

工银理财·恒睿睿益私银尊享封闭式理财产品（21GS6839） （21GS6839）2022年第一季度季报

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。业绩比较基准是本机构基于产品性质、投资策略、过往经验等因素对产品设定的投资目标，不代表产品的未来表现和实际收益，不构成对产品收益的承诺。理财非存款、产品有风险、投资须谨慎。

2、理财产品概况

产品名称	工银理财·恒睿睿益私银尊享封闭式理财产品（21GS6839）
产品代码	21GS6839
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10月25日
产品到期日	2022年12月27日
业绩比较基准	本产品业绩比较基准为3.80%-4.20%（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）	0.10%
杠杆水平	107.69%
产品托管人	工商银行重庆分行
报告期末理财产品份额	1,326,627,000.00

3、产品净值表现

截至2022年03月31日，产品净值为0.9954，累计净值为0.9954，产品资产净值1320495900.77。

4、市场情况及产品运作回顾

4.1、市场回顾

市场方面，2022年一季度股债市场分化显著，十年期国债中债估值到期收益率走出V型走势，从2.78%下行至2.67%，之后再回升至2.79%；A股方面一季度整体呈下跌态势，市场调整较为剧烈。2022年一季度上证综指跌10.65%，沪深300指数跌14.53%，创业板指跌19.96%。A股行业板块层面多数下跌，仅4个行业取得正收益，涨幅前四的分别为煤炭、房地产、银行、农林牧渔；跌幅靠前三位的行业为电子、国防军工、汽车。商品市场方面，南华商品指数上涨23%。

4.2、操作回顾

结合产品期限、风险评级和当前持仓情况，固收投资方面优选信用债，权益资产方面开展多策略配置，跟踪监测产品收益表现、波动率和最大回撤情况，并进行持仓的灵活调整。

4.3、下一步投资策略

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。

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15.19%，间接投资的比例为84.81%。其中直接投资固收类100.00%、权益类0.00%、商品及衍生品类0.00%、公募基金0.00%；间接投资固收类81.56%、权益类0.49%、商品及衍生品类0.08%、公募基金17.87%。本产品投资的商品及金融衍生品类资产用于资产配置、对冲，规模合计为969042.98元，占产品总资产0.07%，其中规模合计为商品及金融衍生品类资产占用的保证金。

5.2投资组合基本情况

	占投资组合的比例
--	----------

序号	资产种类	(%)
※	固定收益类	84.37%
	货币类	20%
	债券类	64.37%
※	权益类	0.42%
	股票类	0.42%
※	商品及金融衍生品类	0.07%
	衍生品类	0.07%
※	基金	15.15%
	公募基金	15.15%
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	419458501.58	31.74%
2	华泰智富2号集合资产管理计划	354673923.55	26.84%
3	中信期货灵活配置1号集合资产管理计划	195522707.58	14.80%
4	21GS6839存北京分行0311	160000000.00	12.11%
5	中信期货工银量化精选2号	101027152.55	7.64%
6	证券清算款	50000000.00	3.78%
7	东证期货工银慧享二号集合资产管理计划	35016886.46	2.65%
8	活期存款	5823802.13	0.44%

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

本产品的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易场所或者银行间同业市场交易，组合变现比例能力较好。

6、其他重要信息

报告期内投资工行承销的22中盈万家1A3(代码：2289030.IB)，期末持仓数量13339761.9, 期末价格99.49，标的资产类别债券；报告期内投资工行承销的22邮储银行永续债01(代码：2228001.IB)，期末持仓数量3759606.31, 期末价格99.81，标的资产类别债券；报告期内投资工行承销的22农业银行永续债01(代码：2228011.IB)，期末持仓数量554619.61, 期末价格99.53，标的资产类别债券；报告期内投资工行承销的22农业银行永续债01(代码：2228011.IB)，期末持仓数量3759606.31, 期末价格99.53，标的资产类别债券；报告期内投资工行承销的22华商银行01(代码：2226002.IB)，期末持仓数量300768.5, 期末价格100.06，标的资产类别债券；报告期内投资工行承销的21中盈万家3A2_bc(代码：2189209.IB)，期末持仓数量1357013.91, 期末价格101.28，标的资产类别债券；报告期内投资工行承销的21中信银行永续债(代码：2128017.IB)，期末持仓数量1503842.52, 期末价格106.22，标的资产类别债

券;报告期内投资工行承销的21中金集MTN001(代码:102100753.IB),期末持仓数量1203074.02,期末价格104.35,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21中能GN003(代码:132100170.IB),期末持仓数量451152.76,期末价格100.93,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21中国银行永续债02(代码:2128045.IB),期末持仓数量2120994.3,期末价格101.22,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21中国银行永续债01(代码:2128019.IB),期末持仓数量1503842.52,期末价格105.56,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21中国银行永续债01(代码:2128019.IB),期末持仓数量1109239.22,期末价格105.56,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21中国银行二级01(代码:2128008.IB),期末持仓数量1729418.9,期末价格103.02,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21招商银行永续债(代码:2128047.IB),期末持仓数量10526897.66,期末价格101.1,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21招商银行永续债(代码:2128047.IB),期末持仓数量13634963.37,期末价格101.1,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21邮储银行永续债01(代码:2128011.IB),期末持仓数量751921.26,期末价格103.45,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21邮储银行永续债01(代码:2128011.IB),期末持仓数量554619.61,期末价格103.45,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21邮储银行二级01(代码:2128028.IB),期末持仓数量2218478.43,期末价格102.02,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21川高速MTN005(代码:102100755.IB),期末持仓数量751921.26,期末价格104.47,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21山东国惠MTN002B(代码:102101665.IB),期末持仓数量1363496.34,期末价格101.82,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21三一MTN001(代码:102101031.IB),期末持仓数量388233.73,期末价格103.6,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21浦鑫安居2A2(代码:2189551.IB),期末持仓数量2738244.67,期末价格100.54,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21浦鑫安居2A1(代码:2189550.IB),期末持仓数量446854.15,期末价格100.19,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21农盈汇寓3A3(代码:2189538.IB),期末持仓数量4179911,期末价格100.85,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21农盈汇寓3A2(代码:2189537.IB),期末持仓数量1727929.73,期末价格100.58,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21农盈汇寓3A1(代码:2189536.IB),期末持仓数量1519311.59,期末价格100.18,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21农盈汇寓2A3(代码:2189503.IB),期末持仓数量3591977.56,期末价格101.1,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21农盈汇寓2A2(代码:2189502.IB),期末持仓数量2212976.2,期末价格100.68,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21农盈汇寓2A1(代码:2189501.IB),期末持仓数量1828063.73,期末价格100.2,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21农业银行永续债01(代码:2128038.IB),期末持仓数量11278818.92,期末价格101.91,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21农业银行永续债01(代码:2128038.IB),期末持仓数量5756984.54,期末价格101.91,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21民生银行永续债01(代码:2128016.IB),期末持仓数量2218478.43,期末价格101.27,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21聚盈京能ABN001优先(代码:082101014.IB),期末持仓数量1521519.76,期末价格100.55,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21锦江国际MTN001(代码:102100796.IB),期末持仓数量554619.61,期末价格105.04,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21金地MTN005(代码:102101091.IB),期末持仓数量751921.26,期末价格101.75,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21金地MTN004(代码:102100991.IB),期末持仓数量1109239.22,期末价格101.8,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21交通银行永续债(代码:2128022.IB),期末持仓数量3007685.05,期末价格105.19,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21交通银行二级(代码:2128030.IB),期末持仓数量3007685.05,期末价格102.59,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21建元15A3_bc(代码:2189479.IB),期末持仓数量7579512.19,期末价格101.59,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21建元15A2_bc(代码:2189478.IB),期末持仓数量6698508.75,期末价格100.85,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21建设银行二级01(代码:2128025.IB),期末持仓数量3007685.05,期末价格102.21,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21华为MTN002(代码:102100344.IB),期末持仓数量1503842.52,期末价格101.39,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21华侨城MTN002A(乡村振兴)(代码:102100893.IB),期末持仓数量1164701.18,期末价格104.18,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21广晟MTN001(代码:102100445.IB),期末持仓数量902305.51,期末价格101.94,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21拱墅投发PPN002(代码:032191380.IB),期末持仓数量3029991.86,期末价格101.66,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21戴姆勒财PPN004BC(代码:032100573.IB),期末持仓数量1663858.82,期末价格103.34,标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21大唐集MTN006(代码:102102138.IB),期末持仓数量1503842.52,期末价

格102.15, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21川高速MTN005(代码: 102100755. IB), 期末持仓数量1127881.89, 期末价格104.47, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21成渝高速MTN001(代码: 102100999. IB), 期末持仓数量831929.41, 期末价格103.67, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的21奔驰汽车债02(代码: 2122035. IB), 期末持仓数量2255763.78, 期末价格103.97, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的20中核MTN002(代码: 102002011. IB), 期末持仓数量499157.65, 期末价格102.2, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的20中国银行二级01(代码: 2028038. IB), 期末持仓数量3007685.05, 期末价格105.31, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的20邮储银行永续债(代码: 2028006. IB), 期末持仓数量1879803.15, 期末价格101.4, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的20浦发银行永续债(代码: 2028051. IB), 期末持仓数量1579034.65, 期末价格106.02, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的20浦发银行二级01(代码: 2028025. IB), 期末持仓数量1691822.84, 期末价格104.38, 标的资产类别债券;报告期内投资中国工商银行交易的20京能电力MTN001(代码: 102001636. IB), 期末持仓数量2481340.16, 期末价格104.23, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的20交通银行二级(代码: 2028018. IB), 期末持仓数量2255763.78, 期末价格103.03, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的20汇丰银行02(代码: 2026003. IB), 期末持仓数量757497.97, 期末价格103.21, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的20光穗南电ABN001优先(代码: 082001001. IB), 期末持仓数量2248601.11, 期末价格101.67, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的20光大银行永续债(代码: 2028037. IB), 期末持仓数量1879803.15, 期末价格106.24, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的20工银租赁债02(代码: 2022048. IB), 期末持仓数量277309.8, 期末价格102.9, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的20宝武集团MTN001(代码: 102001052. IB), 期末持仓数量1969494.71, 期末价格101.65, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的19中核MTN005A(代码: 101901633. IB), 期末持仓数量277309.8, 期末价格101.99, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的19中国银行二级03(代码: 1928033. IB), 期末持仓数量1353458.27, 期末价格103.8, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的19西永PPN002(代码: 031900721. IB), 期末持仓数量454498.78, 期末价格102.96, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的19平安银行二级(代码: 1928010. IB), 期末持仓数量1729418.9, 期末价格107.26, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的19农业银行永续债02(代码: 1928023. IB), 期末持仓数量751921.26, 期末价格104.81, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的19农业银行永续债01(代码: 1928021. IB), 期末持仓数量1503842.52, 期末价格105.52, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的19交通银行永续债(代码: 1928025. IB), 期末持仓数量1052689.77, 期末价格104.66, 标的资产类别债券;报告期内投资工行承销的19海通恒信PPN002(代码: 031900472. IB), 期末持仓数量2272493.9, 期末价格104.17, 标的资产类别债券;