

中银理财-稳汇固收增强 QDII（美元年年开）001 期  
2022 年一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：中国银行股份有限公司

报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 3 月 31 日

### 一、理财产品基本情况

理财产品代码	A类份额：WHZQNNKQD001A B类份额：WHZQNNKQD001B
理财产品名称	中银理财-稳汇固收增强 QDII（美元年年开）001 期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001021000112
产品类型	固定收益类产品
募集方式	公募
产品运作模式	开放式净值型产品
风险级别	02 二级(中低)
理财产品成立日	2021-04-07
理财产品到期日	无固定期限

### 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：5,078,733.00 B类份额：1,398,577.00
理财产品份额净值	A类份额：1.001443 B类份额：1.001443
理财产品累计净值	A类份额：1.001443 B类份额：1.001443
理财产品资产净值	A类份额：5,086,064.46 B类份额：1,400,595.92
较上一报告期份额净值增长率	A类份额：-0.54% B类份额：-0.54%

### 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	1,616.16	39.52%	1,616.16	39.52%
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	2,473.38	60.48%	2,473.38	60.48%
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	4,089.54	100%	4,089.54	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	TRADE_4757253: 5日存放同业定期	1,333.12	32.60%
2	XS2325182512: CHMETL 2.95 PERP	376.14	9.20%
3	XS2069318686: JXWCIG 3.4 12/05/22	319.42	7.81%
4	XS2051351893: ZZREAL_3_95_10_09_22	319.10	7.80%
5	XS1900551166: POWINV 5.8 PERP	318.90	7.80%
6	XS1721386834: CHSCOI 3.375 11/29/22	317.88	7.77%
7	XS2064431468: CITICS 2.75 10/24/22	317.02	7.75%
8	XS2242183205: JXCCMZ 2.6 10/29/23	314.31	7.69%
9	USD: 现金及银行存款	282.33	6.90%

10	XS1629465797: CHPWCN 3.5 PERP	190.61	4.66%
----	-------------------------------	--------	-------

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 美元年年开 0 0 1）
账号	346771254223
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

今年一季度以来，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，同时美债利率持续攀升。在报告期内，产品管理人通过调整持仓，快速降低了持仓债券的久期，一定程度的控制了利率风险。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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 3 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 3 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）
-	-	-	-	-

本产品于 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 3 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	3,208.60
关联方报酬-产品托管费	中国银行股份有限公司	1,123.01
5 日存放同业定期	中国银行股份有限公司	2,100,000.00

#### 八、后市展望及下阶段投资策略

展望后市，在美国加息 25bp 后，市场对于美联储继续加息和缩表的预期继续升温，后续利率上行的压力较大。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。