

中银理财-稳汇固收增强 QDII（美元封闭式）2021 年 06 期  
2021 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：中国银行股份有限公司

报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

## 一、理财产品基本情况

理财产品代码	A类份额：WHZQQD202106A B类份额：WHZQQD202106B C类份额：WHZQQD202106C
理财产品名称	中银理财-稳汇固收增强 QDII（美元封闭式）2021年06期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001021000094
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
风险级别	02 二级(中低)
理财产品成立日	2021-06-03
理财产品到期日	2023-06-05

## 二、存续规模和收益表现

截至报告期末，理财产品存续规模及收益表现如下：

理财产品总份额	A类份额：13,053,610.00 B类份额：4,984,106.00 C类份额：7,209,434.00
理财产品份额净值	A类份额：1.011924 B类份额：1.011924 C类份额：1.011924
理财产品累计净值	A类份额：1.011924 B类份额：1.011924 C类份额：1.011924
理财产品资产净值	A类份额：13,209,263.19 B类份额：5,043,537.24 C类份额：7,295,400.38

较上一报告期末份额净值增长率	A类份额：1.19% B类份额：1.19% C类份额：1.19%
----------------	--

### 三、理财产品持仓情况

资产类别	穿透前金额 (万元人民币)	占全部产品总资产 的比例	穿透后金额 (万元人民币)	占全部产品总资产 的比例
现金及银行存款	281.90	1.74%	281.90	1.74%
同业存单	-	0.00%	-	0.00%
拆放同业及买入返售	-	0.00%	-	0.00%
债券	-	0.00%	-	0.00%
非标准化债权类资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	-	0.00%
境外投资资产	15,907.35	98.26%	15,907.35	98.26%
商品类资产	-	0.00%	-	0.00%
另类资产	-	0.00%	-	0.00%
公募基金	-	0.00%	-	0.00%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	-	0.00%	-	0.00%
合计	16,189.25	100%	16,189.25	100%

### 四、产品持仓前十项资产

序号	资产名称	持仓(万元人民币)	持仓比例
1	XS2383421711: ICBCAS 3.2 PERP	1,562.83	9.65%
2	XS2397254579: CCAMCL 4.4 PERP	1,466.87	9.06%

3	XS2211674143: YWSOAO 3.15 08/11/23	1,416.07	8.75%
4	XS2051351893: ZZREAL_3_95_10_09_22	1,392.75	8.60%
5	XS1900551166: POWINV 5.8 PERP	1,297.97	8.02%
6	XS2008741295: XANCON_4_20220624	1,289.97	7.97%
7	XS1547355427: TAIKAN 3.5 01/19/22	1,276.80	7.89%
8	XS2355084430: JNHITE 2.5 06/23/24	1,267.46	7.83%
9	XS2214315371: YZHINV 3.02 08/24/23	1,099.05	6.79%
10	XS2242183205: JXCCMZ 2.6 10/29/23	959.62	5.93%

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	中银理财有限责任公司（稳汇固增Q D I I 美元封闭式2 1 0 6）
账号	349371301175
开户行	中国银行北京中银大厦支行营业部

## 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，管控产品流动性风险。产品流动性风险整体可控。

## 七、本运作期主要操作回顾

### （一）主要投资策略及操作

自产品成立以来，中资美元债市场和香港权益市场持续大幅波动，中资美元债信用事件频发，港股市场屡见年内新低。在报告期内，产品管理人投资于投资级中资美元债市场，通

过动态调整持仓债券久期的方式一定程度上控制产品利率风险,同时通过精选持仓债券的方式一定程度上控制产品信用风险,目前产品持仓运营良好。

(二) 非标资产投资情况

无。

(三) 关联交易情况

本产品于 2021 年 1 月 1 日至 2021 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)
-	-	-	-	-

本产品于 2021 年 1 月 1 日至 2021 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)
中国银行股份有限公司	XS1891659358	ANHUI_4_875_20211018_CORP	2,000	2,043,662.50
中国银行股份有限公司	XS2356402011	CQNANA 4.207/07/24	2,000	2,000,000.00
中国银行股份有限公司	XS2347623626	HENINV 2.208/25/24 Corp	700	701,800.00
中国银行股份有限公司	XS2244843210	HUANEN 3.08 PERP	1,690	1,736,831.78
中银国际证券股份有限公司	XS2383421711	ICBCAS 3.2 PERP	1,000	1,000,000.00
中国银行股份有限公司	XS2320544419	ICBCIL 1.7508/02/26	2,000	1,994,860.00
中国银行股份有限公司	XS2364454293	IDINOS 2.308/10/22	800	800,000.00
中国银行股份有限公司	XS2355084430	JNHITE 2.506/23/24	2,000	2,000,000.00
中国银行股份有限公司	XS2242183205	JXCCMZ 2.610/29/23	2,000	2,008,311.11

中国银行股份有限公司	XS1547355 427	TAIKAN 3.5 01/19/22	2,000	2,059,555.56
中国银行股份有限公司	XS2352437 334	WHREST 2.25 07/09/24	2,000	2,000,000.00
中国银行股份有限公司	XS2008741 295	XANCON_4_2 0220624	1,000	1,022,755.56
中国银行股份有限公司	XS2211674 143	YWSOAO 3.15 08/11/23	2,200	2,253,625.00
中国银行股份有限公司	XS2379456 895	ZHHFGR 2.95 02/28/25 Corp	1,000	1,002,750.00
中国银行股份有限公司	XS2051351 893	ZZREAL_3_95 _10_09_22	2,155	2,222,403.61

本产品于 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）
关联方报酬-销售服务费	中国银行股份有限公司	21,079.00
关联方报酬-产品托管费	中国银行股份有限公司	10,325.95

## 八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市，由于美国加息预期逐步升温，后续利率进入上升区间的可能性逐渐加大。未来，管理人会继续发挥该产品全球配置的优势，密切关注海外市场变化，合理控制产品久期，在把握整体风险可控的前提下，进一步优化资产配置。