

中银理财“福”固收增强（封闭式）养老理财产品 2022 年
003 期
2024 年三季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 7 月 1 日至 2024 年 9 月 30 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	1.073928	1.075428	209,198,385.81	0.57%
YLFFB22003B	1,235,496,206.82	1.073920	1.075420	1,326,824,693.44	0.57%

(二) 截至报告期末，理财产品杠杆水平：107.34%

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	141.67	0.09%	1,959.31	1.20%
同业存单	-	0.00%	1,823.79	1.12%
拆放同业及买入 返售	-	0.00%	144.53	0.09%
债券	-	0.00%	96,078.46	58.77%
非标准化债权类 资产	17,637.01	11.49%	56,937.01	34.83%
权益类投资	-	0.00%	3,134.79	1.92%
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%	3,390.59	2.07%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	135,702.61	88.42%	-	0.00%
合计	153,481.29	100%	163,468.47	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	YLFFB22003-20240321-1: 河南航空 空港投资集团有限公司(112778122)	13,000.00	7.95%
2	YLFFB22003-20240429-1: 云瀚信 息科技有限公司(63264385)	10,000.00	6.12%
3	YLFFB22003-20240426-01: 抖音月 付非标理财项目	8,995.89	5.50%
4	HTJZ-SD-2024-010: 山东汇通金融 租赁有限公司	5,393.82	3.30%
5	YLFFB22003-20240613-01: 抖音月 付非标理财项目	5,200.00	3.18%
6	185981: 22 鲁资 06	4,973.99	3.04%
7	194746: 22 常城 07	4,959.38	3.03%
8	YLFFB22003-20240814-1: 中国平 煤神马控股集团有限公司(34507)	4,000.00	2.45%

9	YLFFB22003-20240528-1: 云瀚信息科技有限公司(63264385)	4,000.00	2.45%
10	YLFFB22003-20240528-2: 中国平煤神马控股集团有限公司(34507)	3,100.00	1.90%

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，产品管理人结合产品规模变化合理进行资产配置，控制产品久期、杠杆比例，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 7 月 1 日至 2024 年 9 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
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	172	4.61	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	239	3.15	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	262	2.95	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	621	3.00	其他债权类 资产	正常
深圳智领星 辰科技有限 公司	深圳智领星辰科技有限 公司资产支持计划非标 理财项目	196	2.80	资产支持计 划	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	211	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	240	2.85	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	318	3.60	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	240	4.03	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	255	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 7 月 1 日至 2024 年 9 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）
-	-	-	-	-

本产品于 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 9 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）
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	102102149	21 沪基建 MTN002	1,828	189,682.60
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	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	1920066	19 上海银行二级	16,493	1,710,424.20
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
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	012482260	24 冀建投 SCP002	746	74,563.00
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	082400590	24 惠丰 ABN003 优先 A1	521	52,115.20
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	102000920	20 闽交运 MTN001	5,506	560,217.02
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	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	102480276	24 中海企业 MTN001A	5,477	561,680.84
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	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	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	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	2023005	20 平安人寿	5,502	562,558.20
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	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	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	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	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	2405282	24 山东债 16	1,382	145,222.20
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	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	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	759,877.18
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	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	759,683.92
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	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, 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	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	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	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	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	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	299,823.81

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	299,526.10
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	299,674.95
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	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	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	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	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，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	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	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	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	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，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	137883	22 华租 Y2	7,552	784,057.59
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	5,477	568,794.52
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	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	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	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	37,758	3,806,885.00
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	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	2,663	78,458.77
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	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	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	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	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 7 月 1 日至 2024 年 9 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）
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	48,342	77,615.57
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	8,686,588	7,500,000.00
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	8,223,684	7,000,000.00

本产品于 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 9 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）
14 日质押式正回购	招商基金管理有限公司	290,657.70
1 日质押式正回购	招商银行股份有限公司	36,154,018.51
1 日质押式正回购	大家资产管理有限责任公司	1,170,858.40
1 日质押式正回购	招商基金管理有限公司	465,895.71
3 日质押式正回购	招商银行股份有限公司	10,330,767.05
3 日质押式正回购	招商基金管理有限公司	464,992.02
4 日质押式正回购	招商银行股份有限公司	12,401,309.75
7 日质押式正回购	招商银行股份有限公司	35,605,587.35
7 日质押式正回购	招商基金管理有限公司	30,058,925.54
7 日质押式正回购	中银基金管理有限公司	1,092,557.88
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	8,253,636.36
分销买入	中银国际证券股份有限公司	1,437,947.60
同业借款资产服务费	中国银行股份有限公司	29,325.00
现券买入	招商银行股份有限公司	565,608.11
现券买入	中国银行股份有限公司	56,458.34

非标资产服务费	中国银行股份有限公司	357,936.50
---------	------------	------------

八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市，9月中央政治局会议强调进一步加大财政货币政策的逆周期调节力度。货币政策方面，降准降息落地，存量房贷利率下调，提振市场预期。财政政策方面，保证必要的财政支出，更好发挥政府投资带动作用。受此影响全市场风险偏好明显提振，权益市场情绪有所好转，债券市场短期内面临一定调整压力。债券投资方面以稳健为主，配置时兼顾收益性和流动性两个方面，后续将继续择机配置性价比较高的固定收益资产，保持产品的合理杠杆水平，控制产品久期风险。权益方面，股票市场反弹，转债估值明显修复，投资价值有所提升，后续将继续关注权益资产的配置机会。