

工银理财·恒睿睿盈私银尊享混合类封闭式理财产品（21HH6801）（21HH6801）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·恒睿睿盈私银尊享混合类封闭式理财产品（21HH6801）
产品代码	21HH6801
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	2021年02月09日
产品到期日	2022年12月20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4.50%（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	100.34%
产品托管人	工商银行深圳分行
报告期末理财产品份额	142,090,000.00

3、产品净值表现

截至2021年09月30日，产品净值为1.0135，累计净值为1.0135，产品资产净值144008470.06。

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

根据市场情况，结合大类资产配置方案，根据市场情况，择机进行操作，适当增加权益资产比例，灵活配置基金，及时跟踪产品收益和波动率指标。

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4.82%，间接投资的比例为95.18%。其中直接投资中固收类100%；间接投资中固收类74.42%、商品及衍生品类1.47%、其他（基金）24.11%。

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	75.65%

	货币类	11.41%
	债券类	64.24%
※	商品及金融衍生品类	1.4%
	衍生品类	1.4%
※	混合类资产	22.95%
	其他类	22.95%
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	64319374.04	44.55%
2	中信期货工银量化精选2号	20305664.87	14.06%
3	中信期货工银量化精选1号	16639670.09	11.52%
4	华泰证券资管工行2号定向资产管理计划	15065264.68	10.43%
5	中信期货灵活配置1号集合资产管理计划	7109290.39	4.92%
6	东证期货工银慧享一号集合资产管理计划	6795862.07	4.71%
7	证券清算款	6500000.00	4.50%
8	东证期货工银慧享二号集合资产管理计划	6138466.57	4.25%
9	东证工银量化宏观配置3号资产管理计划	1040601.80	0.72%
10	活期存款	467847.34	0.32%

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

报告期内投资于工银瑞信基金管理有限公司发行的工银金融地产混合A(证券代码: 000251.OF), 交易数量为188970.07, 单位价格为2.587, 标的资产类别为基金

报告期内投资于工银瑞信基金管理有限公司发行的工银文体产业股票A(证券代码: 001714.OF), 交易数量为79831.65, 单位价格为3.452, 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西永PPN002(证券代码: 031900721.IB), 交易数量为979.08, 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戴姆勒财PPN004BC(证券代码: 032100573.IB), 交易数量为2650.24, 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3533.65, 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明静ABN001优先(证券代码: 082100019.IB), 交易数量为1347.82, 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18中色MTN002(证券代码: 101811151. IB), 交易数量为14686. 15, 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441. 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宝武集团MTN001(证券代码: 102001052. IB), 交易数量为4569. 03, 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4447. 81, 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795. 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21华为MTN002(证券代码: 102100344. IB), 交易数量为2695. 64, 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1617. 39, 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2156. 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川高速MTN005(证券代码: 102100755. IB), 交易数量为2021. 73, 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锦江国际MTN001(证券代码: 102100796. IB), 交易数量为883. 41, 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华侨城MTN002A(乡村振兴)(证券代码: 102100893. IB), 交易数量为1855. 17, 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MTN004(证券代码: 102100991. IB), 交易数量为1766. 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成渝高速MTN001(证券代码: 102100999. IB), 交易数量为1325. 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21三一MTN001(证券代码: 102101031. IB), 交易数量为618. 39, 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1347. 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19农业银行永续债01(证券代码: 1928021. IB), 交易数量为1347. 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19中国银行二级03(证券代码: 1928033. IB), 交易数量为2426. 08, 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工银租赁债02(证券代码: 2022048. IB), 交易数量为441. 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汇丰银行02(证券代码: 2026003. IB), 交易数量为1631. 79, 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673. 91, 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4043. 47, 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1347. 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20中国银行二级01(证券代码: 2028038. IB), 交易数量为2695. 64, 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4043. 47, 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3099. 99, 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2231. 23, 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民生银行永续债01(证券代码: 2128016. IB), 交易数量为3533. 65, 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2695. 64, 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4462. 47, 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5391.29,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5391.29,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邮储银行二级01(证券代码: 2128028.IB),交易数量为3533.65,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5391.29,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中盈万家3A2_bc(证券代码: 2189209.IB),交易数量为2650.24,单位价格为100,标的资产类别为债券
报告期内投资于工银瑞信基金管理有限公司发行的工银上证科创板50成份ETF(证券代码: 588050.SH),交易数量为256757.32,单位价格为1.4047,标的资产类别为基金