

# 工银理财·恒睿私银尊享(私银嘉年华)混合封闭净值型产品20HH6815 (20HH6815) 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·恒睿私银尊享(私银嘉年华)混合封闭净值型产品20HH6815                                                        |               |               |
| 产品代码                                                                                                                                                                                                                                                         | 20HH6815                                                                                   |               |               |
| 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04月07日                                                                                |               |               |
| 产品到期日                                                                                                                                                                                                                                                        | 2021年11月22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5.0%（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）                                                                                                                                                                                                                                                    | 0.10%                                                                                      |               |               |
| 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                                                                                                                                                                                                                                                   | 983,794,000.00                                                                             |               |               |
| 3、产品净值表现                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                            |               |               |
| 截至2021年03月31日，产品净值为1.1096,累计净值为1.1096,产品资产净值1091616187.26,产品年化收益率为11.14%,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，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                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                            |               |               |
| 根据资产配置方案，做适当的止盈操作，落袋为安，实时监测市场情况，寻找优秀的投资机会，稳健提升产品收益。                                                                                                                                                                                                          |                                                                                            |               |               |
| 4.3、下一步投资策略                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                                                            |               |               |
| 结合产品净值情况，结合大类资产配置方案和市场数据，参照产品期限调整产品仓位，在市场低位适当增加风险资产比例，运用止盈、止损、分散化投资等方式控制回撤                                                                                                                                                                                   |                                                                                            |               |               |
| 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11.45%，间接投资的比例为88.55%。其中直接投资中固收类100%；间接投资中固收类75.79%、权益类19.95%、商品及衍生品类4.26%。                                                                                                                                                                     |                                                                                            |               |               |
| 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                                                                                      | 65.16%        | 67.45%        |

|    |         |        |        |
|----|---------|--------|--------|
|    | 货币类     | 11.45% | 28.70% |
|    | 债券类     | 53.71% | 22.23% |
|    | 非标准化债权类 | 0.00%  | 16.52% |
| ※  | 混合类资产   | 34.84% | 32.55% |
|    | 对冲基金类   | 0.24%  | 0.22%  |
|    | 混合基金类   | 34.60% | 32.33% |
| 合计 |         | 100%   | 100%   |

### 5.3 产品投资前十名资产明细

| 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    | 422003176.53 | 38.49%  |
| 2  | 中信期货灵活配置1号集合资产管理计划 | 283816997.25 | 25.89%  |
| 3  | 中信期货工银量化精选1号       | 166790537.36 | 15.21%  |
| 4  | 20HH6815存上海0331    | 70000000.00  | 6.38%   |
| 5  | 光大期货多策略2号集合资产管理计划  | 56861091.96  | 5.19%   |
| 6  | 活期存款               | 55574579.11  | 5.07%   |
| 7  | 东证工银量化宏观配置3号资产管理计划 | 38680245.60  | 3.53%   |
| 8  | 东证期货工银慧享二号集合资产管理计划 | 2615521.85   | 0.24%   |

### 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2797553.31,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8313.61,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27712.04,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12932.17,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19常城03(证券代码:162026.SH),交易数量为13856.02,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13856.02,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11084.82,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13856.02,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55424.08, 单位价格为100, 标的资产类别为债券