

中银理财-稳汇固收增强 QDII（美元年年开）001 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：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：1.006876 B类份额：1.006876
理财产品累计净值	A类份额：1.006876 B类份额：1.006876
理财产品资产净值	A类份额：5,113,654.58 B类份额：1,408,193.68
较上一报告期份额净值增长率	A类份额：0.69% B类份额：0.69%

### 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	593.15	14.34%	593.15	14.34%
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	3,543.66	85.66%	3,543.66	85.66%
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	4,136.81	100%	4,136.81	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	USD: 现金及银行存款	592.96	14.33%
2	XS2325182512: CHMETL 2.95 PERP	391.41	9.46%
3	XS2397254579: CCAMCL 4.4 PERP	382.86	9.25%
4	XS1900551166: POWINV 5.8 PERP	324.92	7.85%
5	XS2051351893: ZZREAL_3_95_10_09_22	323.71	7.83%
6	XS2069318686: JXWCIG 3.4 12/05/22	323.23	7.81%
7	XS1721386834: CHSCOI 3.375 11/29/22	323.10	7.81%
8	XS2064431468: CITICS 2.75 10/24/22	321.91	7.78%
9	XS1917106061: JIAPRO 4.85 02/21/22	320.70	7.75%

10	XS2242183205: JXCCMZ 2.6 10/29/23	319.67	7.73%
----	--------------------------------------	--------	-------

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

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	ANHUII_4_875_20211018_CORP	600	612,855.00
中国银行(香港)有限公司	XS1721386834	CHSCOI 3.375 11/29/22	500	521,450.00
中国银行股份有限公司	XS1852561031	CHUANT_4_625_20210926_COR	500	509,162.64
中国银行股份有限公司	XS2064431468	CITICS 2.75 10/24/22	500	512,934.03
中国银行股份有限公司	XS1867560028	CJIANT_4_5_20210920	500	508,832.50
中银国际控股有限公司	XS1917106061	JIAPRO 4.85 02/21/22	500	518,066.67
中国银行股份有限公司	XS2242183205	JXCCMZ 2.6 10/29/23	500	501,969.44
中国银行股份有限公司	XS1547355427	TAIKAN 3.5 01/19/22	500	513,381.94
中国银行股份有限公司	XS2051351893	ZZREAL_3_95_10_09_22	500	516,905.56

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	6,273.07
关联方报酬-产品托管费	中国银行股份有限公司	2,195.58

## 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。