

工银理财·恒睿私银尊享科技创新混合3个月定开净值型(20HH6824) (20HH6824) 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·恒睿私银尊享科技创新混合3个月定开净值型(20HH6824)
产品代码	20HH6824
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06月02日
产品到期日	--
开放日	产品投资封闭期结束后的前5个工作日即2020年10月9日至10月14日及以后每年1月、4月、7月和10月的前5个工作日
开放时间	开放日24小时为开放时间
购买、赎回方式	开放期后第一个工作日确认客户赎回、申购是否成功，并以开放期最后一个工作日净值计算申购、赎回资金。
业绩比较基准	本产品业绩比较基准为4.00%（年化），本业绩比较基准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）	0.30%
杠杆水平	100%
产品托管人	工商银行上海分行
报告期末理财产品份额	1,222,795,064.39
3、产品净值表现	
截至2021年03月31日，产品净值为1.0542，累计净值为1.0542，产品资产净值1289067708.87，产品年化收益率为6.53%，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，国内经济活动继续回暖，货币政策不急转弯，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%；权益市场A股一季度大幅波动，先扬后抑，被市场称为基金抱团股的核心资产带动指数快速下行，上证综指跌0.90%，沪深300指数跌3.13%，创业板指跌7.00%，市场成交量持续下降。A股行业板块表现分化，包括化工、钢铁、电力等在内的顺周期板块表现较佳，国防军工、非银行金融等板块跌幅居前。商品市场方面，南华商品指数上涨6.0%。	
4.2、操作回顾	
一季度根据市场波动情况，降低权益资产配置比例，增加固收类资产配置，稳健提升产品收益。权益资产调整结构，增加低估值板块配置，控制产品净值波动。	
4.3、下一步投资策略	
基于产品生命周期进行组合管理，以绝对收益策略思路灵活调整大类资产比例，控制组合波动和风险，增强组合收益。基于国内外宏观经济数据的边际变化，捕捉各类资产的配置机会，运用多种方式控制组合波动和回撤。	
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26.54%，间接投资的比例为73.46%。其中直接投资中固收	

类100%；间接投资中固收类81.44%、权益类14.84%、商品及衍生品类3.72%。

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	68.89%	60.27%
	货币类	26.54%	60.27%
	债券类	42.35%	0.00%
※	混合类资产	31.11%	39.73%
	对冲基金类	7.50%	0.00%
	混合基金类	23.61%	39.73%
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	445458985.34	34.55%
2	活期存款	342131073.93	26.54%
3	中信期货灵活配置1号集合资产管理计划	163765258.75	12.70%
4	东证工银量化宏观配置3号资产管理计划	140565473.25	10.90%
5	国信证券稳1号集合资产管理计划	100514440.43	7.80%
6	东证期货工银慧享一号集合资产管理计划	96704310.41	7.50%

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3736321.2,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20光穗南电ABN001优先(证券代码: 082001001.IB),交易数量为208625,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26078.12,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46940.62,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甘公03(证券代码: 114624.SZ),交易数量为119959.37,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57371.87,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26078.12,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1980.17,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甘交01(证券代码:151641.SH),交易数量为36509.37,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26078.12,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88665.62,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不动01(证券代码:151700.SH),交易数量为52156.25,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首业06(证券代码:151812.SH),交易数量为52156.25,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不动02(证券代码:151822.SH),交易数量为31293.75,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6600.57,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5215.62,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延长Y3(证券代码:155871.SH),交易数量为46996,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3300.28,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15646.87,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57371.87,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52156.25,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华通01(证券代码:162700.SH),交易数量为3300.28,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2640.23,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78234.37,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26078.12,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23470.31,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78234.37,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26078.12,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3300.28,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13201.13,单位价格为100,标的资产类别为债券