**5.3、产品投资前十项资产明细**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 资产名称 | 规模 | 规模占比（%） |
| 1 | 19中交建MTN004 | 1263459.29 | 1.22% |
| 2 | 20汇鑫ABN001优先 | 1168344.04 | 1.13% |
| 3 | 19铁建Y5 | 1083129.59 | 1.04% |
| 4 | 22川发展ABN001优先 | 1074391.00 | 1.03% |
| 5 | 22平安银行CD030 | 1038471.00 | 1.00% |
| 6 | 19平安银行二级 | 912887.06 | 0.88% |
| 7 | 21光穗华电ABN001优先 | 899660.50 | 0.87% |
| 8 | 21飞驰建瓴ABN001优先 | 898190.50 | 0.87% |
| 9 | 21山东高速ABN001优先 | 894406.60 | 0.86% |
| 10 | 22招商蛇口ABN001优先 | 894267.10 | 0.86% |

注：本表列示穿透后投资规模占比较高的前十项资产，不含现金及活期存款、7日内到期的定期存款。总资产包含应计利息、证券清算款和其他应收款项。其中，定期存款类资产（如有）规模合并计算，衍生品类资产（如有）规模以保证金合并计算。因末位数字四舍五入，可能存在尾差。

7.1关联交易

关联交易报告期末持有中国工商银行承销的17民生银行二级01(证券代码：1728016.IB）,持仓数量为119778.7,期末公允价格为104.18，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的17民生银行二级02(证券代码：1728023.IB）,持仓数量为208310.8,期末公允价格为103.61，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的19光穗节能ABN001优先(证券代码：081900685.IB）,持仓数量为263449.1,期末公允价格为100.98，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的19交通银行二级01(证券代码：1928019.IB）,持仓数量为364543.9,期末公允价格为106.22，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的19京城投资ABN001优(证券代码：081900537.IB）,持仓数量为15820.91,期末公允价格为99.66，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的19平安银行二级(证券代码：1928010.IB）,持仓数量为877730.9,期末公允价格为104.01，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的19中交建MTN004(证券代码：101901706.IB）,持仓数量为1228823,期末公允价格为102.82，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的20川交投MTN002(证券代码：102002298.IB）,持仓数量为52663.86,期末公允价格为105.23，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的20光穗节能ABN001优先(证券代码：082000525.IB）,持仓数量为265112.2,期末公允价格为100.48，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的20光穗节能ABN001优先(证券代码：082000525.IB）,持仓数量为110885.3,期末公允价格为100.48，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的20光穗节能ABN002优先(证券代码：082000934.IB）,持仓数量为352975.3,期末公允价格为101.6，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的20光穗节能ABN003优先(证券代码：082001055.IB）,持仓数量为439352.4,期末公允价格为101.9，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的20光穗南电ABN001优先(证券代码：082001001.IB）,持仓数量为704366.3,期末公允价格为101.66，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的20民生银行二级(证券代码：2028022.IB）,持仓数量为104155.4,期末公允价格为100.29，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的20平安租赁PPN002(证券代码：032000152.IB）,持仓数量为175546.2,期末公允价格为101.69，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的20首钢MTN005(证券代码：102001475.IB）,持仓数量为52077.7,期末公允价格为105.47，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的20中电国际MTN001(证券代码：102002087.IB）,持仓数量为145817.6,期末公允价格为104.91，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的20中国银行二级01(证券代码：2028038.IB）,持仓数量为17554.62,期末公允价格为106.56，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的20中建七局(疫情防控债)MTN001(证券代码：102000508.IB）,持仓数量为177064.2,期末公允价格为101.74，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的20中建七局(疫情防控债)MTN001(证券代码：102000508.IB）,持仓数量为298428.5,期末公允价格为101.74，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的20中建三局MTN001(证券代码：102002190.IB）,持仓数量为491529.3,期末公允价格为105.29，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的20中建三局MTN001(证券代码：102002190.IB）,持仓数量为135402,期末公允价格为105.29，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的20中交四航MTN001(证券代码：102000682.IB）,持仓数量为52077.7,期末公允价格为101.26，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的20中铁建投MTN001(证券代码：102002257.IB）,持仓数量为156233.1,期末公允价格为103.41，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21大唐集MTN006(证券代码：102102138.IB）,持仓数量为351092.4,期末公允价格为103.6，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21德宝天元之信3优先\_bc(证券代码：2189418.IB）,持仓数量为52100.24,期末公允价格为100.66，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21峨乐旅集MTN001(证券代码：102101742.IB）,持仓数量为333537.8,期末公允价格为105.07，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21港兴港投MTN001(证券代码：102100746.IB）,持仓数量为351092.4,期末公允价格为102.7，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21光穗华电ABN001优先(证券代码：082100277.IB）,持仓数量为885177.9,期末公允价格为101.64，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21光穗华电ABN002优先(证券代码：082100802.IB）,持仓数量为444144.4,期末公允价格为100.77，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21华侨城MTN005(证券代码：102102167.IB）,持仓数量为386201.6,期末公允价格为103.96，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21金地MTN005(证券代码：102101091.IB）,持仓数量为263319.3,期末公允价格为98.14，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21静安置业MTN002(证券代码：102102201.IB）,持仓数量为105327.7,期末公允价格为103.3，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21聚盈京能ABN001优先(证券代码：082101014.IB）,持仓数量为353599.4,期末公允价格为101.12，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21人才安居MTN002(证券代码：102102212.IB）,持仓数量为87773.09,期末公允价格为102.78，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21山东高速ABN001优先(证券代码：082100574.IB）,持仓数量为878607.5,期末公允价格为101.8，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21水电五局MTN001(证券代码：102100857.IB）,持仓数量为403756.2,期末公允价格为102.12，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21铁四院MTN001(证券代码：102100236.IB）,持仓数量为210655.4,期末公允价格为103.8，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21希望六和MTN001（乡村振兴）(证券代码：102100490.IB）,持仓数量为438865.5,期末公允价格为97.4，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21希望六和MTN001（乡村振兴）(证券代码：102100490.IB）,持仓数量为130194.2,期末公允价格为97.4，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21中电国际GN001（碳中和债）(证券代码：132100129.IB）,持仓数量为105327.7,期末公允价格为103.49，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21中建三局MTN001(证券代码：102103213.IB）,持仓数量为46869.93,期末公允价格为102.6，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21中交二航MTN001(证券代码：102100960.IB）,持仓数量为509083.9,期末公允价格为102.71，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的21中交二航MTN002(证券代码：102101200.IB）,持仓数量为193100.8,期末公允价格为102.04，标的资产类别为债券;报告期末持有中国工商银行承销的22德邦股份MTN001(乡村振兴)(证券代码：102280159.IB）,持仓数量为52663.86,期末公允价格为101.53，标的资产类别为债券;报告期末持有工银瑞信基金管理有限公司承销的城发01优(证券代码：183273.SH）,持仓数量为368681.3,期末公允价格为99.97，标的资产类别为债券;报告期末持有工银瑞信基金管理有限公司发行的工银金融地产混合A(证券代码：000251.OF）,持仓数量为63070.35,期末公允价格为2.639，标的资产类别为基金;报告期末持有工银瑞信基金管理有限公司发行的工银前沿医疗股票A(证券代码：001717.OF）,持仓数量为113346.5,期末公允价格为3.697，标的资产类别为基金;报告期末持有工银瑞信基金管理有限公司发行的工银新生利混合(证券代码：002000.OF）,持仓数量为49616.4,期末公允价格为1.415，标的资产类别为基金;本产品报告期内全部关联交易均按照公允价格开展。