

工银理财·恒睿私银固定收益类封闭净值型理财产品（20GS6809）（20GS6809）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·恒睿私银固定收益类封闭净值型理财产品（20GS6809）		
产品代码	20GS6809		
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09月13日		
业绩比较基准	本产品为净值型产品，其业绩表现将随市场波动，具有不确定性。本产品业绩比较基准为4.0%（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）	0.30%		
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	999,948,000.00		
3、产品净值表现			
截至2021年03月31日，产品净值为1.0248,累计净值为1.0248,产品资产净值1024721097.19,因市场波动导致产品净值年化收益率低于业绩基准			
4、市场情况及产品运作回顾			
4.1、市场回顾			
市场方面，一季度全球疫苗开始接种，疫情较2020年转好，经济回暖，资金面1月底面临短暂的收缩，市场宽幅波动，十年期国债中债估值到期收益率先下后上，由1月初3.11%上行至最高3.2825%，之后随着资金面重回宽松又下行回到3.18%；A股方面1季度大幅波动，先涨后跌，上证综指跌0.9%，沪深300指数跌3.1%，创业板指跌7.0%。A股行业板块表现分化，涨幅前三位的中信一级行业为钢铁、银行、电力及公共事业；跌幅前三位的中信一级行业为国防军工、非银行金融、通信。商品市场方面，南华商品指数上涨6.0%。			
4.2、操作回顾			
根据市场波动情况，及时调整产品内资产持仓，运用大类资产配置方案、多资产投资、多策略投资的方式进行灵活调整，把握市场波动机会，稳健提升产品收益			
4.3、下一步投资策略			
基于国内疫情控制成果显著，经济已经基本恢复至正常水平，下一步将根据产品的最近净值情况，灵活调整大类资产比例，监测市场指标情况，运用多种方式控制回撤。			
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5.23%，间接投资的比例为94.77%。其中直接投资中固收类100%；间接投资中固收类94.13%、权益类4.68%、商品及衍生品类1.2%。			
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	80.54%	88.12%

	货币类	5.23%	55.02%
	债券类	75.31%	33.10%
※	混合类资产	19.46%	11.88%
	对冲基金类	11.76%	11.88%
	混合基金类	7.70%	0.00%
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	中信期货工银量化精选2号	405674828.60	39.43%
2	国信证券稳1号集合资产管理计划	356635297.93	34.66%
3	创金合信鼎泰10号资产管理计划	102035599.32	9.92%
4	中信期货灵活配置1号集合资产管理计划	69916811.69	6.80%
5	活期存款	53837198.13	5.23%
6	东证期货工银慧享一号集合资产管理计划	18921465.15	1.84%
7	中信期货工银量化精选1号	12464715.84	1.21%
8	东证工银量化宏观配置3号资产管理计划	9321828.06	0.91%

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

无

6、其他重要信息

报告期内投资于工银瑞信基金管理有限公司发行的工银金融地产股票(证券代码: 000251.OF),交易数量为953416.31,单位价格为2.641,标的资产类别为基金

报告期内投资于中国工商银行承销的19海通恒信PPN002(证券代码: 031900472.IB),交易数量为26363.85,单位价格为100,标的资产类别为债券

报告期内投资于中国工商银行承销的19市北高新PPN002(证券代码: 031900818.IB),交易数量为5272.77,单位价格为100,标的资产类别为债券

报告期内投资于中国工商银行承销的19戴姆勒PPN003BC(证券代码: 031900827.IB),交易数量为17575.9,单位价格为100,标的资产类别为债券

报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的20宜宾国资PPN002(证券代码: 032000678.IB),交易数量为17575.9,单位价格为100,标的资产类别为债券

报告期内投资于中国工商银行承销的19光穗节能ABN001优先(证券代码: 081900685.IB),交易数量为22848.67,单位价格为100,标的资产类别为债券

报告期内投资于中国工商银行承销的20光穗南电ABN001优先(证券代码: 082001001.IB),交易数量为189992.6,单位价格为100,标的资产类别为债券

报告期内投资于中国工商银行承销的19中核MTN005A(证券代码: 101901633.IB),交易数量为23749.07,单位价格为100,标的资产类别为债券

报告期内投资于中国工商银行承销的20中核MTN002(证券代码: 102002011.IB),交易数量

为42748.33,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19甘公03(证券代码:114624.SZ),交易数量为109245.74,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的16长沙01(证券代码:135562.SH),交易数量为5272.77,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的20金街01(证券代码:149174.SZ),交易数量为52247.96,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19首业04(证券代码:151587.SH),交易数量为27264.25,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19融和02(证券代码:151621.SH),交易数量为7025.84,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19甘交01(证券代码:151641.SH),交易数量为33248.7,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19中企01(证券代码:151662.SH),交易数量为23749.07,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19兴城01(证券代码:151673.SH),交易数量为84262.03,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19不动01(证券代码:151700.SH),交易数量为47498.15,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19首钢01(证券代码:151749.SH),交易数量为26363.85,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19首业06(证券代码:151812.SH),交易数量为47498.15,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19不动02(证券代码:151822.SH),交易数量为28498.89,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19首钢02(证券代码:151857.SH),交易数量为23419.47,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19融和03(证券代码:151911.SH),交易数量为4749.81,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19延长Y3(证券代码:155871.SH),交易数量为3116.62,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19常城03(证券代码:162026.SH),交易数量为11709.74,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19常城04(证券代码:162283.SH),交易数量为14249.44,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19晋交03(证券代码:162289.SH),交易数量为52247.96,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19常城05(证券代码:162415.SH),交易数量为49255.74,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19华通01(证券代码:162700.SH),交易数量为11709.74,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的20津投03(证券代码:163146.SH),交易数量为9367.79,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的G20FX3(证券代码:163559.SH),交易数量为71247.22,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19电建Y3(证券代码:163957.SH),交易数量为3515.18,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的20兴港02(证券代码:166123.SH),交易数量为22848.67,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的20豫水01(证券代码:167121.SH),交易数量为23749.07,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的20豫水02(证券代码:167393.SH),交易数量为10545.54,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的20绿城1A(证券代码:168553.SH),交易数量为21374.17,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的20华电Y5(证券代码:175557.SH),交易数量为71247.22,单位价格为100,标的资产类别为债券
 报告期内投资于中国工商银行承销的20上汽通用债(证券代码:2022018.IB),交易数量

为12303.13, 单位价格为100, 标的资产类别为债券

报告期内投资于中国工商银行中信建投证券股份有限公司承销的20工银租赁债02(证券代码

: 2022048. IB), 交易数量为23749.07, 单位价格为100, 标的资产类别为债券

报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的21航集02(证券代码: 175642. SH), 交易数

量为11709.74, 单位价格为100, 标的资产类别为债券

报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的GC国能01(证券代码: 175789. SH), 交易数

量为46838.94, 单位价格为100, 标的资产类别为债券