

(六一儿童节专属)中银策略-稳富（封闭式）2019年007期  
2020年度运作情况报告

理财产品管理人：中国银行股份有限公司

理财产品托管人：中国银行股份有限公司

报告期：2020年1月1日至2020年12月31日

### 一、理财产品基本情况

理财产品代码	AMZYCLWF2019007
理财产品名称	(六一儿童节专属)中银策略-稳富(封闭式)2019年007期
全国银行业理财信息登记系统登记编码	C1010419002223
产品类型	固定收益类产品
募集方式	公募
产品运作模式	封闭式净值类产品
风险级别	02 二级(中低)
理财产品成立日	2019-06-14
理财产品到期日	2022-06-15

### 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	162,335,000.00
理财产品份额净值	1.0674
理财产品累计净值	1.0674
理财产品资产净值	173,278,156.26
较上一报告月份净值增长率	3.73%

### 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	297.52	1.54%	297.52	1.54%
同业存单	-	0.00%	-	0.00%
拆放同业及买入返售	-	0.00%	-	0.00%
债券	18,983.63	98.46%	18,983.63	98.46%

理财直接融资工具	-	0.00%	-	0.00%
新增可投资资产	-	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%
金融衍生品	-	0.00%	-	0.00%
代客境外理财投资 QDII	-	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	-	0.00%	-	0.00%
私募基金	-	0.00%	-	0.00%
资产管理产品	-	0.00%	-	0.00%
委外投资——协议方式	-	0.00%	-	0.00%
合计	19,281.15	100%	19,281.15	100%

注：如果金融衍生品持仓为负，表示为空头持仓

#### 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	031900530：19 余杭创新 PPN002	1,617.64	8.39%
2	031900332：19 南浦口 PPN001	1,614.12	8.37%
3	031900292：19 南京浦口 PPN003	1,520.36	7.89%
4	031800712：18 晋江建投 PPN002	1,514.77	7.86%
5	101900575：19 九江城投 MTN002	1,513.37	7.85%
6	031900186：19 尧矿 PPN001	1,510.69	7.84%
7	031900067：19 中建投租 PPN001	1,505.94	7.81%
8	031900064：19 河钢集 PPN001	1,498.54	7.77%
9	031900171：19 冀中能源 PPN001	1,476.30	7.66%
10	031800682：18 常城建 PPN005	1,213.63	6.29%

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	中国银行银行理财产品托管专户（中银策略-稳富 2019007 期）
账号	433877443911
开户行	中国银行上海市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，保持一定比例的流动性资产，控制资产久期、杠杆融资比例，管控产品流动性风险。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

本报告期内，组合维持合理杠杆水平，持仓主要为高等级信用债，根据市场变化灵活调整持仓结构及组合久期。同时抓住转债市场配置和利率债波段交易机会，增厚收益。

### （二） 非标资产投资情况

无

### （三） 关联交易情况

本产品于 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）
-	-	-	-	-

## 八、后市展望及下阶段投资策略

考虑到全球经济复苏、通胀压力、大宗商品价格的上涨，债券市场或有一定承压，需要密切关注后续经济数据和政治、经济及其他重要事件。

产品配置上以信用债和票息收益策略为主，控制组合久期合理水平，组合会继续维持适度杠杆进行套息，同时利用国债期货等衍生品对冲可能的利率上行风险。