

中银理财-稳汇固收增强 QDII（美元年年开）003 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：WHZQNNKQD003A B类份额：WHZQNNKQD003B
理财产品名称	中银理财-稳汇固收增强 QDII（美元年年开）003期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001021000114
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	2021-05-07
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：19,436,151.00 B类份额：6,170,787.00
理财产品份额净值	A类份额：1.004172 B类份额：1.004172
理财产品累计净值	A类份额：1.004172 B类份额：1.004172
理财产品资产净值	A类份额：19,517,249.84 B类份额：6,196,535.09
较上一报告期份额净值增长率	A类份额：-0.23% B类份额：-0.23%

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	4,335.81	26.73%	4,335.81	26.73%
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	11,881.92	73.27%	11,881.92	73.27%
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	16,217.72	100%	16,217.72	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_4742873: 37日存放同业定期	3,174.10	19.57%
2	US09681MAH16: BOCAVI Float 09/26/23	1,531.38	9.44%
3	XS1900551166: POWINV 5.8 PERP	1,403.17	8.65%
4	XS1629465797: CHPWCN 3.5 PERP	1,397.81	8.62%
5	XS2051351893: ZZREAL_3_95_10_09_22	1,276.39	7.87%
6	XS2008741295: XANCON_4_20220624	1,274.00	7.86%
7	XS1644429695: HAOHUA 3.5 07/19/22	1,272.43	7.85%
8	XS2364454293: IDINOS 2.3 08/10/22	1,266.90	7.81%
9	XS2242183205: JXCCMZ 2.6	1,257.23	7.75%

	10/29/23		
10	USD: 现金及银行存款	1,159.70	7.15%

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 3）
账号	324671324222
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	12,697.59
关联方报酬-产品托管费	中国银行股份有限公司	4,444.16
37 日存放同业定期	中国银行股份有限公司	5,000,000.00

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。