

工银理财·恒睿平衡私银尊享混合类产品(20HH6810) (20HH6810) 2021年第三季度季报

1、重要提示

尊敬的客户，感谢您选择工银理财！您购买的本款产品是由工银理财有限责任公司自主设计、投资、运作的理财产品。为保障您的合法权益，请您在进行金融投资时，警惕任何人与机构假借我公司理财产品之名推介、推销其他类型金融产品。

2、理财产品概况

产品名称	工银理财·恒睿平衡私银尊享混合类产品(20HH6810)
产品代码	20HH6810
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02月27日
产品到期日	2022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4.85%（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	100.79%
产品托管人	工商银行广东省分行营业部
报告期末理财产品份额	121,034,000.00

3、产品净值表现

截至2021年09月30日，产品净值为1.115，累计净值为1.115，产品资产净值134955784.52，产品年化收益率为7.21%，超过业绩基准

4、市场情况及产品运作回顾

4.1、市场回顾

市场方面，2021年三季度股债市场分化显著，十年期国债中债估值到期收益率略有下行，从3.08%下行至2.88%；A股方面经历上半年的调整后，三季度处于宽幅震荡区间、结构分化。三季度上证综指跌0.64%，沪深300指数跌6.85%，创业板指跌6.69%。A股行业板块表现分化，涨跌幅前三位的中信一级行业为煤炭、有色金属、钢铁；涨跌幅后三位的中信一级行业为消费者服务、医药、食品饮料。商品市场方面，南华商品指数上涨6.08%。

4.2、操作回顾

根据资产配置方案，实时监测市场情况，适当降低权益类资产比例，寻找投资机会。

4.3、下一步投资策略

结合产品净值情况和市场情况进行大类资产配置，固收资产方面以信用优选为核心，适当参与久期策略，权益资产方面跟踪行业景气度，配置权益类资产。

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29.21%，间接投资的比例为70.79%。其中直接投资中固收类100%；间接投资中固收类73.43%、商品及衍生品类0.9%、其他（基金）25.67%。

5.2投资组合基本情况

序号	资产种类	占投资组合的比例（%）
※	固定收益类	81.19%

	货币类	32.97%
	债券类	48.22%
※	商品及金融衍生品类	0.64%
	衍生品类	0.64%
※	混合类资产	18.17%
	其他类	18.17%
合计		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	国信证券稳1号集合资产管理计划	71725196.36	52.76%
2	活期存款	39718907.51	29.22%
3	光大期货多策略2号集合资产管理计划	12991015.36	9.56%
4	中信期货工银量化精选1号	11511986.57	8.47%

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

投资组合在报告期内，投资的债券、权益和商品及衍生品类资产均可在二级市场变现。

6、其他重要信息

报告期内投资于中国工商银行承销的21明静ABN001优先(证券代码: 082100019. IB), 交易数量为1503.01, 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银行理财计划代理人卖出的20京能电力MTN001(证券代码: 102001636. IB), 交易数量为4959.94, 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21华为MTN002(证券代码: 102100344. IB), 交易数量为3006.02, 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21广晟MTN001(证券代码: 102100445. IB), 交易数量为1803.61, 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21中金集MTN001(证券代码: 102100753. IB), 交易数量为2404.82, 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21川高速MTN005(证券代码: 102100755. IB), 交易数量为2254.52, 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21金地MTN005(证券代码: 102101091. IB), 交易数量为1503.01, 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农业银行永续债01(证券代码: 1928021. IB), 交易数量为1503.01, 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中国银行二级03(证券代码: 1928033. IB), 交易数量为2705.42, 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邮储银行永续债(证券代码: 2028006. IB), 交易数量为751.51, 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交通银行二级(证券代码: 2028018. IB), 交易数量为4509.04, 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浦发银行二级01(证券代码: 2028025. IB), 交易数量为1503. 01, 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中国银行二级01(证券代码: 2028038. IB), 交易数量为3006. 02, 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21奔驰汽车债02(证券代码: 2122035. IB), 交易数量为4509. 04, 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21中国银行二级01(证券代码: 2128008. IB), 交易数量为3456. 93, 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21邮储银行永续债01(证券代码: 2128011. IB), 交易数量为1503. 01, 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21中信银行永续债(证券代码: 2128017. IB), 交易数量为3006. 02, 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21中国银行永续债01(证券代码: 2128019. IB), 交易数量为3006. 02, 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21交通银行永续债(证券代码: 2128022. IB), 交易数量为6012. 05, 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21建设银行二级01(证券代码: 2128025. IB), 交易数量为6012. 05, 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21交通银行二级(证券代码: 2128030. IB), 交易数量为6012. 05, 单位价格为100, 标的资产类别为债券