司	132480154	24 三峡 GN003(碳中和 债)	604	60,352.70
中国银行股份有限公司	132480157	24 通威 GN008(科创票 据)	21,880	2,188,029.00
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	1,826	188,910.70
中国银行股份有限公司	1928032	19 建设银行永 续债	7,302	755,601.29
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永 续债	2,763	285,881.45
中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永 续债	21,159	2,171,909.26

中国银行股份有限公司	1928036	19 中信银行永续债	9,128	942,925.35
中国银行股份有限公司	198536	24 河北债 46	2,763	276,312.02
中国银行股份有限公司	198541	24 湖南债 27	11,908	1,192,457.63
中国银行股份有限公司	198541	24 湖南债 27	14,885	1,488,991.24
中国银行股份有限公司	198541	24 湖南债 27	2,977	298,114.41
中国银行股份有限公司	198952	24 安徽 13	913	92,711.84
中国银行股份有限公司	199085	24 湖南债 60	2,770	277,036.00
中国银行股份有限公司	199085	24 湖南债 60	3,574	357,378.30
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	14,025	1,441,532.01
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	4,533	459,545.45
中国银行股份有限公司	2023005	20 平安人寿	5,502	562,558.20
中国银行股份有限公司	2023016	20 中财再保险	2,765	290,295.23
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	13,599	1,439,812.09
中国银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	4,918	520,613.40
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永续债	13,684	1,409,081.24
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永续债	22,778	2,457,242.37
中国银行股份有限公司	2128017	21 中信银行永续债	4,561	469,623.96
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	16,466	1,709,936.63
中国银行股份有限公司	2128047	21 招商银行永续债	19,731	2,047,533.27
中国银行股份有限公司	231814	24 湖南 16	3,066	306,664.87
中国银行股份有限公司	231814	24 湖南 16	3,066	306,664.87
中国银行股份有限公司	231814	24 湖南 16	3,066	306,664.87

中国银行股份有限公司	231876	24 安徽 45	2,753	275,348.39
中国银行股份有限公司	231925	24 重庆 27	59,540	5,980,983.75
中国银行股份有限公司	231930	24 四川 36	2,751	275,143.16
中国银行股份有限公司	231930	24 四川 36	2,965	296,568.06
中国银行股份有限公司	232380026	23 厦门国际二级资本债 01	23,008	2,448,212.03
中国银行股份有限公司	232400014	24 民生银行二级资本债 01	4,440	446,536.37
中国银行股份有限公司	232400014	24 民生银行二级资本债 01	8,880	894,054.00
中国银行股份有限公司	232400025	24 恒丰银行二级资本债 02	43	4,347.90
中国银行股份有限公司	232400025	24 恒丰银行二级资本债 02	484	48,391.80
中国银行股份有限公司	232480014	24 交行二级资本债 01A	2,757	276,905.20
中国银行股份有限公司	232480014	24 交行二级资本债 01A	2,757	276,905.20
中国银行股份有限公司	232480014	24 交行二级资本债 01A	5,516	555,598.03
中国银行股份有限公司	232480035	24 平安银行二级资本债 01A	5,483	553,881.52
中国银行股份有限公司	232480035	24 平安银行二级资本债 01A	5,483	552,381.86
中国银行股份有限公司	232480037	24 交行二级资本债 02A	1,299	129,866.40
中国银行股份有限公司	232480038	24 交行二级资本债 02B	561	56,060.50
中国银行股份有限公司	232480038	24 交行二级资本债 02B	820	83,007.03
中国银行股份有限公司	2405171	24 浙江债 15	431	44,196.18
中国银行股份有限公司	2405201	24 陕西债 05	32,173	3,427,592.40
中国银行股份有限公司	2405282	24 山东债 16	1,382	145,222.20
中国银行股份有限公司	2405393	24 陕西债 14	64,347	6,898,702.37
中国银行股份有限公司	2405536	24 河北债 36	538	54,568.35

中国银行股份有限公司	2405633	24 陕西债 20	11,051	1,105,239.24
中国银行股份有限公司	2405633	24 陕西债 20	6,040	604,028.20
中国银行股份有限公司	2405637	24 山西债 23	2,955	295,582.20
中国银行股份有限公司	2405638	24 山西债 24	5,954	606,645.96
中国银行股份有限公司	2405687	24 湖北债 55	2,760	276,098.39
中国银行股份有限公司	2405687	24 湖北债 55	2,977	297,778.00
中国银行股份有限公司	2405763	24 河南债 37	44,623	4,479,126.77
中国银行股份有限公司	2405763	24 河南债 37	5,950	597,216.90
中国银行股份有限公司	2405766	24 河南债 40	8,925	894,040.42
中国银行股份有限公司	2422004	24 兴业消费金融债 01	311	31,064.60
中国银行股份有限公司	2422006	24 光大金租债 01	3,909	390,938.14
中国银行股份有限公司	2422013	24 兴业消费金融债 02	201	20,119.70
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	109	11,384.77
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	218	22,789.88
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	436	45,557.77
中国银行股份有限公司	242380021	23 建行永续债 02	545	56,974.71
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	15,103	1,527,064.97
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	15,103	1,493,864.77
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	22,655	2,271,979.81
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	37,758	3,823,493.70
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	7,552	760,558.33
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	7,552	764,312.68

中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	7,552	759,683.92
中国银行股份有限公司	242480005	24 杭州银行永续债 01	7,552	759,877.18
中国银行股份有限公司	2426003	24 南洋银行 03	3,871	387,185.60
中国银行股份有限公司	2426005	24 华侨银行 01	9,356	935,617.80
中国银行股份有限公司	2426008	24 南洋银行 06	1,076	107,552.20
中国银行股份有限公司	2426010	24 南洋银行 08	2,846	284,618.40
中国银行股份有限公司	2471229	24 辽宁债 30	504	50,356.50
中国银行股份有限公司	2471268	24 安徽债 78	2,724	272,364.30
中国银行股份有限公司	2489031	24 汇聚融 1A2_bc	201	20,142.40
中国银行股份有限公司	262480001	24 江苏金租绿债 01	266	26,551.30
中国银行股份有限公司	262480003	24 江苏金租绿债 02	287	28,712.20
中国银行股份有限公司	272380006	23 中财再保险资本补充债 01	5,540	588,464.61
中国银行股份有限公司	272480003	24 东方二级资本债 01BC	2,406	240,576.00
中国银行股份有限公司	272480003	24 东方二级资本债 01BC	812	81,166.50
中国银行股份有限公司	272480020	24 中华财险资本补充债	15,103	1,504,328.18
中国银行股份有限公司	292480005	24 创兴银行二级资本债 01BC	263	26,342.00
中国银行股份有限公司	292480030	24 中银香港债 01BC	2,421	242,071.60
中国银行股份有限公司, 招商银行股份有限公司	012483982	24 牧原食品 SCP002(绿色)	340	33,981.20

中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	082480164	24 美团美月 ABN002 优先 A	5,614	561,434.47
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	092280139	22 交行二级资 本债 02A	16,443	1,686,800.07
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	092280139	22 交行二级资 本债 02A	3,169	328,550.47
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	092280140	22 交行二级资 本债 02B	820	91,270.39
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102382878	23 中交天航 MTN002(科创 票据)	11,504	1,203,227.99
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102383134	23 中交天航 MTN003(科创 票据)	23,008	2,318,473.84
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102401027	24 中粮置业 MTN001	1,276	127,570.68
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102401027	24 中粮置业 MTN001	12,220	1,221,977.10

中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102480362	24 厦国贸控 MTN001	12,927	1,292,653.50
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102480362	24 厦国贸控 MTN001	539	53,943.00
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102480721	24 合高建设 MTN001	3,675	370,661.42
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102480753	24 沈阳地铁 MTN002	285	28,544.20
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102480753	24 沈阳地铁 MTN002	9,376	937,593.90
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102481104	24 北部湾 MTN005	7,671	767,074.80
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102481119	24 浙能国际 MTN001	3,680	368,069.82
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102481596	24 中国绿发 MTN001	5,257	525,662.00

中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102481691	24 瀚蓝 MTN003(绿色)	2,807	280,718.24
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102481936	24 泉州城建 MTN001	5,494	549,385.00
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102482024	24 鲁高速 MTN005	7,797	779,681.50
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102482135	24 南山开发 MTN001A	667	66,674.00
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102482262	24 电建市政 MTN001(科创 票据)	7,073	707,301.00
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102482273	24 厦国贸控 MTN008	1,415	141,460.20
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102482828	24 厦国贸控 MTN009	1,037	103,695.20
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102483012	24 粤电发 MTN002	487	48,699.90

中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102483012	24 粤电发 MTN002	777	77,694.00
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102483051	24 厦国贸控 MTN010	153	15,297.40
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102483090	24 香格里拉 MTN002B(BC )	151	15,132.10
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102483341	24 厦国贸控 MTN011	164	16,402.80
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102483873	24 中陕核工 MTN002	15,103	1,510,427.18
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102483873	24 中陕核工 MTN002	249	24,871.40
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102483982	24 洪市政 MTN007	1,293	129,291.50
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102484541	24 沈阳地铁 MTN007	1,411	141,144.00

中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102484830	24 悦达 MTN005	509	50,932.80
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102484830	24 悦达 MTN005	8,147	814,651.40
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	102485240	24 安徽建工 MTN001(科创 票据)	4,470	446,950.60
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	132480026	24 新奥天然气 GN001	200	20,027.40
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	132480026	24 新奥天然气 GN001	3,293	329,397.13
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	1920091	19 南京银行二 级	11,052	1,140,301.85
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	1920091	19 南京银行二 级	5,516	570,139.27
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永 续债	10,644	1,100,672.50

中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	2,982	308,784.60
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	4,918	508,862.50
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	1928031	19 广发银行永续债	9,128	949,767.57
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2020022	20 南京银行二级 01	5,514	559,395.08
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2020044	20 宁波银行二级	5,506	581,920.67
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2023001	20 人民财险	14,754	1,496,302.62
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	14,325	1,479,043.33
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	30,206	3,088,985.59

中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2028003	20 平安银行永续债 01	7,552	772,269.05
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2028024	20 中信银行二级	22,655	2,381,669.10
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2028024	20 中信银行二级	5,560	583,161.78
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	22,351	2,293,943.40
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	37,758	4,018,244.66
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2028040	20 交通银行永续债	6,577	692,729.21
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2128011	21 邮储银行永续债 01	3,293	355,848.91
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2305918	23 厦门债 16	13,320	1,459,853.49

中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	231738	24 江西 13	365	37,350.54
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	231917	24 广东 64	2,977	299,526.10
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	231917	24 广东 64	2,977	299,823.81
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	231917	24 广东 64	2,977	299,823.81
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	231917	24 广东 64	2,977	299,674.95
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	231917	24 广东 64	20,839	2,098,766.64
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	231917	24 广东 64	5,954	599,647.61
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	231917	24 广东 64	5,954	599,647.61

中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	231920	24 广东 67	8,274	829,218.47
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	231971	24 青岛 56	3,016	301,689.70
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	232188	24 广东 39	365	36,937.05
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	232480020	24 兴业银行二级资本债 01	1,549	154,872.90
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	232480020	24 兴业银行二级资本债 01	4,678	467,808.90
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	232480034	24 建行二级资本债 02B	145	14,507.00
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2405415	24 北京债 31	538	54,402.41
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2405422	24 北京债 38	538	54,402.41

中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2405579	24 厦门债 26	2,763	276,357.53
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2405579	24 厦门债 26	3,039	303,934.57
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2405616	24 青岛债 41	3,027	302,694.07
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2405628	24 新疆债 29	9,060	905,820.32
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2405674	24 江西债 46	2,977	297,501.44
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2405806	24 江苏债 20	11,032	1,106,220.36
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2422005	24 农银金租债 01	8,531	853,053.00
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2422007	24 招银金租债 01	574	57,424.40

中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2422015	24 招联消费金融债 03	182	18,202.60
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	2422024	24 招联消费金融债 04	1,609	160,863.00
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	10,304	1,088,396.00
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	15,103	1,596,687.97
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	22,655	2,395,826.13
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	3,814	401,466.82
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	4,568	480,302.10
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242380019	23 邮储永续债 01	6,869	725,988.21

中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	1,712	173,776.57
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	109	10,921.77
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	109	10,921.77
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	13,590	1,389,955.17
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	2,014	201,442.00
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	218	21,837.91
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	218	21,828.47
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	3,424	347,553.14

中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	3,424	347,553.14
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	327	32,742.70
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	327	32,756.86
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	436	43,687.08
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	436	43,687.08
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	545	54,571.17
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	7,309	736,390.56
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	8,561	869,600.43

中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	8,561	868,495.89
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	8,561	869,600.43
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400005	24 农行永续债 01	8,940	911,521.18
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	1,826	183,994.27
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	15,103	1,523,871.86
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	22,655	2,283,748.01
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400009	24 农行永续债 02	6,667	666,740.00
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400016	24 民生银行永续债 01	1,076	107,648.00

中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400016	24 民生银行永续债 01	8,907	890,743.00
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400029	24 民生银行永续债 02	1,019	101,878.40
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	10,385	1,044,896.05
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	17,308	1,741,695.93
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	17,308	1,741,695.93
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	5,541	554,106.91
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	242480082	24 农行永续债 03BC	6,188	618,810.00
中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	282380002	23 太保寿险永续债 01	5,195	547,281.71

中国银行股份有限公司，招商银行股份有限公司	282400001	24 太保寿险永续债 01	2,787	281,333.95
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	16,443	1,684,870.96
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	29,639	3,036,477.61
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	3,293	337,386.40
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	10,579	1,097,563.27
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	12,159	1,263,114.63
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	14,935	1,551,408.37
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	22,665	2,352,830.97

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	5,530	575,048.76
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	7,593	788,462.10
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	10,644	1,080,552.87
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	11,389	1,158,536.68
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	18,132	1,843,354.90
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	2,765	281,535.30
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	5,530	563,070.59
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	2,912	309,365.09

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	15,186	1,626,878.69
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	3,295	353,562.70
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	3,545	380,183.92
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	7,090	760,367.83
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	9,123	939,758.78
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	9,866	1,023,950.36
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	6,577	677,098.12
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	9,866	1,045,454.45

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	3,293	345,097.88
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	10,917	1,235,074.80
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	1,714	179,287.30
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	15,847	1,660,323.77
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	6,858	717,149.18
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	8,572	896,436.48
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	109	11,348.59
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	6,330	667,688.41

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	1,084	108,415.20
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	1,122	112,220.00
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	1,712	170,735.84
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	10,385	1,064,547.57
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	11,985	1,194,600.74
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	15,788	1,571,098.54
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	17,122	1,712,197.00
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	18,946	1,887,070.75

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	3,424	341,314.50
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	8,572	853,874.81
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	22,655	2,295,231.75
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	30,206	3,060,921.49
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	541	54,093.60
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	8,880	897,577.69
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	10,304	1,047,602.96
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	18,245	1,834,276.70

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	3,435	349,085.58
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	3,575	360,252.71
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	5,442	544,222.00
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	6,894	698,383.55
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	1,531	153,071.40
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	457	45,713.60
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	10,385	1,057,450.47
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	14,299	1,449,149.95

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	6,493	649,332.00
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	6,923	704,966.98
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	9,123	912,460.27
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	2,770	278,988.83
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	1,712	179,224.81
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	3,424	358,207.65
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	3,424	358,207.65

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	5,137	537,311.48
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	092280086	22 农行永续债 02	6,849	716,899.25
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	2020016	20 江苏银行永续债	37,758	3,852,180.52
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	2020016	20 江苏银行永续债	4,533	460,599.38
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	2020016	20 江苏银行永续债	9,066	921,198.76
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	2028017	20 农业银行永续债 01	3,289	342,421.37

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	2028017	20 农业银行永续债 01	37,758	3,831,428.67
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	2028017	20 农业银行永续债 01	6,577	684,723.47
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	2128028	21 邮储银行二级 01	6,587	685,765.27
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	2128028	21 邮储银行二级 01	6,587	685,765.27
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	2128038	21 农业银行永续债 01	3,293	343,327.90
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	2128038	21 农业银行永续债 01	6,587	686,655.79

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	2228011	22 农业银行永续债 01	6,849	711,208.17
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242380017	23 农行永续债 01	1,712	180,231.80
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242380017	23 农行永续债 01	13,799	1,434,742.55
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242380017	23 农行永续债 01	3,424	360,439.72
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242380017	23 农行永续债 01	6,849	720,927.18
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242380017	23 农行永续债 01	8,561	900,808.83

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242380017	23 农行永续债 01	8,561	901,099.30
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400004	24 邮储永续债 01	1,636	163,606.50
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400004	24 邮储永续债 01	10,273	1,042,844.14
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400004	24 邮储永续债 01	218	21,833.72
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400004	24 邮储永续债 01	22,841	2,300,733.97
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400004	24 邮储永续债 01	3,424	347,459.25

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400004	24 邮储永续债 01	3,424	347,536.98
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400004	24 邮储永续债 01	3,424	347,536.98
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400004	24 邮储永续债 01	3,814	384,410.50
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400004	24 邮储永续债 01	3,814	384,410.50
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400004	24 邮储永续债 01	3,814	384,235.46
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400004	24 邮储永续债 01	4,568	460,146.79

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400004	24 邮储永续债 01	545	54,582.74
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400004	24 邮储永续债 01	60,292	6,029,157.00
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400004	24 邮储永续债 01	873	87,334.86
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商银行股份有限公司	242400004	24 邮储永续债 01	9,137	920,293.59
中银国际证券股份有限公司	092200008	22 农行二级资本债 02A	16,466	1,695,124.16
中银国际证券股份有限公司	092200008	22 农行二级资本债 02A	9,123	932,593.88
中银国际证券股份有限公司	115444	23 华租 Y1	7,552	767,048.50
中银国际证券股份有限公司	115778	23 交租 Y1	22,655	2,291,774.17
中银国际证券股份有限公司	137883	22 华租 Y2	7,552	784,057.59

中银国际证 券股份有限 公司	148717	24 中航 K4	2,662	266,608.22
中银国际证 券股份有限 公司	1928008	19 农业银行二 级 03	1,714	189,036.06
中银国际证 券股份有限 公司	1928008	19 农业银行二 级 03	15,430	1,701,324.57
中银国际证 券股份有限 公司	1928008	19 农业银行二 级 03	5,137	567,033.87
中银国际证 券股份有限 公司	1928008	19 农业银行二 级 03	5,137	567,033.87
中银国际证 券股份有限 公司	1928008	19 农业银行二 级 03	6,849	756,045.16
中银国际证 券股份有限 公司	1928011	19 工商银行二 级 03	22,665	2,364,848.08
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	5,322	555,402.08
中银国际证 券股份有限 公司	1928014	19 华夏银行永 续债	7,467	780,142.09
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	15,869	1,643,169.54
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	19,673	2,037,649.39
中银国际证 券股份有限 公司	1928021	19 农业银行永 续债 01	3,651	380,194.05
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	5,322	549,519.35
中银国际证 券股份有限 公司	1928023	19 农业银行永 续债 02	5,477	568,794.52

中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二 级	4,561	460,262.79
中银国际证 券股份有限 公司	2028022	20 民生银行二 级	9,123	920,562.07
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	13,154	1,375,793.82
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	13,181	1,387,259.55
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	3,289	343,927.08
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	3,295	346,814.89
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	2,778	292,699.01
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	2,778	292,699.01
中银国际证 券股份有限 公司	2028033	20 建设银行二 级	8,945	940,473.11
中银国际证 券股份有限 公司	232380052	23 农行二级资 本债 02A	545	56,864.30
中银国际证 券股份有限 公司	232380053	23 农行二级资 本债 02B	820	92,113.15
中银国际证 券股份有限 公司	232480004	24 农行二级资 本债 01A	545	55,045.11
中银国际证 券股份有限 公司	232480011	24 农行二级资 本债 02A	2,757	275,569.13
中银国际证 券股份有限 公司	232480012	24 农行二级资 本债 02B	820	84,440.63

中银国际证 券股份有限 公司	232480054	24 重庆银行二 级资本债 01	517	51,476.14
中银国际证 券股份有限 公司	232480054	24 重庆银行二 级资本债 01	776	77,214.21
中银国际证 券股份有限 公司	232480063	24 东莞银行二 级资本债 02	5,346	534,596.00
中银国际证 券股份有限 公司	240137	23 吉高 03	6,043	631,339.69
中银国际证 券股份有限 公司	241072	凯盛 YK07	7,552	764,386.71
中银国际证 券股份有限 公司	241205	GC 华租 Y5	7,552	756,248.37
中银国际证 券股份有限 公司	241218	凯盛 YK09	22,655	2,266,218.01
中银国际证 券股份有限 公司	2420002	24 北部湾银行 小微债 01	270	27,006.70
中银国际证 券股份有限 公司	2420004	24 北部湾银行 小微债 02	4,231	423,075.00
中银国际证 券股份有限 公司	2420049	24 东莞银行 03	534	53,410.40
中银国际证 券股份有限 公司	2422017	24 汇通金租债 01	10,352	1,035,192.00
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	10,883	1,088,282.00
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	15,103	1,518,827.23
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	15,103	1,518,582.75

中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	22,655	2,282,475.31
中银国际证 券股份有限 公司	242400011	24 广发银行永 续债 01	30,206	3,022,066.85
中银国际证 券股份有限 公司	242400018	24 北京农商行 永续债 01	12,725	1,272,455.00
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	1,712	170,441.60
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	17,122	1,704,300.46
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	37,758	3,806,885.00
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	6,849	681,766.40
中银国际证 券股份有限 公司	242480002	24 兴业银行永 续债 01	8,561	852,404.05
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	15,103	1,520,319.28
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	22,655	2,289,849.22
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	3,651	367,694.43
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	3,655	371,284.40
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	37,758	3,782,813.61
中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	4,610	460,985.00

中银国际证 券股份有限 公司	242480004	24 华夏银行永 续债 01	8,880	896,632.83
中银国际证 券股份有限 公司	255516	24 漳龙 05	1,655	165,492.60
中银国际证 券股份有限 公司	360036	工行优 2	5,165	518,249.58
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	1,284	37,631.27
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	1,466	37,754.68
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	1,582	40,608.71
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	2,054	60,265.38
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	2,663	78,458.77
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	2,926	75,594.61
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	5,060	150,825.80
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	5,870	151,363.66
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	6,968	197,469.33
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	1,698	72,304.10
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	868	37,541.26

中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	879	36,679.34
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	9,004	370,394.12
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	21,668	113,538.24
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	24,400	137,373.21
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	7,211	39,229.38
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	1928025	19 交通银行永 续债	13,900	1,437,276.44
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	1928025	19 交通银行永 续债	16,477	1,702,579.48
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	1928025	19 交通银行永 续债	3,040	314,104.34
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	1928025	19 交通银行永 续债	3,651	378,915.01
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	1928025	19 交通银行永 续债	7,090	732,661.22

中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	2028018	20 交通银行二 级	5,514	557,744.16
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	2028018	20 交通银行二 级	8,271	836,411.94
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	2228014	22 交通银行二 级 01	16,466	1,691,233.83
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	2228014	22 交通银行二 级 01	6,577	675,720.51
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	232480039	24 广发银行二 级资本债 01A	1,076	107,648.00
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	232480039	24 广发银行二 级资本债 01A	1,640	164,028.00
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	232480040	24 广发银行二 级资本债 01B	646	64,588.80
中银国际证 券股份有限 公司，招商 银行股份有 限公司	232480040	24 广发银行二 级资本债 01B	984	98,416.80

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）
招商基金管理 有限公司	012644	招商中证红利 ETF 联接 C	138,508	151,389.36
招商基金管 理有限公司	180502	招商基金招商 蛇口租赁住房 REIT	6,830	18,625.73
招商基金管 理有限公司	180502	招商基金招商 蛇口租赁住房 REIT	8,986	24,505.74
招商基金管 理有限公司	515080	招商中证红利 ETF	123,844	189,233.73
招商基金管 理有限公司	515080	招商中证红利 ETF	183,297	279,119.16
招商基金管 理有限公司	515080	招商中证红利 ETF	184,047	279,164.18
招商基金管 理有限公司	515080	招商中证红利 ETF	184,082	279,166.81
招商基金管 理有限公司	515080	招商中证红利 ETF	232,785	352,790.41
招商基金管 理有限公司	515080	招商中证红利 ETF	251,275	399,023.05
招商基金管 理有限公司	515080	招商中证红利 ETF	255,358	388,144.89
招商基金管 理有限公司	515080	招商中证红利 ETF	38	58.06
招商基金管 理有限公司	515080	招商中证红利 ETF	48,342	77,615.57
招商基金管 理有限公司	515080	招商中证红利 ETF	58	87.82
招商基金管 理有限公司	515080	招商中证红利 ETF	58	88.64
招商基金管 理有限公司	515080	招商中证红利 ETF	73,545	106,645.43
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	16,073,725	15,000,000.00
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	6,525,285	6,000,000.00

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	8,686,588	7,500,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	117,935,226	130,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	14,178,633	15,700,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	15,365,148	17,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	18,175,209	20,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	22,683,967	25,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202132	中银证券中国 红-汇中 32 号 集合资产管理 计划	31,844,317	36,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQZLJ C20230228	中银证券中国 红-汇中战略 基础集合资产 管理计划	16,769,145	15,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQZLJ C20230228	中银证券中国 红-汇中战略 基础集合资产 管理计划	16,831,239	15,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQZLJ C20230228	中银证券中国 红-汇中战略 基础集合资产 管理计划	8,223,684	7,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYZQZLJ C20230228	中银证券中国 红-汇中战略 基础集合资产 管理计划	9,725,524	9,000,000.00

中银基金管理有限公司	018581	中银纯债债券D	2,772,942	3,164,758.35
中银基金管理有限公司	018581	中银纯债债券D	4,024,178	4,568,247.32
中银基金管理有限公司	018581	中银纯债债券D	531,898	604,236.59
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	1,989,852	2,000,000.00
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	3,967,073	4,000,000.00
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	5,957,700	6,000,000.00
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	7,439,000	7,500,000.00

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）
14日质押式正回购	招商基金管理有限公司	21,235,813.70
14日质押式正回购	中银基金管理有限公司	1,846,970.10
1日质押式正回购	招商银行股份有限公司	168,226,614.54
1日质押式正回购	招商基金管理有限公司	13,532,926.94
1日质押式正回购	大家资产管理有限责任公司	1,170,858.40
28日质押式正回购	中银基金管理有限公司	2,452,960.80
2日质押式正回购	招商银行股份有限公司	10,982,458.84
3日质押式正回购	招商银行股份有限公司	62,017,167.19
3日质押式正回购	招商基金管理有限公司	13,396,306.82
4日质押式正回购	招商银行股份有限公司	12,401,309.75
4日质押式正回购	招商基金管理有限公司	10,726,814.41
5日质押式正回购	招商基金管理有限公司	302,139.00

6日质押式正回购	招商银行股份有限公司	2,037,036.00
7日质押式正回购	招商基金管理有限公司	171,842,296.36
7日质押式正回购	招商银行股份有限公司	115,447,783.47
7日质押式正回购	中银基金管理有限公司	17,303,995.75
7日质押式正回购	大家资产管理有限责任公司	4,308,845.00
7日质押式逆回购	招商银行股份有限公司	14,902.50
8日质押式正回购	招商基金管理有限公司	7,764,051.75
8日质押式正回购	招商银行股份有限公司	4,561,307.00
分销买入	中国银行股份有限公司	62,468,378.85
分销买入	中银国际证券股份有限公司	2,987,214.60
同业借款资产服务费	中国银行股份有限公司	63,687.50
现券买入	中国银行股份有限公司	37,114,745.31
现券买入	招商银行股份有限公司	17,068,652.23
现券卖出	招银理财有限责任公司	265,788.24
现券卖出	招商银行股份有限公司	237,140.02
非标资产服务费	中国银行股份有限公司	1,092,156.64

## 八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市，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，控制产品久期风险。增配非标资产，择机适当增加权益资产和可转债的配置和交易。

关于《中银理财“福”固收增强（封闭式）养老理财产品2022年003期2024年年报报告》托管人复核意见的回函

中银理财有限责任公司：

托管人声明：本报告期内，资产托管人严格遵守有关法律法规、托管协议、资产管理合同/基金合同关于托管人职责的约定，尽职尽责地履行了托管职责并安全保管托管资产。

在管理人提供的各项数据和信息真实、准确、有效的前提下，在我行能够知悉和掌握的情况范围内，我行对《中银理财“福”固收增强（封闭式）养老理财产品2022年003期2024年年报报告》报告中的截至报告期末存续规模及收益表现、穿透前持仓情况进行了复核。

特此报告。

招商银行股份有限公司北京分行

2025年3月5日