

工银理财·恒睿睿盈私银尊享混合类1年定期开放式理财产品2号 (20HH6829) 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·恒睿睿盈私银尊享混合类1年定期开放式理财产品2号
产品代码	20HH6829
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11月10日
产品到期日	--
开放日	产品投资封闭期结束后每年11月前5个工作日。第一个开放日为2021年11月1日至2021年11月5日。
开放时间	开放日24小时，非开放时间提交的申购、赎回申请属于预约交易自动延至下一开放日处理。
购买、赎回方式	产品募集期过后，客户可于开放日24小时进行申购或赎回产品，申赎交易统一集中在开放期结束后的下一工作日确认，申购资金于开放期结束后下一工作日扣款，赎回资金于开放期结束后三个工作日内兑付。
业绩比较基准	本产品业绩比较基准为4.10%（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）	0.30%
杠杆水平	100%
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	228,523,000.00
3、产品净值表现	
截至2021年03月31日，产品净值为1.0017，累计净值为1.0017，产品资产净值228905127.54。	
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55.03%，间接投资的比例为44.97%。其中直接投资中固收类100%；间接投资中固收类99.08%、权益类0.79%、商品及衍生品类0.14%。

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	99.33%	100.00%
	货币类	55.03%	100.00%
	债券类	44.30%	0.00%
※	混合类资产	0.67%	0.00%
	对冲基金类	0.67%	0.00%
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	中信期货工银量化精选2号	101409239.39	44.30%
2	6829存北京0331	100000000.00	43.69%
3	活期存款	25965591.70	11.34%
4	东证期货工银慧享一号集合资产管理计划	1536504.94	0.67%

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22430.65,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47493.71,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5936.71,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10686.09,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27308.89,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20金街01(证券代码: 149174.SZ),交易数量为13060.77,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19首业04(证券代码: 151587.SH),交易数量为5936.71,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8311.4, 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5936.71, 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20184.83, 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11873.43, 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11873.43, 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7124.06, 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1187.34, 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3562.03, 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晋交03(证券代码: 162289.SH), 交易数量为13060.77, 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19常城05(证券代码: 162415.SH), 交易数量为11873.43, 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17810.14, 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5936.71, 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5343.04, 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20华电Y5(证券代码: 175557.SH), 交易数量为17810.14, 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5936.71, 单位价格为100, 标的资产类别为债券