

中银理财“福”固收增强（封闭式）养老理财产品 2022 年
01 期
2025 年半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：中国光大银行股份有限公司

报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

一、理财产品基本情况

理财产品代码	YLFFB2201
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 01 期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001022000388
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	2022-08-22
理财产品到期日	2027-08-26

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
YLFFB2201	5,961,794,965.66	1.103145	1.119645	6,576,727,032.32	1.73%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：109.55%

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	1,171.31	0.18%	7,742.41	1.08%

同业存单	-	0.00%	-	0.00%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	1,561.67	0.22%
债券	-	0.00%	442,680.43	61.89%
非标准化债权类 资产	7,196.86	1.09%	194,996.86	27.26%
权益类投资	-	0.00%	12,792.36	1.79%
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	21,797.27	3.31%	55,456.66	7.75%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	627,457.64	95.41%	-	0.00%
合计	657,623.09	100%	715,230.40	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	YLFFB2201-20250410-1: 云瀚信息科技有限公司	36,800.00	5.15%
2	YLFFB2201-20220829-1: 珠海华发集团有限公司	34,800.00	4.87%
3	YLFFB2201-20241128-1: 湖北省联合发展投资集团有限公司	27,000.00	3.78%
4	YLFFB2201-20250107-1: 武汉金融控股（集团）有限公司	24,000.00	3.36%
5	YLFFB2201-20250328-1: 云瀚信息科技有限公司	22,200.00	3.10%
6	012708: 东方红中证东方红利低波动指数 A	21,797.27	3.05%
7	YLFFB2201-20250624-1: 绍兴市上虞杭州湾经开区控股集团有限公司	19,000.00	2.66%
8	YLFFB2201-20240814-1: 中国平煤神马控股集团有限公司(34507)	16,000.00	2.24%

9	184409: 22 汉江 01	13,917.76	1.95%
10	968052: 摩根国际债券人民币	12,725.52	1.78%

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 01 期
账号	35150180809689888
开户行	中国光大银行股份有限公司北京西直门支行

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，投资经理积极抓住债券市场调整机会，捕捉投资机会，以期追求较好的资本利得收益；同时，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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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

湖北金融租赁股份有限公司	湖北金融租赁股份有限公司	142	2.78	同业借款借出	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	505	3.88	信托贷款	正常
绍兴市上虞杭州湾经开区控股集团有限公司	绍兴市上虞杭州湾经开区控股集团有限公司信托贷款非标理财项目	358	3.49	信托贷款	正常
武汉金融控股（集团）有限公司	武汉金融控股（集团）有限公司信托贷款非标理财项目	190	3.62	信托贷款	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	627	2.68	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	268	2.60	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	45	3.60	信托贷款	正常
重庆市微恒科技有限公司	重庆市微恒科技有限公司其他债权类资产非标理财项目	544	2.35	其他债权类资产	正常
珠海华发集团有限公司	珠海华发集团有限公司信托贷款非标理财项目	60	5.09	信托贷款	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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日期间投资于关联方发行的证券

关联方名称	证券代码	证券简称	报告期内买入证券	
			数量（单位：张）	总金额（单位：元）
招商证券股份有限公司	185697	22 招证 Y2	31,038	3,211,103.75
招商证券股份有限公司	600999	招商证券	16	259.06
招商证券股份有限公司	600999	招商证券	16	264.46

招商证券股份有限公司	600999	招商证券	24	397.81
招商证券股份有限公司	600999	招商证券	49	886.18
招商证券股份有限公司	600999	招商证券	8	132.23
中国光大环境(集团)有限公司	132580029	25 光大环境GN001(碳中和债)	55,980	5,598,047.00
中国光大银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	22,352	2,312,721.43
中国光大银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	7,451	770,907.14
中国光大银行股份有限公司	2028037	20 光大银行永续债	7,451	770,907.14
中国光大银行股份有限公司	601818	光大银行	1,391	5,590.46
中国光大银行股份有限公司	601818	光大银行	1,399	5,580.44
中国光大银行股份有限公司	601818	光大银行	1,399	5,552.47
中国光大银行股份有限公司	601818	光大银行	1,407	5,572.10
中国光大银行股份有限公司	601818	光大银行	16,260	61,461.47
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	000039	中集集团	246	1,980.62
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	000039	中集集团	254	2,069.94

中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	000039	中集集团	262	2,054.68
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	000039	中集集团	723	5,962.20
中远海运发展股份有限公司	601866	中远海发	1,558	4,224.43
中远海运发展股份有限公司	601866	中远海发	532	1,442.87
中远海运发展股份有限公司	601866	中远海发	540	1,356.33
中远海运发展股份有限公司	601866	中远海发	564	1,411.40

本产品于 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日期间投资于关联方承销的证券

关联方名称	证券代码	证券简称	报告期内买入证券	
			数量（单位：张）	总金额（单位：元）
东方证券股份有限公司	032501154	25 商丘发展 PPN001	11,152	1,115,225.20
东方证券股份有限公司	102580872	25 信达投资 MTN001	110,195	11,019,457.80
东方证券股份有限公司	257691	25 融汇 01	30,610	3,060,960.50
东方证券股份有限公司	258437	25 华靖 02	7,129	712,904.40
东方证券股份有限公司	258437	25 华靖 02	9,499	949,948.80
东方证券股份有限公司	258478	25 融控 05	1,164	116,404.50
东方证券股份有限公司	258478	25 融控 05	4,658	465,837.30
东方证券股份有限公司	601567	三星医疗	373	9,225.64
东方证券股份有限公司	601567	三星医疗	5,850	144,267.29

东方证券股份有限公司	601567	三星医疗	95	2,204.87
东方证券股份有限公司	601567	三星医疗	95	2,288.63
东方证券股份有限公司, 招商证券股份有限公司	242808	25 厦贸 Y4	1,174	117,396.50
东方证券股份有限公司, 中国银行股份有限公司	102581368	25 陕煤化 MTN001	5,799	579,875.30
东方证券股份有限公司, 中国银行股份有限公司	2405194	24 湖南债 08	21,199	2,360,419.28
东方证券股份有限公司, 中国银行股份有限公司	2471208	24 浙江债 60	7,114	743,518.19
东方证券股份有限公司, 中国银行股份有限公司, 光大证券股份有限公司, 招商证券股份有限公司	232580008	25 工行二级资本债 02BC	22,945	2,301,963.56
东方证券股份有限公司, 中国银行股份有限公司, 光大证券股份有限公司, 招商证券股份有限公司	232580008	25 工行二级资本债 02BC	68,834	6,905,890.67

东方证券股份有限公司, 中国银行股份有限公司, 招商证券股份有限公司	242580003	25 平安银行永续债 01BC	43,289	4,322,937.74
东方证券股份有限公司, 中国银行股份有限公司, 招商证券股份有限公司	242580003	25 平安银行永续债 01BC	52,043	5,238,245.84
东方证券股份有限公司, 中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司, 光大证券股份有限公司, 招商证券股份有限公司	232580001	25 工行二级资本债 01BC	22,945	2,316,100.77
东方证券股份有限公司, 中国银行股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司, 光大证券股份有限公司, 招商证券股份有限公司	232580001	25 工行二级资本债 01BC	8,532	853,088.50
东方证券股份有限公司, 中银国际证券股份有限公司	258418	25 港投 06	7,754	775,433.85

光大证券股份有限公司	002142	宁波银行	265	7,042.90
光大证券股份有限公司	002142	宁波银行	55	1,469.99
光大证券股份有限公司	002142	宁波银行	904	23,331.26
光大证券股份有限公司	002807	江阴银行	1,256	5,499.39
光大证券股份有限公司	002807	江阴银行	1,256	5,449.17
光大证券股份有限公司	002807	江阴银行	1,256	5,562.17
光大证券股份有限公司	002807	江阴银行	1,256	5,587.28
光大证券股份有限公司	002807	江阴银行	1,724	8,066.76
光大证券股份有限公司	002807	江阴银行	14,639	60,559.09
光大证券股份有限公司	002807	江阴银行	971	4,563.35
光大证券股份有限公司	032400994	24 昆明轨道 PPN001	25,661	2,615,832.75
光大证券股份有限公司	032580362	25 常德经建 PPN001	5,798	579,830.20
光大证券股份有限公司	102581899	25 天恒置业 MTN003	14,249	1,424,923.20
光大证券股份有限公司	133992	25 大悦 02	2,090	208,957.50
光大证券股份有限公司	134243	25 蒙交 01	28,498	2,849,846.40
光大证券股份有限公司	2228060	22 建设银行三 农债	24,923	2,527,548.08
光大证券股份有限公司	242798	25 东资 01	4,445	444,279.40
光大证券股份有限公司	605117	德业股份	167	14,391.67
光大证券股份有限公司	605117	德业股份	167	14,963.43
光大证券股份有限公司	605117	德业股份	175	15,847.89
光大证券股份有限公司	605117	德业股份	240	19,966.71
光大证券股份有限公司	605117	德业股份	397	36,303.01

光大证券股份有限公司	605117	德业股份	688	61,667.79
光大证券股份有限公司	688360	德马科技	3,121	54,694.32
光大证券股份有限公司	688360	德马科技	382	6,495.17
光大证券股份有限公司, 招商证券股份有限公司	134186	25 晋桥 YK01	10,456	1,045,627.80
光大证券股份有限公司, 招商证券股份有限公司	134186	25 晋桥 YK01	23,292	2,325,231.76
光大证券股份有限公司, 招商证券股份有限公司	134186	25 晋桥 YK01	4,718	471,849.20
光大证券股份有限公司, 招商证券股份有限公司	232380069	23 建行二级资本债 02A	42,708	4,547,522.99
招商证券股份有限公司	002714	牧原股份	1,073	42,093.80
招商证券股份有限公司	002714	牧原股份	366	14,604.24
招商证券股份有限公司	002714	牧原股份	373	14,693.09
招商证券股份有限公司	002714	牧原股份	389	15,321.27
招商证券股份有限公司	102501332	25 京城建 MTN001	42,569	4,256,915.00
招商证券股份有限公司	102581997	25 乌江水电 MTN003	4,257	425,691.50
招商证券股份有限公司	113056	重银转债	1,085	127,286.67
招商证券股份有限公司	113056	重银转债	1,710	202,732.91
招商证券股份有限公司	113056	重银转债	16	1,902.53

招商证券股份有限公司	113056	重银转债	18	2,147.69
招商证券股份有限公司	113056	重银转债	2,611	308,447.83
招商证券股份有限公司	113056	重银转债	26	3,044.95
招商证券股份有限公司	113056	重银转债	558	65,539.51
招商证券股份有限公司	113056	重银转债	81	9,640.21
招商证券股份有限公司	115709	23 航租 03	10,456	1,070,325.67
招商证券股份有限公司	115709	23 航租 03	15,684	1,605,488.51
招商证券股份有限公司	115709	23 航租 03	5,228	535,162.84
招商证券股份有限公司	115709	23 航租 03	5,228	535,162.84
招商证券股份有限公司	115811	凯盛 YK06	30,911	3,193,637.91
招商证券股份有限公司	118024	冠宇转债	4,194	473,910.61
招商证券股份有限公司	118024	冠宇转债	5,358	634,293.93
招商证券股份有限公司	118024	冠宇转债	5,385	633,492.98
招商证券股份有限公司	118024	冠宇转债	5,593	631,130.36
招商证券股份有限公司	188455	21 中证 Y1	28,680	3,000,031.02
招商证券股份有限公司	2028051	20 浦发银行永续债	11,342	1,169,883.44
招商证券股份有限公司	232480007	24 建行二级资本债 01B	14,430	1,513,297.15
招商证券股份有限公司	232480007	24 建行二级资本债 01B	14,430	1,514,522.59
招商证券股份有限公司	232480007	24 建行二级资本债 01B	29,015	3,083,374.02
招商证券股份有限公司	232480007	24 建行二级资本债 01B	43,523	4,625,061.03
招商证券股份有限公司	300960	通业科技	1,065	23,077.50
招商证券股份有限公司	300960	通业科技	1,326	32,096.35

招商证券股份有限公司	300960	通业科技	451	10,213.55
招商证券股份有限公司	300960	通业科技	453	9,826.49
招商证券股份有限公司	300960	通业科技	461	10,757.28
招商证券股份有限公司	600019	宝钢股份	1,192	8,272.45
招商证券股份有限公司	600019	宝钢股份	1,200	8,371.78
招商证券股份有限公司	600019	宝钢股份	1,240	8,454.58
招商证券股份有限公司	600019	宝钢股份	3,449	24,021.88
招商证券股份有限公司	600036	招商银行	1,572	68,545.47
招商证券股份有限公司	600036	招商银行	135	5,981.75
招商证券股份有限公司	600036	招商银行	135	5,934.63
招商证券股份有限公司	600036	招商银行	135	5,908.56
招商证券股份有限公司	600036	招商银行	143	6,323.14
招商证券股份有限公司	600036	招商银行	221	9,838.81
招商证券股份有限公司	600036	招商银行	531	22,765.90
招商证券股份有限公司	600036	招商银行	6,367	271,105.00
招商证券股份有限公司	601963	重庆银行	540	6,229.68
招商证券股份有限公司	601963	重庆银行	540	6,051.44
招商证券股份有限公司	601963	重庆银行	540	6,077.19
招商证券股份有限公司	601963	重庆银行	540	6,206.24
招商证券股份有限公司	601963	重庆银行	6,288	54,197.19
中国光大银行股份有限公司	012580772	25 保利久联 SCP002	29,504	2,950,442.50

中国光大银行股份有限公司	032501053	25 连云城建 PPN001	6,122	612,197.83
中国光大银行股份有限公司	032580029	25 泉州台商 PPN001	37,926	3,792,630.00
中国光大银行股份有限公司	032580347	25 建德国资 PPN002	8,514	851,383.00
中国光大银行股份有限公司	102580105	25 武金控 MTN001	7,007	700,706.80
中国光大银行股份有限公司	600694	大商股份	262	6,455.13
中国光大银行股份有限公司	600694	大商股份	262	6,531.89
中国光大银行股份有限公司	600694	大商股份	262	6,238.35
中国光大银行股份有限公司	600694	大商股份	270	6,549.85
中国光大银行股份有限公司	600694	大商股份	3,095	75,834.81
中国光大银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102501254	25 山西建投 MTN003	8,514	851,383.00
中国光大银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	102581620	25 兰花科技 MTN002	57,923	5,779,389.67
中国光大银行股份有限公司，中国银行股份有限公司	2005970	20 陕西债 55	21,199	2,932,017.81

中国光大银行股份有限公司，中国银行股份有限公司，光大证券股份有限公司	102501137	25 山西建投 MTN001	33,198	3,320,000.02
中国光大银行股份有限公司，中国银行股份有限公司，光大证券股份有限公司	272580001	25 东方二级资本债 01BC	15,185	1,518,451.50
中国光大银行股份有限公司，中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商证券股份有限公司	242580008	25 招商银行永续债 01BC	37,267	3,726,698.40
中国银行股份有限公司	012483861	24 中建三局 SCP013(科创票据)	71,135	7,144,908.03
中国银行股份有限公司	032580404	25 创星 PPN001(科创债)	4,065	406,455.60
中国银行股份有限公司	082580533	25 平安安新 ABN001 优先 A2	21,267	2,126,674.80
中国银行股份有限公司	092280083	22 建行永续债 01	14,606	1,525,066.09
中国银行股份有限公司	102501180	25 陕投集团 MTN001	6,166	616,582.80
中国银行股份有限公司	102501194	25 北部湾 MTN002	25,685	2,569,125.94
中国银行股份有限公司	102501336	25 象屿 MTN004	30,369	3,036,903.00
中国银行股份有限公司	102501359	25 鲁宏桥 MTN004	8,514	851,383.00

中国银行股份有限公司	102501361	25 鲁宏桥 MTN005(科创 债)	17,044	1,704,354.00
中国银行股份有限公司	102501398	25 建发集 MTN002	19,587	1,958,811.11
中国银行股份有限公司	102501422	25 晋能煤业 MTN007	2,018	201,771.80
中国银行股份有限公司	102501422	25 晋能煤业 MTN007	7,135	713,507.87
中国银行股份有限公司	102580091	25 北部湾 MTN001A	75,853	7,585,260.00
中国银行股份有限公司	102580116	25 象屿 MTN001	7,585	758,526.00
中国银行股份有限公司	102580180	25 正泰 MTN001(科创 票据)	12,831	1,295,124.49
中国银行股份有限公司	102580193	25 厦国贸控 MTN001	40,732	4,073,224.80
中国银行股份有限公司	102580284	25 鲁商 MTN001	18,365	1,836,467.70
中国银行股份有限公司	102580323	25 拜耳 MTN001BC	30,608	3,060,980.76
中国银行股份有限公司	102580381	25 国贸资本 MTN001	12,243	1,224,311.80
中国银行股份有限公司	102580593	25 云南交投 MTN002	44,702	4,470,169.90
中国银行股份有限公司	102580779	25 豫航空港 MTN002	12,794	1,279,398.60
中国银行股份有限公司	102580906	25 云建投 MTN002	30,610	3,060,960.50
中国银行股份有限公司	102580987	25 宝钢 MTN002(科创 票据)	14,901	1,485,832.79
中国银行股份有限公司	102581044	25 海尔金盈 MTN001	18,709	1,870,865.40
中国银行股份有限公司	102581116	25 中国水电 MTN001	26,792	2,679,208.74
中国银行股份有限公司	102581165	25 华发集团 MTN001(绿 色)	37,384	3,738,768.80
中国银行股份有限公司	102581334	25 安徽建工 MTN001(科创 票据)	57,988	5,798,753.00

中国银行股份有限公司	102581338	25 山西文旅 MTN001	59,009	5,901,358.69
中国银行股份有限公司	102581349	25 陕西交控 MTN002	5,799	579,875.30
中国银行股份有限公司	102581388	25 电网 MTN018	57,923	5,857,227.42
中国银行股份有限公司	102581388	25 电网 MTN018	86,885	8,785,841.13
中国银行股份有限公司	102581596	25 华润电力 MTN001	5,390	538,987.60
中国银行股份有限公司	102581676	25 鄂联投 MTN002B	21,421	2,142,124.80
中国银行股份有限公司	102581776	25 盈峰 MTN002	24,297	2,429,692.73
中国银行股份有限公司	102581808	25 电网 MTN019	114,724	11,504,397.46
中国银行股份有限公司	102581833	25 中交二航 MTN001(科创 票据)	18,999	1,900,014.20
中国银行股份有限公司	102581937	25 国贸地产 MTN001	7,444	744,913.52
中国银行股份有限公司	102582012	25 厦国贸控 MTN004	8,514	851,368.00
中国银行股份有限公司	102582273	25 国新控股 MTN001(稳增长 扩投资专项 债)	45,890	4,591,592.85
中国银行股份有限公司	102582392	25 北部湾 MTN004B	12,141	1,214,136.40
中国银行股份有限公司	102582435	25 鲁钢铁 MTN008	6,071	607,068.20
中国银行股份有限公司	102582474	25 北部湾投 MTN003A	10,207	1,020,705.50
中国银行股份有限公司	102582474	25 北部湾投 MTN003A	30,443	3,044,308.00
中国银行股份有限公司	102582495	25 香格里拉 MTN002B(BC)	24,306	2,430,555.20
中国银行股份有限公司	102582635	25 神达能源 MTN002	7,089	708,891.60
中国银行股份有限公司	2023001	20 人民财险	10,388	1,072,204.37
中国银行股份有限公司	2023016	20 中财再保险	14,332	1,475,066.40

中国银行股份有限公司	2023016	20 中财再保险	14,439	1,488,482.05
中国银行股份有限公司	2120092	21 徽商银行二级 01	77,594	8,008,446.12
中国银行股份有限公司	2128022	21 交通银行永续债	14,439	1,529,381.43
中国银行股份有限公司	2220035	22 厦门国际银行小微债 01	29,303	3,007,953.27
中国银行股份有限公司	2220041	22 海峡银行小微债 01	17,582	1,805,283.50
中国银行股份有限公司	2228038	22 民生银行永续债 01	31,038	3,235,673.23
中国银行股份有限公司	2228038	22 民生银行永续债 01	46,557	4,853,980.07
中国银行股份有限公司	231861	24 江苏 18	8,512	924,638.43
中国银行股份有限公司	232480032	24 兴业银行二级资本债 02	14,470	1,482,557.43
中国银行股份有限公司	232480033	24 建行二级资本债 02A	7,108	725,780.86
中国银行股份有限公司	232480106	24 建行二级资本债 03BC	220,483	22,174,376.28
中国银行股份有限公司	232580002	25 建行二级资本债 01BC	159,181	16,005,172.58
中国银行股份有限公司	242400032	24 威海商行永续债 01	7,089	729,207.79
中国银行股份有限公司	242580003	25 平安银行永续债 01BC	13,523	1,373,068.64
中国银行股份有限公司	242580003	25 平安银行永续债 01BC	54,091	5,493,803.06
中国银行股份有限公司	242580009	25 湖南银行永续债 01	13,975	1,397,511.90
中国银行股份有限公司	242580012	25 建行永续债 01BC	214,572	21,457,213.90
中国银行股份有限公司	242580015	25 招商银行永续债 02BC	79,337	7,933,651.60
中国银行股份有限公司	2471243	24 陕西债 44	52,996	5,528,161.25
中国银行股份有限公司	2505090	25 陕西债 05	21,199	2,043,240.93
中国银行股份有限公司	272400007	24 中国人寿资本补充债 01BC	114,724	11,731,453.17

中国银行股份有限公司	282500008	25 工银安盛永续债 01	19,072	1,939,081.41
中国银行股份有限公司	282580003	25 平安人寿永续债 01	18,366	1,836,576.30
中国银行股份有限公司	332580002	25 兴业银行科创债 01	4,261	426,088.50
中国银行股份有限公司	UL570016	25 鲁宏桥 GN002(乡村振兴)	33,804	3,380,370.60
中国银行股份有限公司, 光大证券股份有限公司	012580456	25 冀中能源 SCP002(科创票据)	115,585	11,558,473.20
中国银行股份有限公司, 光大证券股份有限公司	102582627	25 山西建投 MTN004A	14,316	1,431,566.40
中国银行股份有限公司, 光大证券股份有限公司	102582627	25 山西建投 MTN004A	2,510	251,014.00
中国银行股份有限公司, 光大证券股份有限公司	102582628	25 山西建投 MTN004B	14,316	1,431,566.40
中国银行股份有限公司, 光大证券股份有限公司	102582628	25 山西建投 MTN004B	2,510	251,014.00
中国银行股份有限公司, 光大证券股份有限公司	102582628	25 山西建投 MTN004B	7,089	709,093.08
中国银行股份有限公司, 光大证券股份有限公司	132500015	25 河钢集 GN002	14,887	1,488,748.00

中国银行股份有限公司，光大证券股份有限公司	132500015	25 河钢集 GN002	2,329	232,941.60
中国银行股份有限公司，光大证券股份有限公司	132580020	25 河钢集 GN001	30,610	3,061,186.09
中国银行股份有限公司，光大证券股份有限公司	132580029	25 光大环境 GN001(碳中和 债)	55,980	5,598,047.00
中国银行股份有限公司，光大证券股份有限公司	2023014	20 中国人寿财 险	7,235	745,247.75
中国银行股份有限公司，光大证券股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	22,352	2,312,721.43
中国银行股份有限公司，光大证券股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	7,451	770,907.14
中国银行股份有限公司，光大证券股份有限公司	2028037	20 光大银行永 续债	7,451	770,907.14
中国银行股份有限公司，光大证券股份有限公司	232580008	25 工行二级资 本债 02BC	45,890	4,611,233.62

中国银行股份有限公司，光大证券股份有限公司	232580008	25 工行二级资本债 02BC	68,834	6,916,850.44
中国银行股份有限公司，光大证券股份有限公司	242580019	25 浦发银行永续债 01	42,922	4,292,151.00
中国银行股份有限公司，光大证券股份有限公司，招商证券股份有限公司	2128025	21 建设银行二级 01	62,076	6,336,251.54
中国银行股份有限公司，招商证券股份有限公司	032501047	25 悦达 PPN001	24,486	2,448,623.60
中国银行股份有限公司，招商证券股份有限公司	102581791	25 香格里拉 MTN001B(BC)	30,369	3,036,903.00
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	28,432	2,946,198.40
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	35,540	3,682,545.42
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	107,219	11,211,266.64

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242580014	25 北京银行永续债 01	54,091	5,444,932.94
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242580014	25 北京银行永续债 01	67,614	6,801,915.93
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242580018	25 江苏银行永续债 02BC	13,523	1,354,762.08
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242580018	25 江苏银行永续债 02BC	27,046	2,709,562.94
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242580018	25 江苏银行永续债 02BC	40,569	4,065,235.53
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司	242580022	25 民生银行永续债 01	137,776	13,777,614.00
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，光大证券股份有限公司	2128021	21 工商银行永续债 01	36,515	3,855,895.44
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，光大证券股份有限公司	232580006	25 民生银行二级资本债 01	22,945	2,309,682.89

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，光大证券股份有限公司	232580006	25 民生银行二级资本债 01	91,779	9,221,685.37
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，光大证券股份有限公司	242400020	24 交行永续债 01BC	40,090	4,090,449.34
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，光大证券股份有限公司，招商证券股份有限公司	2028041	20 工商银行二级 01	14,227	1,465,584.88
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，光大证券股份有限公司，招商证券股份有限公司	2028041	20 工商银行二级 01	21,341	2,198,377.32
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，光大证券股份有限公司，招商证券股份有限公司	2028041	20 工商银行二级 01	7,220	746,053.16

中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，光大证券股份有限公司，招商证券股份有限公司	2128002	21 工商银行二级 01	40,233	4,286,562.23
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，光大证券股份有限公司，招商证券股份有限公司	2228024	22 工商银行二级 03	14,606	1,551,746.94
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商证券股份有限公司	242480007	24 工行永续债 01	50,112	5,141,821.11
中国银行股份有限公司，中银国际证券股份有限公司，招商证券股份有限公司	242580011	25 工行永续债 01BC	34,087	3,408,708.00
中银国际亚洲有限公司	00123	越秀地产	1,091	4,412.49
中银国际亚洲有限公司	00123	越秀地产	1,510	6,242.38
中银国际亚洲有限公司	00123	越秀地产	1,589	6,268.65
中银国际亚洲有限公司	00123	越秀地产	18,667	92,884.40
中银国际亚洲有限公司	00123	越秀地产	2,291	9,176.46

中银国际亚洲有限公司	00123	越秀地产	3,179	13,388.29
中银国际亚洲有限公司	00386	中国石油化工股份	2,702	10,364.15
中银国际亚洲有限公司	00386	中国石油化工股份	2,861	11,055.11
中银国际亚洲有限公司	00386	中国石油化工股份	3,055	11,910.43
中银国际亚洲有限公司	00386	中国石油化工股份	3,709	13,953.41
中银国际亚洲有限公司	00386	中国石油化工股份	32,421	126,470.96
中银国际亚洲有限公司	00386	中国石油化工股份	5,563	20,772.03
中银国际亚洲有限公司	00788	中国铁塔	10,729	114,164.38
中银国际亚洲有限公司	00788	中国铁塔	16,733	168,533.99
中银国际亚洲有限公司	00788	中国铁塔	2,304	24,684.84
中银国际亚洲有限公司	00788	中国铁塔	20,151	202,429.37
中银国际亚洲有限公司	00788	中国铁塔	6,177	70,293.93
中银国际亚洲有限公司	00788	中国铁塔	9,128	98,335.72
中银国际亚洲有限公司	00857	中国石油股份	1,527	10,402.65
中银国际亚洲有限公司	00857	中国石油股份	2,225	13,316.32
中银国际亚洲有限公司	00857	中国石油股份	2,384	14,130.53
中银国际亚洲有限公司	00857	中国石油股份	27,509	150,590.72
中银国际亚洲有限公司	00857	中国石油股份	3,491	22,584.67
中银国际亚洲有限公司	00857	中国石油股份	4,609	26,297.57
中银国际亚洲有限公司	00998	中信银行	1,527	10,380.68
中银国际亚洲有限公司	00998	中信银行	2,463	15,046.51
中银国际亚洲有限公司	00998	中信银行	2,463	15,026.69

中银国际亚洲有限公司	00998	中信银行	29,474	164,036.32
中银国际亚洲有限公司	00998	中信银行	3,818	25,428.48
中银国际亚洲有限公司	00998	中信银行	5,006	29,867.49
中银国际亚洲有限公司	01024	快手-W	1,296	76,625.66
中银国际亚洲有限公司	01024	快手-W	1,779	86,510.46
中银国际亚洲有限公司	01024	快手-W	2,068	97,194.52
中银国际亚洲有限公司	01024	快手-W	2,244	116,326.62
中银国际亚洲有限公司	01024	快手-W	3,958	207,639.22
中银国际亚洲有限公司	01024	快手-W	450	21,992.74
中银国际亚洲有限公司	01288	农业银行	1,855	9,491.99
中银国际亚洲有限公司	01288	农业银行	2,702	12,506.73
中银国际亚洲有限公司	01288	农业银行	2,702	12,351.29
中银国际亚洲有限公司	01288	农业银行	3,818	19,102.81
中银国际亚洲有限公司	01288	农业银行	31,930	143,255.09
中银国际亚洲有限公司	01288	农业银行	5,404	25,059.75
中银国际亚洲有限公司	01800	中国交通建设	1,309	6,570.30
中银国际亚洲有限公司	01800	中国交通建设	1,669	7,878.63
中银国际亚洲有限公司	01800	中国交通建设	1,669	7,755.21
中银国际亚洲有限公司	01800	中国交通建设	10,807	50,910.35
中银国际亚洲有限公司	01800	中国交通建设	2,291	11,193.48
中银国际亚洲有限公司	01800	中国交通建设	3,417	16,011.17
中银国际亚洲有限公司	01800	中国交通建设	8,351	40,246.33

中银国际亚洲有限公司	01800	中国交通建设	982	4,670.81
中银国际亚洲有限公司	01898	中煤能源	1,033	8,447.25
中银国际亚洲有限公司	01898	中煤能源	1,113	9,057.96
中银国际亚洲有限公司	01898	中煤能源	1,855	14,485.63
中银国际亚洲有限公司	01898	中煤能源	12,772	97,128.45
中银国际亚洲有限公司	01898	中煤能源	2,225	17,447.48
中银国际亚洲有限公司	01898	中煤能源	436	3,482.86
中银国际亚洲有限公司	01919	中远海控	1,965	21,691.14
中银国际亚洲有限公司	01919	中远海控	2,564	32,752.67
中银国际亚洲有限公司	01919	中远海控	3,218	43,928.68
中银国际亚洲有限公司	01919	中远海控	3,218	43,950.89
中银国际亚洲有限公司	01919	中远海控	3,439	38,341.88
中银国际亚洲有限公司	01919	中远海控	32,667	368,139.61
中银国际亚洲有限公司	01919	中远海控	6,596	87,181.02
中银国际亚洲有限公司	01919	中远海控	7,091	87,438.98
中银国际亚洲有限公司	01988	民生银行	2,891	12,389.72
中银国际亚洲有限公司	01988	民生银行	36,842	130,340.00
中银国际亚洲有限公司	01988	民生银行	4,291	15,617.66
中银国际亚洲有限公司	01988	民生银行	4,331	15,587.01
中银国际亚洲有限公司	01988	民生银行	5,158	18,896.18
中银国际亚洲有限公司	01988	民生银行	6,327	25,899.28
中银国际亚洲有限公司	01988	民生银行	8,781	31,500.83

中银国际亚洲有限公司	01988	民生银行	9,088	33,126.42
中银国际亚洲有限公司	03668	中铝矿业国际	1,033	24,674.20
中银国际亚洲有限公司	03668	中铝矿业国际	1,041	25,283.57
中银国际亚洲有限公司	03668	中铝矿业国际	2,161	59,613.40
中银国际亚洲有限公司	03668	中铝矿业国际	2,297	53,367.87
中银国际亚洲有限公司	03668	中铝矿业国际	589	15,971.43
中银国际亚洲有限公司	03668	中铝矿业国际	709	18,140.73
中银国际亚洲有限公司	03668	中铝矿业国际	8,204	201,851.06
中银国际亚洲有限公司	03668	中铝矿业国际	884	21,575.03
中银国际证券股份有限公司	003816	中国广核	1,505	5,484.53
中银国际证券股份有限公司	003816	中国广核	458	1,676.97
中银国际证券股份有限公司	003816	中国广核	596	2,139.63
中银国际证券股份有限公司	003816	中国广核	596	2,211.15
中银国际证券股份有限公司	003816	中国广核	596	2,187.31
中银国际证券股份有限公司	003816	中国广核	596	2,193.27
中银国际证券股份有限公司	003816	中国广核	6,926	25,142.53
中银国际证券股份有限公司	003816	中国广核	818	2,970.05

中银国际证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	1,060	126,921.87
中银国际证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	1,702	205,107.29
中银国际证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	1,761	211,198.86
中银国际证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	1,769	213,982.78
中银国际证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	1,927	238,852.07
中银国际证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	141	17,179.26
中银国际证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	2,175	257,270.75
中银国际证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	2,339	292,185.52
中银国际证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	2,968	360,642.44
中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	58,424	6,012,411.96
中银国际证 券股份有限 公司	2028018	20 交通银行二 级	7,303	751,551.49
中银国际证 券股份有限 公司	2028023	20 招商银行永 续债 01	37,460	3,868,870.72
中银国际证 券股份有限 公司	232580016	25 农行二级资 本债 01A(BC)	114,724	11,479,029.75
中银国际证 券股份有限 公司	240982	24 中化 06	38,145	4,102,550.24

中银国际证 券股份有限 公司	242580017	25 农行永续债 01BC	283,345	28,334,470.00
中银国际证 券股份有限 公司	242721	25 西股 K1	43,119	4,311,900.80
中银国际证 券股份有限 公司	258117	25 漳龙 01	29,459	2,945,917.50
中银国际证 券股份有限 公司	600015	华夏银行	1,004	7,848.57
中银国际证 券股份有限 公司	600015	华夏银行	207	1,608.79
中银国际证 券股份有限 公司	600015	华夏银行	556	4,317.46
中银国际证 券股份有限 公司	600015	华夏银行	723	5,452.50
中银国际证 券股份有限 公司	600015	华夏银行	723	5,394.25
中银国际证 券股份有限 公司	600015	华夏银行	731	5,512.42
中银国际证 券股份有限 公司	600015	华夏银行	731	5,497.80
中银国际证 券股份有限 公司	600015	华夏银行	8,449	60,842.53
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	109	3,332.79
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	143	4,362.38
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	3,095	84,009.82

中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	366	11,145.47
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	501	15,176.56
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	501	15,424.34
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	676	20,313.96
中银国际证 券股份有限 公司	600900	长江电力	977	29,425.83
中银国际证 券股份有限 公司	601018	宁波港	1,451	5,266.89
中银国际证 券股份有限 公司	601018	宁波港	480	1,756.83
中银国际证 券股份有限 公司	601018	宁波港	628	2,284.50
中银国际证 券股份有限 公司	601018	宁波港	628	2,310.25
中银国际证 券股份有限 公司	601018	宁波港	636	2,441.21
中银国际证 券股份有限 公司	601018	宁波港	636	2,333.13
中银国际证 券股份有限 公司	601018	宁波港	7,368	26,526.32
中银国际证 券股份有限 公司	601018	宁波港	873	3,307.69
中银国际证 券股份有限 公司	601019	山东出版	120	1,194.24

中银国际证 券股份有限 公司	601019	山东出版	246	2,646.15
中银国际证 券股份有限 公司	601019	山东出版	76	744.45
中银国际证 券股份有限 公司	601019	山东出版	79	867.14
中银国际证 券股份有限 公司	601019	山东出版	87	858.08
中银国际证 券股份有限 公司	601019	山东出版	87	968.85
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	1,523	54,712.98
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	127	5,103.33
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	127	5,021.16
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	127	5,064.39
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	127	5,023.39
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	185	7,197.62
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	185	7,339.44
中银国际证 券股份有限 公司	601088	中国神华	98	3,837.01
中银国际证 券股份有限 公司	601098	中南传媒	373	5,215.46

中银国际证 券股份有限 公司	601098	中南传媒	382	5,179.73
中银国际证 券股份有限 公司	601098	中南传媒	4,323	55,137.40
中银国际证 券股份有限 公司	601098	中南传媒	469	6,793.66
中银国际证 券股份有限 公司	601098	中南传媒	477	6,674.22
中银国际证 券股份有限 公司	601098	中南传媒	633	8,612.77
中银国际证 券股份有限 公司	601098	中南传媒	660	9,280.24
中银国际证 券股份有限 公司	601098	中南传媒	95	1,366.50
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	229	5,385.37
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	294	6,675.09
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	294	6,719.83
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	294	6,686.46
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	3,439	73,234.74
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	302	6,829.34
中银国际证 券股份有限 公司	601166	兴业银行	404	9,621.55

中银国际证 券股份有限 公司	601169	北京银行	1,033	6,394.66
中银国际证 券股份有限 公司	601169	北京银行	1,033	6,508.29
中银国际证 券股份有限 公司	601169	北京银行	1,041	6,527.13
中银国际证 券股份有限 公司	601169	北京银行	1,041	6,493.12
中银国际证 券股份有限 公司	601169	北京银行	1,418	9,204.16
中银国际证 券股份有限 公司	601169	北京银行	12,084	70,692.63
中银国际证 券股份有限 公司	601169	北京银行	807	5,218.24
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	535	3,047.40
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	691	3,980.79
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	699	4,041.98
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	699	3,986.03
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	699	4,007.01
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	8,105	43,525.26
中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	960	5,443.30

中银国际证 券股份有限 公司	601668	中国建筑	960	5,482.90
中银国际证 券股份有限 公司	601991	大唐发电	1,462	4,709.65
中银国际证 券股份有限 公司	601991	大唐发电	404	1,336.06
中银国际证 券股份有限 公司	601991	大唐发电	501	1,642.09
中银国际证 券股份有限 公司	601991	大唐发电	509	1,703.76
中银国际证 券股份有限 公司	601991	大唐发电	524	1,720.29
中银国际证 券股份有限 公司	601991	大唐发电	709	2,290.40
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	1,735	13,662.78
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	133	966.20
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	22	158.63
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	3,131	23,388.30
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	47	335.12
中银国际证 券股份有限 公司	603993	洛阳钼业	721	5,241.40

中银国际证券股份有限公司，光大证券股份有限公司，招商证券股份有限公司	2028033	20 建设银行二级	14,439	1,492,774.86
中银国际证券股份有限公司，光大证券股份有限公司，招商证券股份有限公司	2028033	20 建设银行二级	21,909	2,261,485.73
中银国际证券股份有限公司，光大证券股份有限公司，招商证券股份有限公司	2028033	20 建设银行二级	28,432	2,930,264.94
中银国际证券股份有限公司，光大证券股份有限公司，招商证券股份有限公司	2028033	20 建设银行二级	36,515	3,768,938.39
中银国际证券股份有限公司，招商证券股份有限公司	232380089	23 中信银行二级资本债 01A	10,599	1,107,096.01
中银国际证券股份有限公司，招商证券股份有限公司	242580007	25 兴业银行永续债 01BC	20,246	2,024,602.00
中银国际证券股份有限公司，招商证券股份有限公司	242580007	25 兴业银行永续债 01BC	64,521	6,452,464.95

中银国际证 券股份有限 公司，招商 证券股份有 限公司	2522006	25 瑞福德汽车 债 01	18,692	1,869,215.40
中银国际证 券股份有限 公司，招商 证券股份有 限公司	603993	洛阳钼业	2,265	16,931.10
中银国际证 券股份有限 公司，招商 证券股份有 限公司	603993	洛阳钼业	2,281	16,372.53
中银国际证 券股份有限 公司，招商 证券股份有 限公司	603993	洛阳钼业	2,312	17,093.61
中银国际证 券股份有限 公司，招商 证券股份有 限公司	603993	洛阳钼业	407	3,015.06
中银国际证 券股份有限 公司，招商 证券股份有 限公司	603993	洛阳钼业	5,256	41,176.21
中银国际证 券股份有限 公司，招商 证券股份有 限公司	603993	洛阳钼业	5,841	42,634.41

本产品于 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日期间投资于关联方发行的资产管理产品

关联方名称	资产管理 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	ZYLCZYZ Q202119	中银证券中国 红-汇中 19 号 集合资产管理 计划	10,413,051	12,000,000.00
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	127,953,596	150,000,000.00
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	169,782,199	198,000,000.00
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	17,132,088	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	17,260,723	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	222,583,683	260,000,000.00
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	25,940,337	30,000,000.00
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	5,183,138	6,000,000.00
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	8,520,791	10,000,000.00
中银国际证 券股份有限 公司	ZYLCZYZ Q202122	中银证券中国 红-汇中 22 号 集合资产管理 计划	114,648,491	105,344,359.65
中银基金管 理有限公司	508090	中银中外运仓 储物流 REIT	47,374	155,245.52

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	2,023,882	2,000,000.00
中银香港资产管理有限公司	968155	中银香港全天候亚洲债券基金-C4（人民币累积）	5,850,060	5,850,060.00

本产品于 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日期间的其他关联交易

交易类型	关联方名称	总金额（单位：元）
1 日质押式正回购	光大兴陇信托有限责任公司	11,474,849.88
1 日质押式正回购	中国光大银行股份有限公司	3,647,777.60
1 日质押式正回购	光大理财有限责任公司	1,435,898.05
1 日质押式逆回购	招商证券股份有限公司	14,892,190.50
3 日质押式逆回购	光大证券股份有限公司	22,326,044.16
4 日质押式逆回购	光大理财有限责任公司	11,165,868.00
6 日质押式正回购	光大理财有限责任公司	31,233,848.50
7 日质押式正回购	大成基金管理有限公司	31,378,813.59
7 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	24,552,718.86
7 日质押式正回购	光大理财有限责任公司	7,967,421.60
分销买入	中国银行股份有限公司	160,535,419.27
分销买入	中银国际证券股份有限公司	33,304,989.50
分销买入	招商证券股份有限公司	11,660,494.60
分销买入	东方证券股份有限公司	6,081,489.35
分销买入	光大证券股份有限公司	1,277,074.50
同业借款资产服务费	中国银行股份有限公司	259,592.49
现券买入	中国银行股份有限公司	24,323,739.28
现券买入	东方证券股份有限公司	12,898,905.73
现券买入	光大证券股份有限公司	4,777,481.56
现券卖出	东方证券股份有限公司	22,182,904.15
非标资产服务费	中国银行股份有限公司	2,224,951.07

八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市，国内经济总需求面临一定压力，债券市场收益率或将处于震荡下行区间。当前债券的绝对收益率水平较低，市场面对波动时脆弱性增加。债券投资方面以稳健为主，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；择机适当增加权益和可转债的配置和交易。

Bank 中国光大银行

中银理财“福”固收增强（封闭式）养老理财产品 2022 年 01 期 （2025 年半年度）托管报告

本报告期内，本托管人中国光大银行股份有限公司在本理财产品托管过程中，严格遵守了《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》、《商业银行理财子公司管理办法》等相关法律法规、托管协议的规定，依法安全保管了本理财产品的全部资产，对本理财产品的投资运作进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，没有从事任何损害份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为托管人所应尽的义务。

托管人复核了本理财产品报告中的年化收益率（不含业绩比较基准，年化收益率按照投资管理人提供的公式计算）、财务指标、投资组合概况（不含产品报告期末资产规模占产品总资产比例大小排序的前十名资产明细）和产品份额变动的财务数据部分。经复核，本理财产品报告中披露的理财产品财务数据核对一致。

2025 年半年度披露的重大事项：中国光大银行股份有限公司资产托管部总经理变更说明，根据工作安排，贾光华任中国光大银行股份有限公司资产托管部总经理。

中国光大银行股份有限公司北京分行



托管业务专用章

2025年08月06日

关于《中银理财“福”固收增强（封闭式）养老理财产品 2022 年 01 期 2025 年 半年度 报告》

复核意见

根据相关法律法规及管理人提供的编制规则，托管人对管理人编制的本理财产品报告进行了复核。

托管人复核了本理财产品报告中的年化收益率（不含业绩比较基准，年化收益率按照投资管理人提供的公式计算）、财务指标、投资组合概况（不含产品报告期末资产规模占产品总资产比例大小排序的前十名资产明细）和产品份额变动的财务数据部分。经复核，本理财产品报告中披露的理财产品财务数据核对一致。

特此说明。

中国光大银行股份有限公司北京分行



2025年08月06日

DTGLEJI7713M