

第 2106 期个人结构性存款产品挂钩标的表现

产品信息：

产品名称：挂钩三个月美元 LIBOR 结构性存款

产品代码：21IR06001R

产品期号：2106

产品起息日：2021/6/23

产品到期日：2022/1/6

产品期限：197 天

挂钩标的：三个月美元 LIBOR 利率

观察区间上限：3.00%

观察区间下限：-0.30%

产品挂钩标的在观察期内每日表现：

日期	3M Libor (%)
2021/6/23	0.1473
2021/6/24	0.1460
2021/6/25	0.1460
2021/6/28	0.1473
2021/6/29	0.1449
2021/6/30	0.1458
2021/7/1	0.1448
2021/7/2	0.1379
2021/7/5	0.1380
2021/7/6	0.1349
2021/7/7	0.1239
2021/7/8	0.1190
2021/7/9	0.1286
2021/7/12	0.1329
2021/7/13	0.1261
2021/7/14	0.1264
2021/7/15	0.1339
2021/7/16	0.1343
2021/7/19	0.1343
2021/7/20	0.1383
2021/7/21	0.1379
2021/7/22	0.1253
2021/7/23	0.1289
2021/7/26	0.1316
2021/7/27	0.1296
2021/7/28	0.1285

日期	3M Libor (%)
2021/7/30	0.1178
2021/8/2	0.1238
2021/8/3	0.1214
2021/8/4	0.1218
2021/8/5	0.1254
2021/8/6	0.1284
2021/8/9	0.1273
2021/8/10	0.1228
2021/8/11	0.1213
2021/8/12	0.1248
2021/8/13	0.1243
2021/8/16	0.1245
2021/8/17	0.1273
2021/8/18	0.1309
2021/8/19	0.1308
2021/8/20	0.1284
2021/8/23	0.1293
2021/8/24	0.1218
2021/8/25	0.1238
2021/8/26	0.1208
2021/8/27	0.1199
2021/8/31	0.1196
2021/9/1	0.1189
2021/9/2	0.1176
2021/9/3	0.1155
2021/9/6	0.1146
2021/9/7	0.1160
2021/9/8	0.1158
2021/9/9	0.1141
2021/9/10	0.1158
2021/9/13	0.1160
2021/9/14	0.1180
2021/9/15	0.1200
2021/9/16	0.1220
2021/9/17	0.1239
2021/9/20	0.1254
2021/9/21	0.1284
2021/9/22	0.1293

日期	3M Libor (%)
2021/9/23	0.1323
2021/9/24	0.1323
2021/9/27	0.1318
2021/9/28	0.1315
2021/9/29	0.1309
2021/9/30	0.1301
2021/10/1	0.1331
2021/10/4	0.1266
2021/10/5	0.1240
2021/10/6	0.1240
2021/10/7	0.1236
2021/10/8	0.1211
2021/10/11	0.1218
2021/10/12	0.1268
2021/10/13	0.1238
2021/10/14	0.1223
2021/10/15	0.1236
2021/10/18	0.1315
2021/10/19	0.1295
2021/10/20	0.1283
2021/10/21	0.1239
2021/10/22	0.1249
2021/10/25	0.1345
2021/10/26	0.1359
2021/10/27	0.1286
2021/10/28	0.1316

*以上 3M Libor 数据来源于路透系统 Libor01 页面上显示的 3 个月美元拆借利率。
数据期间：自 2021 年 6 月 23 日至 2021 年 10 月 28 日。

广零 2020001

第 2109 期个人结构性存款产品挂钩标的表现

产品信息：

产品名称：挂钩 USD/JPY 汇率型结构性存款

产品代码：21FX07001R

产品期号：2109

产品起息日：2021/7/16

产品到期日：2021/10/25

产品期限：101 天

挂钩标的：USD/JPY 即期汇率中间价

基准日：2021/7/16

初始价格：109.985

观察区间上限：初始价格+【3.30】

观察区间下限：初始价格-【3.30】

产品挂钩标的在观察期内每日表现：

日期	USD/JPY
2021/7/16	109.9850
2021/7/19	109.9450
2021/7/20	109.4850
2021/7/21	109.8950
2021/7/22	110.1650
2021/7/23	110.2750
2021/7/26	110.3150
2021/7/27	110.2050
2021/7/28	109.8350
2021/7/29	109.7350
2021/7/30	109.5450
2021/8/2	109.6650
2021/8/3	109.1950
2021/8/4	109.0550
2021/8/5	109.6650
2021/8/6	109.8150
2021/8/9	110.1850
2021/8/10	110.3550
2021/8/11	110.6800
2021/8/12	110.3950
2021/8/13	110.4050
2021/8/16	109.4150
2021/8/17	109.3350
2021/8/18	109.6250
2021/8/19	110.1350

日期	USD/JPY
2021/8/20	109.6950
2021/8/23	109.9350
2021/8/24	109.8250
2021/8/25	109.7100
2021/8/26	109.9950
2021/8/27	109.9850
2021/8/30	109.7550
2021/8/31	109.8150
2021/9/1	110.2250
2021/9/2	109.9800
2021/9/3	110.0150
2021/9/6	109.7850
2021/9/7	109.8200
2021/9/8	110.4050
2021/9/9	110.1350
2021/9/10	109.8950
2021/9/13	110.0300
2021/9/14	110.0750
2021/9/15	109.5850
2021/9/16	109.2350
2021/9/17	109.8850
2021/9/20	109.9050
2021/9/21	109.5150
2021/9/22	109.5250
2021/9/23	109.8350
2021/9/24	110.4850
2021/9/27	110.6350
2021/9/28	111.2150
2021/9/29	111.4750
2021/9/30	111.8450
2021/10/1	111.2050
2021/10/4	111.0650
2021/10/5	111.1900
2021/10/6	111.7650
2021/10/7	111.4750
2021/10/8	111.9150
2021/10/11	112.7350
2021/10/12	113.2950
2021/10/13	113.4750

日期	USD/JPY
2021/10/14	113.5250
2021/10/15	114.1500
2021/10/18	114.3150
2021/10/19	114.1150
2021/10/20	114.5650
2021/10/21	114.0250

*以上 USD/JPY 数据来源于每个观察日的东京时间下午 3 点在彭博“BFIX”页面中“即期”一栏下显示的每一美元兑日元的汇率中间价。

数据期间：自 2021 年 7 月 16 日至 2021 年 10 月 21 日（最终收益计算日）。

广零 2020001

第 2110 期个人结构性存款产品挂钩标的表现

产品信息：

产品名称：挂钩三个月美元 LIBOR 结构性存款

产品代码：211R07002R

产品期号：2110

产品起息日：2021/8/10

产品到期日：2022/2/18

产品期限：192 天

挂钩标的：三个月美元 LIBOR 利率

观察区间上限：3.00%

观察区间下限：-0.30%

产品挂钩标的在观察期内每日表现：

日期	3M Libor (%)
2021/8/10	0.1228
2021/8/11	0.1213
2021/8/12	0.1248
2021/8/13	0.1243
2021/8/16	0.1245
2021/8/17	0.1273
2021/8/18	0.1309
2021/8/19	0.1308
2021/8/20	0.1284
2021/8/23	0.1293
2021/8/24	0.1218
2021/8/25	0.1238
2021/8/26	0.1208
2021/8/27	0.1199
2021/8/31	0.1196
2021/9/1	0.1189
2021/9/2	0.1176
2021/9/3	0.1155
2021/9/6	0.1146
2021/9/7	0.1160
2021/9/8	0.1158
2021/9/9	0.1141
2021/9/10	0.1158
2021/9/13	0.1160
2021/9/14	0.1180
2021/9/15	0.1200

日期	3M Libor (%)
2021/9/16	0.1220
2021/9/17	0.1239
2021/9/20	0.1254
2021/9/21	0.1284
2021/9/22	0.1293
2021/9/23	0.1323
2021/9/24	0.1323
2021/9/27	0.1318
2021/9/28	0.1315
2021/9/29	0.1309
2021/9/30	0.1301
2021/10/1	0.1331
2021/10/4	0.1266
2021/10/5	0.1240
2021/10/6	0.1240
2021/10/7	0.1236
2021/10/8	0.1211
2021/10/11	0.1218
2021/10/12	0.1268
2021/10/13	0.1238
2021/10/14	0.1223
2021/10/15	0.1236
2021/10/18	0.1315
2021/10/19	0.1295
2021/10/20	0.1283
2021/10/21	0.1239
2021/10/22	0.1249
2021/10/25	0.1345
2021/10/26	0.1359
2021/10/27	0.1286
2021/10/28	0.1316

*以上 3M Libor 数据来源于路透系统 Libor01 页面上显示的 3 个月美元拆借利率。
数据期间：自 2021 年 8 月 10 日至 2021 年 10 月 28 日。

广零 2020001

第 2111 期个人结构性存款产品挂钩标的表现

产品信息：

产品名称：挂钩 USD/JPY 汇率型结构性存款

产品代码：21FX08001R

产品期号：2111

产品起息日：2021/9/2

产品到期日：2021/11/12

产品期限：71 天

挂钩标的：USD/JPY 即期汇率中间价

基准日：2021/9/2

初始价格：109.98

观察区间上限：初始价格+【3.30】

观察区间下限：初始价格-【3.30】

产品挂钩标的在观察期内每日表现：

日期	USD/JPY
2021/9/2	109.9800
2021/9/3	110.0150
2021/9/6	109.7850
2021/9/7	109.8200
2021/9/8	110.4050
2021/9/9	110.1350
2021/9/10	109.8950
2021/9/13	110.0300
2021/9/14	110.0750
2021/9/15	109.5850
2021/9/16	109.2350
2021/9/17	109.8850
2021/9/20	109.9050
2021/9/21	109.5150
2021/9/22	109.5250
2021/9/23	109.8350
2021/9/24	110.4850
2021/9/27	110.6350
2021/9/28	111.2150
2021/9/29	111.4750
2021/9/30	111.8450
2021/10/1	111.2050
2021/10/4	111.0650
2021/10/5	111.1900
2021/10/6	111.7650

日期	USD/JPY
2021/10/7	111.4750
2021/10/8	111.9150
2021/10/11	112.7350
2021/10/12	113.2950
2021/10/13	113.4750
2021/10/14	113.5250
2021/10/15	114.1500
2021/10/18	114.3150
2021/10/19	114.1150
2021/10/20	114.5650
2021/10/21	114.0250
2021/10/22	113.9950
2021/10/25	113.5850
2021/10/26	113.9750
2021/10/27	114.0900
2021/10/28	113.5750
2021/10/29	113.6450

*以上 USD/JPY 数据来源于每个观察日的东京时间下午 3 点在彭博“BFI X”页面中“即期”一栏下显示的每一美元兑日元的汇率中间价。

数据期间：自 2021 年 9 月 2 日至 2021 年 10 月 29 日。

广零 2020001

第 2112 期个人结构性存款产品挂钩标的表现

产品信息：

产品名称：挂钩 USD/JPY 汇率型结构性存款
 产品代码：21FX09001R
 产品期号：2112
 产品起息日：2021/9/22
 产品到期日：2021/11/30
 产品期限：69 天
 挂钩标的：USD/JPY 即期汇率中间价
 基准日：2021/9/22
 初始价格：109.525
 观察区间上限：初始价格+【3.00】
 观察区间下限：初始价格-【3.00】

产品挂钩标的在观察期内每日表现：

日期	USD/JPY
2021/9/22	109.5250
2021/9/23	109.8350
2021/9/24	110.4850
2021/9/27	110.6350
2021/9/28	111.2150
2021/9/29	111.4750
2021/9/30	111.8450
2021/10/1	111.2050
2021/10/4	111.0650
2021/10/5	111.1900
2021/10/6	111.7650
2021/10/7	111.4750
2021/10/8	111.9150
2021/10/11	112.7350
2021/10/12	113.2950
2021/10/13	113.4750
2021/10/14	113.5250
2021/10/15	114.1500
2021/10/18	114.3150
2021/10/19	114.1150
2021/10/20	114.5650
2021/10/21	114.0250
2021/10/22	113.9950
2021/10/25	113.5850
2021/10/26	113.9750

日期	USD/JPY
2021/10/27	114.0900
2021/10/28	113.5750
2021/10/29	113.6450

*以上 USD/JPY 数据来源于每个观察日的东京时间下午 3 点在彭博“BFI X”页面中“即期”一栏下显示的每一美元兑日元的汇率中间价。

数据期间：自 2021 年 9 月 22 日至 2021 年 10 月 29 日。

广零 2020001

第 2113 期个人结构性存款产品挂钩标的表现

产品信息：

产品名称：挂钩三个月美元 LIBOR 结构性存款
 产品代码：211R09002R
 产品期号：2113
 产品起息日：2021/9/29
 产品到期日：2022/1/6
 产品期限：99 天
 挂钩标的：三个月美元 LIBOR 利率
 观察区间上限：3.00%
 观察区间下限：-0.25%

产品挂钩标的在观察期内每日表现：

日期	3M Libor (%)
2021/9/29	0.1309
2021/9/30	0.1301
2021/10/1	0.1331
2021/10/4	0.1266
2021/10/5	0.1240
2021/10/6	0.1240
2021/10/7	0.1236
2021/10/8	0.1211
2021/10/11	0.1218
2021/10/12	0.1268
2021/10/13	0.1238
2021/10/14	0.1223
2021/10/15	0.1236
2021/10/18	0.1315
2021/10/19	0.1295
2021/10/20	0.1283
2021/10/21	0.1239
2021/10/22	0.1249
2021/10/25	0.1345
2021/10/26	0.1359
2021/10/27	0.1286
2021/10/28	0.1316

*以上 3M Libor 数据来源于路透系统 Libor01 页面上显示的 3 个月美元拆借利率。
 数据期间：自 2021 年 9 月 29 日至 2021 年 10 月 28 日。

第 2114 期个人结构性存款产品挂钩标的表现

产品信息：

产品名称：挂钩三个月美元 LIBOR 结构性存款
 产品代码：211R09003R
 产品期号：2114
 产品起息日：2021/9/29
 产品到期日：2022/3/28
 产品期限：180 天
 挂钩标的：三个月美元 LIBOR 利率
 观察区间上限： 3.00%
 观察区间下限： -0.30%

产品挂钩标的在观察期内每日表现：

日期	3M Libor (%)
2021/9/29	0.1309
2021/9/30	0.1301
2021/10/1	0.1331
2021/10/4	0.1266
2021/10/5	0.1240
2021/10/6	0.1240
2021/10/7	0.1236
2021/10/8	0.1211
2021/10/11	0.1218
2021/10/12	0.1268
2021/10/13	0.1238
2021/10/14	0.1223
2021/10/15	0.1236
2021/10/18	0.1315
2021/10/19	0.1295
2021/10/20	0.1283
2021/10/21	0.1239
2021/10/22	0.1249
2021/10/25	0.1345
2021/10/26	0.1359
2021/10/27	0.1286
2021/10/28	0.1316

*以上 3M Libor 数据来源于路透系统 Libor01 页面上显示的 3 个月美元拆借利率。

数据期间：自 2021 年 9 月 29 日至 2021 年 10 月 28 日。

广零 2020001