

中银理财-稳富固收增强（6个月滚续）
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：WFZQ6M001A B 类份额：WFZQ6M001B
理财产品名称	中银理财-稳富固收增强（6 个月滚续）
全国银行业理财信息登记系统登记编码	Z7001020000336
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	2021-03-02
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：33,091,646,915.39 B 类份额：977.78
理财产品份额净值	A 类份额：1.045924 B 类份额：1.04681
理财产品累计净值	A 类份额：1.045924 B 类份额：1.04681
理财产品资产净值	A 类份额：34,611,375,290.23 B 类份额：1,023.55
较上一报告期份额净值增长率	A 类份额：0.61% B 类份额：0.64%

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	20,652.17	0.60%	333,844.95	9.18%
同业存单	-	0.00%	10,984.73	0.30%
拆放同业及买入返售	-	0.00%	3,329.39	0.09%
债券	-	0.00%	3,108,729.0 2	85.51%
非标准化债权类资产	-	0.00%	-	0.00%
权益类投资	-	0.00%	157,582.35	4.33%
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	7,268.66	0.21%	21,006.99	0.58%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	3,434,886.2 0	99.19%	-	0.00%
合计	3,462,807.0 3	100%	3,635,477.4 2	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	210216: 21 国开 16	123,379.65	3.39%
2	092280003: 22 中国信达债 01	80,221.47	2.21%
3	CNY: 现金及银行存款	61,970.39	1.70%
4	1928013: 19 民生银行永续债	55,457.76	1.53%
5	160207: 16 国开 07	51,144.70	1.41%
6	1928002: 19 民生银行二级 01	50,765.74	1.40%
7	188286: 21 兖煤 Y2	39,741.00	1.09%
8	TD20220331: 存放同业	39,727.99	1.09%
9	133052: 21 桂铁 02	35,598.50	0.98%
10	DQ001579: 存放同业	33,232.29	0.91%

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（稳富固收增强6个月滚续）
账号	770574556209
开户行	中国银行深圳市分行营业部

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，控制资产久期和杠杆融资比例，管控流动性风险。产品融资渠道畅通多元，风险总体可控。

七、本运作期主要操作回顾

（一）主要投资策略及操作

产品管理人保持合理的组合杠杆水平，持仓主要为高等级信用债，久期处于中等水平，并根据市场变化灵活调整持仓结构，等待时机增加权益仓位。

（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）
中国银行股份有限公司	1789364	17中盈3A2	16,148,385	436,975,372.39

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）
中国银行股份有限公司	102280089	22TCL 集 MTN001	200,000	20,005,671.23
中国银行股份有限公司	082200107	22 上汽租赁 ABN001 优先 A2	100,000	10,000,767.12
中银国际证券股份有限公司	185527	22 东风 01	100,000	10,000,000.00
中国银行股份有限公司	102280270	22 中化股 MTN001A	200,000	20,001,506.85
中国银行股份有限公司	092280003	22 中国信达债 01	7,999,700	800,064,900.54
中国银行股份有限公司	032280236	22 中安金融 PPN001	49,995	5,000,047.90
中国银行股份有限公司	2228011	22 农业银行永 续债 01	1,091,700	109,173,479.47
中国银行股份有限公司	082280208	22 前海河钢 ABN001 优先	1,154,473	115,486,311.59
中国银行股份有限公司	102280368	22 北部湾 MTN002	699,930	70,016,011.40
中国银行股份有限公司	032280267	22 宁乡城发 PPN001	199,980	20,000,629.88
中国银行股份有限公司	102200106	22 宝马金融 MTN001BC(品 种二)	200,000	20,001,698.63
中国银行股份有限公司	032280046	22 嵊州城投 PPN001	300,000	30,000,000.00
中国银行股份有限公司	102280665	22 常德经建 MTN001	99,990	10,001,355.92
中国银行股份有限公司	102280666	22 建发地产 MTN003A	105,590	10,561,140.29
中国银行股份有限公司	102280285	22 张江高科 MTN001	100,000	10,002,400.00
中国银行股份有限公司	032280121	22 惠安交发 PPN001	300,000	30,000,000.00
中国银行股份有限公司	082280238	22 招商蛇口 ABN001 优先	99,990	9,999,000.00
中国银行股份有限公司	032280151	22 昆交投 PPN001	414,720	41,478,452.33

中国银行股份有限公司	102280521	22 晋能煤业 MTN003	28,000	2,800,329.86
中国银行股份有限公司	032280134	22 泉州金控 PPN001	1,000,000	100,009,589.00
中国银行股份有限公司	032280230	22 洛阳城投 PPN002	28,000	2,800,275.40
中国银行股份有限公司	102280276	22 港兴港投 MTN002	10,000	1,000,136.99
中银国际证券股份有限公司	194253	22 滨海 D3	108,540	10,854,000.00
中国银行股份有限公司	102280213	22 潞安 MTN002	1,000,000	100,010,000.00
中国银行股份有限公司	102280351	22 物产中大 MTN001	545,850	54,589,785.53
中国银行股份有限公司	102200088	22 绿城地产 MTN001	200,000	20,001,983.56
中国银行股份有限公司	102280376	22 美的置业 MTN001	99,990	10,000,232.76
中国银行股份有限公司	082280271	22 聚盈建发 ABN002 优先	499,950	50,005,875.63
中国银行股份有限公司	102280011	22 荣盛 MTN001	700,000	70,008,054.79
中国银行股份有限公司	102280162	22 荣盛 MTN002	500,000	50,017,671.23
中国银行股份有限公司	102280557	22 萧山交投 MTN001	99,990	10,004,456.99
中国银行股份有限公司	2289003	22 融腾 1B_bc	500,000	50,004,794.52
中国银行股份有限公司	102280618	22 赣水投 MTN001	49,995	5,002,195.63
中国银行股份有限公司	2228017	22 邮储银行二 级 01	300,000	30,002,909.59
中国银行股份有限公司	102280275	22 鞍钢集 MTN001	100,000	10,000,863.01
中国银行股份有限公司	102280436	22 顺鑫 MTN001	99,990	9,999,000.00
中国银行股份有限公司	082280280	22 鲁黄金 ABN001 优先	299,970	30,003,903.41

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	20,065,970.09
关联方报酬-产品托管费	中国银行股份有限公司	1,337,731.35

八、后市展望及下阶段投资策略

稳就业和稳增长是 2022 年我国经济工作的重点，短期内仍能维持低利率环境。产品管理人下阶段将继续采取稳健的投资策略，继续配置高等级信用债，配合适当久期，优化资产配置。