

工银理财·鑫鼎利私银尊享固收增强封闭式理财产品（20GS2826）（20GS2826）2021年第一季度季报

1、重要提示			
无			
2、理财产品概况			
产品名称	工银理财·鑫鼎利私银尊享固收增强封闭式理财产品（20GS2826）		
产品代码	20GS2826		
销售币种	人民币		
产品风险评级	PR3		
收益类型	非保本浮动收益		
产品成立日	2020年07月16日		
产品到期日	2021年10月14日		
业绩比较基准	本产品业绩比较基准为4.25%（年化），该业绩比较基准仅作为计算浮动管理费的依据，不构成工银理财有限责任公司对该理财产品的任何收益承诺		
托管费率（年）	0.02%		
销售手续费率（年）	0.05%		
杠杆水平	100%		
产品托管人	工商银行深圳分行		
报告期末理财产品份额	4,801,876,000.00		
3、产品净值表现			
该产品在季度最后一个市场交易日的资产净值为49.46亿元，份额净值为1.0301。			
4、市场情况及产品运作回顾			
4.1、市场回顾			
2021年一季度债券市场总体呈现震荡态势。中债10年国债收益率上行4.6bp至3.19%，中债10年国开债收益率上行3.3bp至3.57%；中债-高信用等级中期票据全价(1-3年)指数上涨0.19%。			
4.2、操作回顾			
本产品以中短期期限的信用债投资为主，整体投资策略较为稳健。			
4.3、下一步投资策略			
在充分研判市场的基础上，力求在降低风险的同时，通过调整组合久期、优选行业等手段为客户提供较高的收益水平。			
5、投资组合报告			
5.1投资组合概况			
本产品直接投资的资产比例为0.02%，间接投资的比例为99.98%。其中直接投资固收类100%、权益类0%、商品及衍生品类0%、其他0%；间接投资固收类98.19%、权益类1.81%、商品及衍生品类0%、其他0%。			
5.2投资组合基本情况			
序号	资产种类	占投资组合的比例（%）期末	占投资组合的比例（%）期初
※	固定收益类	100.00%	100.00%
	货币类	0.19%	0.10%
	债券类	99.81%	99.90%
合计		100%	100%
5.3 产品投资前十项资产明细			

序号	资产名称	规模	规模占比 (%)
1	中信证券贵宾定制34号集合资产管理计划	2776683260.41	56.04%
2	中信证券贵宾定制6号集合资产管理计划	752708967.80	15.19%
3	申万宏源工宏4号定向资产管理计划	502153043.30	10.13%
4	华西证券融诚贵宾3号集合资产管理计划	484480652.22	9.78%
5	广发证券稳利2号集合资产管理计划	429363663.32	8.67%
6	活期存款	9301302.38	0.19%

5.4 产品投资前十名债券明细

债券代码	债券名称	占投资组合的比例 (%)
无		

5.5 产品投资前十名股票明细

股票代码	股票名称	占投资组合的比例 (%)
无		

5.6 报告期末产品投资非标准化债权类资产明细

序号	融资客户	投资品名称	剩余融资期限 (月)	投资品年收益率 (%)	投资模式	是否存在风险	占投资组合的比例 (%)
无							

5.7 投资组合流动性风险分析

本产品主要投资于标准化债券资产，流动性风险较小。

6、其他重要信息

6.1 理财产品在报告期内投资关联方发行的证券的情况

- 1) 报告期内投资于中信建投证券发行的21信投C3（证券代码：175758.SH），交易数量为234321.93（张），单位价格为100，标的资产类别为债券；
- 2) 报告期内投资于中信建投证券发行的21信投C1（证券代码：175640.SH），交易数量为10264.15（张），单位价格为100，标的资产类别为债券；

6.2 理财产品在报告期内投资关联方承销的证券的情况

报告期内投资于中国工商银行股份有限公司或中信建投证券股份有限公司主承销或联席主承销的债券合计37笔，金额合计4.29亿元，交易价格公允。具体可通过产品说明书约定的方式与我司联系。

其中，投资金额由大到小前10笔交易明细为：

- 1) 报告期内投资于工商银行或中信建投证券承销的21戴姆勒财PPN002BC（证券代码：032100336.IB），交易数量为390536.55（张），单位价格为100，标的资产类别为债券；
- 2) 报告期内投资于工商银行或中信建投证券承销的21戴姆勒财PPN001BC（证券代码：032100335.IB），交易数量为390536.55（张），单位价格为100，标的资产类别为债券；
- 3) 报告期内投资于工商银行或中信建投证券承销的21川高速MTN001（证券代码：102100266.IB），交易数量为292902.41（张），单位价格为100，标的资产类别为债券；
- 4) 报告期内投资于工商银行或中信建投证券承销的21工元乐居1A1（证券代码：2189124.IB），交易数量为226181.51（张），单位价格为100，标的资产类别为债券；
- 5) 报告期内投资于工商银行或中信建投证券承销的21工元乐居1A1（证券代码：2189124.IB），交易数量为226181.51（张），单位价格为100，标的资产类别为债券；
- 6) 报告期内投资于工商银行或中信建投证券承销的21中化Y1（证券代码：175702.SH），交易数量为216073.72（张），单位价格为100，标的资产类别为债券；
- 7) 报告期内投资于工商银行或中信建投证券承销的21中化Y1（证券代码：175702.SH），交易数量为216073.72（张），单位价格为100，标的资产类别为债券；
- 8) 报告期内投资于工商银行或中信建投证券承销的21中化Y1（证券代码：175702.SH），交易数量为216073.72（张），单位价格为100，标的资产类别为债券；

9) 报告期内投资于工商银行或中信建投证券承销的21青城01 (证券代码: 178046.SH), 交易数量为206558.84 (张), 单位价格为100, 标的资产类别为债券;

10) 报告期内投资于工商银行或中信建投证券承销的21青城01 (证券代码: 178046.SH), 交易数量为206558.84 (张), 单位价格为100, 标的资产类别为债券;

6.3 理财产品在报告期内的其他重大关联交易
无。