

所有产品细节以产品说明书为准

QDII结构性票据(SN)最新表现 (截至2019年12月30日)
 现提供存续期SN产品之最新表现, 以帮助大维护现有SN客户、提供更周到的服务。

#	产品名称	认购币种	期限(年)	提前终止条款	到期日	最新表现	挂钩标的	彭博代码	初始价格	最新价格	表现	份额净值*	资产净值*
1	代客境外理财产品美元结构性票据 - 2019年第26期	美元	5	是	12/13/2024	正处于第1季度观察期。	开云集团 耐克公司 沃尔沃集团	KER FP Equity NKE UN Equity VOLVB SS Equity	546.4 97.01 143.4	586.3 100.8 156.9	107% 104% 109%	98.2991%	16,429,711.57
2	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2019年第25期	人民币	3	否	12/1/2022	挂钩标的观测水平较初始水平小幅上涨。	富时100指数	UKX Index	7,429.78	7587.05	102%	97.2000%	73,842,840.00
3	代客境外理财产品美元结构性票据 - 2019年第24期	美元	5	是	11/20/2024	正处于第1季度观察期。	日本电话电 软银集团 沃达丰	9432 JT Equity 9984 JT Equity VOD LN Equity	2731.5 4260 154.6	2757 4756 148.62	101% 112% 96%	97.2700%	13,520,530.00
4	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2019年第23期	人民币	1.5	否	5/5/2021	未发生触发事件	标普500指数	SPX Index	3036.89	3221.29	106%	96.5200%	16,167,100.00
5	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2019年第22期	人民币	5	是	10/30/2024	正处于第1季度观察期。	LVMH集团公 耐克公司 沃尔沃集团	MC FP Equity NKE UN Equity VOLVB SS Equity	383.95 90.92 145.85	414.6 100.8 156.9	108% 111% 108%	99.1310%	43,885,293.70
6	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2019年第21期	人民币	5	是	10/30/2024	正处于第1季度观察期。	LVMH集团公 耐克公司 沃尔沃集团	MC FP Equity NKE UN Equity VOLVB SS Equity	383.95 90.92 145.85	414.6 100.8 156.9	108% 111% 108%	99.6217%	14,724,087.26
7	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2019年第20期	人民币	3	是	10/20/2022	正处于第1季度观察期。	诺华 默沙东 赛诺菲	NOVN SE Equity MRK UN Equity SAN FP Equity	86.14 83.8 83.72	91.9 91.03 89.75	107% 109% 107%	100.4500%	98,882,980.00
8	代客境外理财产品美元结构性票据 - 2019年第19期	美元	5	是	10/8/2024	正处于第2季度观察期。	日本电话电 软银集团 沃达丰	9432 JT Equity 9984 JT Equity VOD LN Equity	2693.5 4441 162.86	2757 4756 148.62	102% locked 91%	96.1749%	14,198,300.49
9	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2019年第18期	人民币	5	是	9/25/2024	正处于第2季度观察期。	通用磨坊 雀巢 沃尔玛	GIS UN Equity NESN SE Equity WMT UN Equity	54.33 106.26 116.98	52.74 104.78 119.4	97% 99% 102%	95.0731%	143,379,742.11
10	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2019年第17期	人民币	5	是	9/20/2024	正处于第2季度观察期。	通用磨坊 雀巢 沃尔玛	GIS UN Equity NESN SE Equity WMT UN Equity	54.09 109.98 116.92	52.74 104.78 119.4	98% 95% 102%	95.2045%	59,483,771.60
11	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2019年第15期	人民币	3	是	8/18/2022	正处于第2季度观察期。	诺华 阿斯利康 赛诺菲	NOVN SE Equity AZN LN Equity SAN FP Equity	88.63 7342 75.4	91.9 7654 89.75	104% 104% locked	99.3600%	38,651,040.00
12	代客境外理财产品美元结构性票据 - 2019年第14期	美元	5	是	8/16/2024	正处于第2季度观察期。	通用磨坊 雀巢 菲利普莫里斯国际集团	GIS UN Equity NESN SE Equity PM UN Equity	54.38 106.28 83.95	52.74 104.78 85.7	97% 99% 102%	96.5292%	25,856,311.51
13	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2019年第13期	人民币	3	是	8/2/2024	正处于第2季度观察期。	腾讯控股 沃达丰 日本电话电	700 HK Equity VOD LN Equity 9432 JT Equity	373.2 151.24 2498	383.2 148.62 2757	103% 98% locked	98.7243%	40,704,028.89
14	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2019年第12期	人民币	5	是	7/26/2024	正处于第2季度观察期。	通用磨坊 雀巢 菲利普莫里斯国际集团	GIS UN Equity NESN SE Equity PM UN Equity	52.39 103.1 86.75	52.74 104.78 85.7	101% 102% 99%	97.4451%	162,538,426.80
15	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2019年第11期	人民币	3	是	7/4/2022	正处于第3季度观察期, 2个挂钩标的锁定。	诺华 阿斯利康 赛诺菲	NOVN SE Equity AZN LN Equity SAN FP Equity	89.2 6438 75.91	91.9 7654 89.75	103% locked locked	100.1600%	48,878,080.00
16	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2019年第10期	人民币	3	是	6/23/2022	正处于第3季度观察期。	诺华 阿斯利康 赛诺菲	NOVN SE Equity AZN LN Equity SAN FP Equity	91.43 6410 77.47	91.9 7654 89.75	101% locked locked	97.0800%	163,473,012.00
17	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2019年第9期	人民币	5	是	5/24/2024	正处于第3季度观察期。	通用磨坊 雀巢 沃尔玛	GIS UN Equity NESN SE Equity WMT UN Equity	52.39 99.07 101.12	52.74 104.78 119.4	101% locked locked	99.3300%	203,606,634.00
18	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2019年第8期	人民币	5	是	4/22/2024	正处于第3季度观察期。	阿里巴巴 西门子 ABB集团	BABA UN Equity SIE GY Equity ABBN SE Equity	187.55 105.84 21.2	212.91 116.54 23.37	114% 110% 110%	103.3975%	194,397,639.75
19	代客境外理财产品美元结构性票据 - 2019年第7期	美元	2.25	否	7/2/2021	挂钩标的观测水平较初始水平小幅上涨。	PIMCO收益基金-欧元对冲(累积型)	PINEEHA ID Equity	12.99	13.3	102%	100.8600%	6,396,541.20
20	代客境外理财产品美元结构性票据 - 2019年第6期	美元	2.25	否	6/30/2021	挂钩标的观测水平较初始水平小幅上涨。	PIMCO收益基金-欧元对冲(累积型)	PINEEHA ID Equity	13	13.3	102%	100.8000%	5,019,840.00
21	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2019年第5期	人民币	5	是	3/19/2024	正处于第4季度观察期。	默克集团 阿斯利康 赛诺菲	MRK GY Equity AZN LN Equity SAN FP Equity	100.4 6309 78.35	105.35 7654 85.06	105% locked locked	103.9481%	196,877,701.40
22	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2019年第4期	人民币	3	是	3/3/2022	正处于第4季度观察期。	三星电子 中国移动 台积电	005930 KP Equity 941 HK Equity TSM UN Equity	45100 82.6 39.05	55800 65.8 46.48	locked 80% locked	95.3092%	34,444,744.88
23	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2018年第25期	人民币	2.5	是	6/2/2021	挂钩标的观测水平较初始水平上上涨。	标普500指数	SPX Index	2,743.79	3221.29	117%	99.5047%	49,553,340.60
24	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2018年第21期	人民币	2.75	是	6/3/2021	正处于第6季度观察期。	港交所 星展集团 汇丰控股	388 HK Equity DBS SP Equity 5 HK Equity	229.8 25.33 70.15	256.2 25.83 60.4	locked 102% 86%	97.1883%	52,199,835.93
25	代客境外理财产品美元结构性票据 - 2018年第20期	美元	2.75	是	5/26/2021	正处于第6季度观察期。	腾讯控股 软银集团(00) 百度	700 HK Equity 9984 JT Equity BIDU UW Equity	350.6 4910.5 223.13	383.2 4756 102.76	109% locked 46%	97.4089%	5,906,875.70
26	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2018年第19期	人民币	2.75	是	5/13/2021	正处于第6季度观察期。	阿里巴巴 京东 中国平安	BABA UN Equity JD UW Equity 2318 HK Equity	177.52 36 71	212.91 35.4 90.05	locked 98% locked	105.4858%	44,493,910.44
27	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2018年第18期	人民币	3	是	7/29/2021	正处于第6季度观察期, 累计获得季度票息率5.3250%。	腾讯控股 软银集团(00)	700 HK Equity 9984 JT Equity	374.8 4627	383.2 4756	102% locked	98.0494%	43,445,689.14
28	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2018年第16期	人民币	3	是	7/16/2021	正处于第6季度观察期。	百度 京东 网易	BIDU UW Equity JD UW Equity NTES UN Equity	267.19 38.27 266.11	126.29 35.4 266.18	47% 93% locked	93.3400%	54,473,224.00
29	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2018年第15期	人民币	3	是	7/5/2021	正处于第7季度观察期。	中国银行 渣打集团 港交所	3988 HK Equity 2888 HK Equity 388 HK Equity	3.89 72.9 236	3.36 73.1 230	85% 100% locked	96.6218%	74,601,691.78
30	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2018年第14期	人民币	3	是	6/24/2021	正处于第7季度观察期。	中国银行 渣打集团 港交所	3988 HK Equity 2888 HK Equity 388 HK Equity	3.96 73.3 247.8	3.36 73.1 230	85% 100% locked	99.2756%	91,770,364.64
31	代客境外理财产品美元结构性票据 - 2018年第13期	美元	5	是	6/13/2023	正处于第7季度观察期。	阿里巴巴 腾讯控股 亚马逊	BABA UN Equity 700 HK Equity AMZN UN Equity	205.07 415 1683.99	212.91 383.2 1735.91	104% 92% locked	104.4215%	15,095,172.04
32	代客境外理财产品人民币结构性票据 - 2018年第12期	人民币	3	是	5/28/2021	正处于第7季度观察期。	阿里巴巴 腾讯控股 PayPal	BABA UN Equity 700 HK Equity PYPL UN Equity	199.2 404 80.96	212.91 383.2 103.59	107% 95% locked	104.2100%	69,581,017.00

#	产品名称	认购币种	期限(年)	提前终止条款	到期日	最新表现	挂钩标的	彭博代码	初始价格	最新价格	表现	份额净值*	资产净值*
33	代客境外理财产品人民币结构性票据-2018年第11期	人民币	3	是	5/21/2021	正处于第7个季度观察期。	阿里巴巴 腾讯控股 中国平安	BABA UN Equity 700 HK Equity 2318 HK Equity	196.61 398 78.9	212.91 383.2 90.05	108% 96% locked	105.4005%	190,216,282.35
34	代客境外理财产品美元结构性票据-2018年第10期	美元	4	是	4/28/2022	正处于第7个季度观察期。	网易 腾讯控股 新浪	NTES UW Equity 700 HK Equity SINA UW Equity	254.1 396.6 92.83	303.59 383.2 39.19	locked 97% 42%	96.0330%	7,243,769.19
35	代客境外理财产品美元结构性票据-2018年第9期	美元	4	是	4/19/2022	正处于第7个季度观察期。	大众 沃尔沃 ⁽⁶⁾ 米其林	VOW3 GY Equity VOLVB SS Equity ML FP Equity	177.28 149.7396 119.6	176.24 156.9 102.4	99% 105% 86%	99.0500%	10,424,022.00
36	代客境外理财产品美元结构性票据-2018年第8期	美元	5	是	4/3/2023	正处于第8个季度观察期。	大众 沃尔沃 ⁽⁶⁾ 米其林	VOW3 GY VOLVB SS ML FP	161.38 147.0829 119.9	176.24 locked 102.4	locked locked 85%	99.9900%	6,225,377.40
37	代客境外理财产品澳元结构性票据-2018年第7期	澳元	5	是	3/28/2023	正处于第8个季度观察期, 已有1个挂钩标的锁定。	大众 沃尔沃 ⁽⁶⁾ 米其林	VOW3 GY VOLVB SS ML FP	153.68 143.1221 119.1	176.24 locked 102.4	locked locked 86%	101.4500%	4,966,992.00
38	代客境外理财产品美元结构性票据-2018年第4期	美元	5	是	2/16/2023	正处于第8个季度观察期, 累计获得季度票息率1.30%, 软银已成为锁定股票。	腾讯控股 ⁽¹⁰⁾ 软银集团 ⁽¹⁰⁾	700 HK Equity 9984 JT Equity	422.4 4496	383.2 locked	91% locked	95.4500%	4,988,217.00
39	代客境外理财产品美元结构性票据-2018年第3期	美元	5	是	2/3/2023	正处于第8个季度观察期, 已有2个挂钩标的锁定。	软银集团 ⁽¹⁰⁾ 中国联通 Verizon	9984 JT Equity 762 HK Equity VZ UN Equity	4490 11.72 54.07	4756 7.32 locked	locked 62% locked	93.9010%	2,856,468.42
40	代客境外理财产品美元结构性票据-2018年第2期	美元/人民币	3	否	1/28/2020	挂钩标的观测水平较初始水平小幅上升。	PIMCO收益基金—欧元对冲(累积型)	PINEEHA ID Equity	13.09	13.3	102%	101.1100%	1,777,828.72
41	代客境外理财产品澳元结构性票据-2017年第26期	澳元	5	是	11/28/2022	正处于第9个季度观察期, 自动提前终止事件未发生。	腾讯控股 中国联通	700 HK Equity 762 HK Equity	430 11.72	383.2 7.32	locked 62%	93.1400%	4,609,498.60
42	代客境外理财产品美元结构性票据-2017年第25期	美元/人民币	5	是	11/28/2022	正处于第9个季度观察期, 自动提前终止事件未发生。	腾讯控股 中国联通	700 HK Equity 762 HK Equity	430 11.72	383.2 7.32	locked 62%	91.7000%	8,591,515.52
43	代客境外理财产品美元结构性票据-2017年第24期	美元/人民币	3	否	11/9/2020	锁定事件未发生, 挂钩标的观测水平较初始水平小幅上涨。	联博短期高收益基金—欧元对冲(累积型)	ABSA2EH LX Equity	18.39	18.79	102%	101.0800%	2,898,793.62
44	代客境外理财产品美元结构性票据-2017年第19期	美元/人民币	5	是	9/8/2022	正处于第10个季度观察期。	百威英博 达能集团 家乐福	ABI BB Equity BN FP Equity CA FP Equity	99.52 66.15 16.94	73.73 locked locked	74% locked locked	97.0931%	8,813,610.57
45	代客境外理财产品美元结构性票据-2017年第18期	美元/人民币	3	否	8/31/2020	挂钩标的观测水平较初始水平小幅上涨。	PIMCO收益基金—欧元对冲(累积型)	PINEEHA ID Equity	13.06	13.3	102%	99.0200%	3,975,386.34
46	代客境外理财产品美元结构性票据-2017年第16期	美元	3	否	8/4/2020	挂钩标的观测水平较初始水平上涨。	木星动力债券基金(累积型)	JUJPLEUR LX Equity	11.72	12.05	103%	99.9600%	2,262,094.80
47	代客境外理财产品美元结构性票据-2017年第15期	美元/人民币	3	否	8/4/2020	挂钩标的观测水平较初始水平上涨。	木星动力债券基金(累积型)	JUJPLEUR LX Equity	11.72	12.05	103%	100.4400%	5,176,872.60
48	代客境外理财产品美元结构性票据-2017年第14期	美元/人民币	5	是	7/25/2022	正处于第10个季度观察期, 已有2个挂钩标的成为锁定股票。	法国兴业 汇丰控股 中国平安	GLE FP Equity 5 HK Equity 2318 HK Equity	48.75 75.35 58.5	30.975 locked locked	64% locked locked	95.0424%	10,716,286.79
49	代客境外理财产品澳元结构性票据-2017年第13期	澳元	2.5	否	1/20/2020	挂钩标的观测水平较初始水平上涨。	木星动力债券基金(累积型)	JUJPLEUR LX Equity	11.74	12.05	103%	102.4400%	2,411,437.60
50	代客境外理财产品美元结构性票据-2017年第12期	美元/人民币	3	否	7/6/2020	挂钩标的观测水平较初始水平上涨。	木星动力债券基金(累积型)	JUJPLEUR LX Equity	11.78	12.05	102%	100.1400%	4,979,380.62
51	代客境外理财产品美元结构性票据-2017年第11期	美元/人民币	5	是	6/23/2022	现处于第11个季度观测期。累计票息率为3.75%。未发生自动提前终止事件。	中国人寿 太平洋保险 中国人保财险 ⁽⁷⁾	2628 HK Equity 2601 HK Equity 2328 HK Equity	24 29.75 8.4933	21.6 locked locked	90% locked locked	95.0992%	4,639,910.56
52	代客境外理财产品美元结构性票据-2017年第10期	美元/人民币	3	否	6/12/2020	挂钩标的观测水平较初始水平上涨。	联博短期高收益基金—欧元对冲(累积型)	ABSA2EH LX Equity	18.36	18.79	102%	100.6600%	10,528,930.98
53	代客境外理财产品美元结构性票据-2017年第8期	美元/人民币	3	否	5/19/2020	挂钩标的观测水平较初始水平上涨。	PIMCO收益基金—欧元对冲(累积型)	PINEEHA ID Equity	12.91	13.3	103%	101.1600%	6,065,422.03
54	代客境外理财产品美元结构性票据-2017年第4期	美元/人民币	3	否	3/24/2020	挂钩标的观测水平较初始水平小幅上涨。	安联美国短期高收益债券基金—欧元对冲(累积型)	AUSSDAM LX Equity	105.39	107.85	102%	101.4300%	10,335,351.47
55	代客境外理财产品美元结构性票据-2017年第3期	美元/人民币	3	否	3/6/2020	挂钩标的观测水平较初始水平上涨。	联博短期高收益基金—欧元对冲(累积型)	ABSA2EH LX Equity	18.25	18.79	103%	102.4400%	15,702,221.27
56	代客境外理财产品美元结构性票据-2017年第1期	美元	3	否	1/27/2020	挂钩标的观测水平较初始水平上涨。	联博短期高收益基金—欧元对冲(累积型)	ABSA2EH LX Equity	18.22	18.79	103%	103.3200%	19,868,436.00
57	代客境外理财产品澳元结构性票据-2016年第14期	澳元	5	是	11/9/2021	正处于第13个季度观察期, 已有2个挂钩标的成为锁定股票。	中国工商银行 中国移动 ⁽⁹⁾ 腾讯控股	1398 HK Equity 941 HK Equity 700 HK Equity	4.65 84.51 204.4	5.97 65.8 locked	locked 78% locked	98.0776%	5,575,711.56
58	代客境外理财产品澳元结构性票据-2015年第8期	澳元	5	是	7/28/2020	正处于第18个季度观察期, 已有1个挂钩标的成为锁定股票。	中信证券 海通证券 深交所	6030 HK Equity 6837 HK Equity 388 HK Equity	23.8 15.66 228.4	18.06 9.3 locked	76% 59% locked	97.4400%	3,763,132.80
59	代客境外理财产品澳元结构性票据-2015年第6期	澳元	5	是	5/26/2020	自动提前终止事件尚未发生。	中国平安 ⁽⁸⁾ 中国太保 恒生银行 ⁽⁸⁾ 中银香港 ⁽⁸⁾	2318 HK Equity 2601 HK Equity 11 HK Equity 2388 HK Equity	55.75 41.65 153.4325 29.9356	92.6 31.3 locked locked	locked 75% locked locked	98.0600%	7,293,702.80
60	代客境外理财产品澳元结构性票据-2015年第5期	澳元	5	是	5/4/2020	自动提前终止事件尚未发生。	达能 雷诺汽车有限公司 荷兰国际集团 必和必拓 ⁽¹¹⁾ +South 32 ⁽²⁾	BN FP Equity RNO FP Equity INGA NA Equity BHP LN Equity + S32 LN Equity	66.98 97.08 13.97 1564	74 42.6 locked locked	locked 44% locked locked	97.6700%	11,122,659.60

注释:

* 所披露净值仅为产品在存续期间的市场参考价值, 且以票据币种计价。对于产品本金部分, 在产品到期或自动提前终止(如有)时, 境外票据发行人将按照产品说明书之相关约定返还相应本金, 例如客户持有至到期或自动提前终止(如有)时, 将收到境外票据发行人100%的本金返还。本产品为封闭式产品, 全部投资于境外票据。银行原则上不鼓励客户提前终止票据, 客户提前终止票据可能会因为净值波动导致本金损失。

- 2018年11月23日, 必和必拓(BHP GROUP PLC)彭博代码由BLT LN变更为BHP LN。
- 2015年5月18日, 必和必拓拆分成BLT LN和S32 LN两个独立上市公司, 挂钩标的调整为BLT LN和S32 LN股票篮子。
- 2015年7月27日, 中国平安对其股票2318 HK Equity发放股票股利(bonus), 初始水平=期初评价日由其交易所公布的正式收盘水平*0.5。
- 2016年3月7日, 恒生银行对其股票11 HK Equity发放特别分红(special dividend), 初始水平=期初评价日由其交易所公布的正式收盘水平*0.9779。
- 2016年9月19日, 中银香港对其股票2388 HK Equity发放特别分红(special dividend), 初始水平=期初评价日由其交易所公布的正式收盘水平*0.9751。
- 2017年8月31日, 中国移动对其股票941 HK Equity发放特别分红(special dividend), 初始水平=期初评价日由其交易所公布的正式收盘水平*0.9631。
- 2018年6月27日, 中国人寿通过资本公积金转增股本, 初始水平=期初评价日由其交易所公布的正式收盘水平/1.5。
- 2019年4月3日, 沃尔沃(彭博股票代码: VOLVB SS Equity) 决定对其股东增发现金股利(extrodiary dividend), 初始水平=期初评价日由其交易所公布的正式收盘水平*0.9660618。
- 2019年4月9日, 诺华(彭博股票代码: NOVN SE Equity) 完成对爱乐康的分拆, 诺华股东/美国存托凭证(ADR)持有人以每5股诺华股票/ADR获得1股爱乐康股票比例, 获得分拆股利, 初始水平=期初评价日由其交易所公布的正式收盘水平*0.883991。
- 2019年6月25日, 软银集团(股票代码: 9984 JT Equity) 对普通股按1:2比例进行分拆, 初始水平=期初评价日由其交易所公布的正式收盘水平*0.5。
- 2019年12月13日, 网易公司美股存托凭证(NTES UW Equity)将在普通分红基础上发放特别现金分红, 2019年12月5日为除息日, 初始水平=期初评价日由其交易所公布的正式收盘水平x 0.989018
- 2019年12月27日, 日本电话电话(9432 JT Equity)将1股拆分为2股, 初始水平=期初评价日由其交易所公布的正式收盘水平x 0.5