

## 工银理财·恒睿睿盈私银尊享540天持盈混合类开放式理财产品 (21HH6887) 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·恒睿睿盈私银尊享540天持盈混合类开放式理财产品
产品代码	21HH6887
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07月23日
产品到期日	--
开放日	封闭期过后每个工作日为开放日，首个开放日为2021年8月30日。
开放时间	开放日的9:00至17:00为开放时间
购买、赎回方式	本理财产品采用金额申购、份额赎回的原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。
业绩比较基准	本产品业绩比较基准（年化）为4.30%，业绩比较基准由投资管理人依据理财产品的投资范围及比例、投资策略，并综合考量市场环境等因素测算，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。
托管费率（年）	0.02%
销售手续费率（年）	0.30%
杠杆水平	106.56%
产品托管人	工商银行重庆分行
报告期末理财产品份额	283,059,862.83

### 3、产品净值表现

截至2022年3月31日，产品净值为0.9735，累计净值为0.9735，产品资产净值为275550616.67元。

### 4、市场情况及产品运作回顾

#### 4.1、市场回顾

债券市场方面，一季度债市总体小幅下跌。其中，一季度中债总全价指数下跌0.29%，中债银行间国债全价指数上涨0.19%，中债企业债总全价指数下跌0.12%。在收益率曲线上，一季度收益率曲线走势略平坦化。其中，一季度10年期国债收益率从2.78%上行1.24bp至2.79%，10年期金融债（国开）收益率从3.08%回落4.46bp至3.04%。权益市场方面，2022年一季度，市场大幅下跌后反弹。上证综指下跌10.65%，创业板指下跌19.96%。在中信30个一级行业中，煤炭、房地产和银行业涨幅居前。电子、国防军工和汽车行业表现相对落后。

#### 4.2、操作回顾

固定收益投资方面，投资管理人保持合适的久期和杠杆比例，积极参与波段投资机会，优化配置结构，重点配置中短期限利率债和高等级信用债，合理分配类属资产比例。权益投资方面采用“自上而下”的分析方法，分析宏观经济的发展趋势，判断当前所处的经济周期阶段和货币政策变化的趋势，并利用当前股票市场的估值状况与国债收益率、利率变化趋势判断股票市场的估值合理程度，然后进行权益类资产与债券类资产、现金等大类资产之间的战略性配置。

#### 4.3、下一步投资策略

投资管理人将积极进行市场研判，调降组合久期，规避利率风险，增大估值稳定的资产投资力度，稳定产品净值，对含权产品，继续坚守绝对收益理念，注重产品持有期体验，测算权益资产比例中枢，灵活调整持仓结构，严控净值回撤。

#### 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24.19%，间接投资的比例为75.81%。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82.09%、权益类0.00%、商品及衍生品类1.75%、公募基金16.16%。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3891328.96元，占产品总资产1.33%，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

序号	资产种类	占投资组合的比例 (%)
※	固定收益类	86.42%
	货币类	28.24%
	债券类	58.18%
※	商品及金融衍生品类	1.33%
	衍生品类	1.33%
※	基金	12.25%
	公募基金	12.25%
合计		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	90612724.45	32.88%
2	国信证券稳1号集合资产管理计划	75752390.68	27.49%
3	21HH6887存上海0331	42000000.00	15.24%
4	中信期货工银量化精选1号	38218546.94	13.87%
5	活期存款	29003268.78	10.52%

##### 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

本产品所持大部分投资品具有良好流动性，可在证券交易所或者银行间同业市场交易，组合整体变现能力较好。

#### 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新蓝筹股票A(证券代码：001651.OF)，期末持仓数量为96940.09,期末价格为2.5,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新金融股票(证券代码：001054.OF)，期末持仓数量

为136894.32,期末价格为2.84,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稳健成长混合A(证券代码:481004.OF),期末持仓数量为785470.5,期末价格为1.21,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美丽城镇股票A(证券代码:001043.OF),期末持仓数量为451373.93,期末价格为2.64,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量化策略混合(证券代码:481017.OF),期末持仓数量为160476.69,期末价格为3.71,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精选平衡混合(证券代码:483003.OF),期末持仓数量为784049.46,期末价格为0.62,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大盘蓝筹混合(证券代码:481008.OF),期末持仓数量为160143.31,期末价格为1.19,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以下债券:22邮储银行永续债01(证券代码:2228001.IB),期末持仓数量为678968.63,期末价格为99.81,标的资产类别为债券;报告期内投资于22农业银行永续债01(证券代码:2228011.IB),期末持仓数量为678968.63,期末价格为99.53,标的资产类别为债券;报告期内投资于22农业银行永续债01(证券代码:2228011.IB),期末持仓数量为497446.4,期末价格为99.53,标的资产类别为债券;报告期内投资于22华商银行01(证券代码:2226002.IB),期末持仓数量为54317.49,期末价格为100.06,标的资产类别为债券;报告期内投资于21中盈万家3A2\_bc(证券代码:2189209.IB),期末持仓数量为1217125.54,期末价格为101.28,标的资产类别为债券;报告期内投资于21中信银行永续债(证券代码:2128017.IB),期末持仓数量为271587.45,期末价格为106.22,标的资产类别为债券;报告期内投资于21中金集MTN001(证券代码:102100753.IB),期末持仓数量为217269.96,期末价格为104.35,标的资产类别为债券;报告期内投资于21中节能GN003(证券代码:132100170.IB),期末持仓数量为81476.24,期末价格为100.93,标的资产类别为债券;报告期内投资于21中国银行永续债01(证券代码:2128019.IB),期末持仓数量为271587.45,期末价格为105.56,标的资产类别为债券;报告期内投资于21中国银行永续债01(证券代码:2128019.IB),期末持仓数量为994892.81,期末价格为105.56,标的资产类别为债券;报告期内投资于21中国银行二级01(证券代码:2128008.IB),期末持仓数量为312325.57,期末价格为103.02,标的资产类别为债券;报告期内投资于21招商银行永续债(证券代码:2128047.IB),期末持仓数量为1901112.18,期末价格为101.1,标的资产类别为债券;报告期内投资于21邮储银行永续债01(证券代码:2128011.IB),期末持仓数量为135793.73,期末价格为103.45,标的资产类别为债券;报告期内投资于21邮储银行永续债01(证券代码:2128011.IB),期末持仓数量为497446.4,期末价格为103.45,标的资产类别为债券;报告期内投资于21邮储银行二级01(证券代码:2128028.IB),期末持仓数量为1989785.61,期末价格为102.02,标的资产类别为债券;报告期内投资于21川高速MTN005(证券代码:102100755.IB),期末持仓数量为135793.73,期末价格为104.47,标的资产类别为债券;报告期内投资于21三一MTN001(证券代码:102101031.IB),期末持仓数量为348212.48,期末价格为103.6,标的资产类别为债券;报告期内投资于21浦鑫安居2A2(证券代码:2189551.IB),期末持仓数量为494515.14,期末价格为100.54,标的资产类别为债券;报告期内投资于21浦鑫安居2A1(证券代码:2189550.IB),期末持仓数量为80699.93,期末价格为100.19,标的资产类别为债券;报告期内投资于21农盈汇寓3A3(证券代码:2189538.IB),期末持仓数量为754873.84,期末价格为100.85,标的资产类别为债券;报告期内投资于21农盈汇寓3A2(证券代码:2189537.IB),期末持仓数量为312056.63,期末价格为100.58,标的资产类别为债券;报告期内投资于21农盈汇寓3A1(证券代码:2189536.IB),期末持仓数量为274381.1,期末价格为100.18,标的资产类别为债券;报告期内投资于21农盈汇寓2A3(证券代码:2189503.IB),期末持仓数量为648695.61,期末价格为101.1,标的资产类别为债券;报告期内投资于21农盈汇寓2A2(证券代码:2189502.IB),期末持仓数量为399653.93,期末价格为100.68,标的资产类别为债券;报告期内投资于21农盈汇寓2A1(证券代码:2189501.IB),期末持仓数量为330140.4,期末价格为100.2,标的资产类别为债券;报告期内投资于21农业银行永续债01(证券代码:2128038.IB),期末持仓数量为2036905.9,期末价格为101.91,标的资产类别为债券;报告期内投资于21民生银行永续债01(证券代码:2128016.IB),期末持仓数量为1989785.61,期末价格为101.27,标的资产类别为债券;报告期内投资于21聚盈京能ABN001优先(证券代码:082101014.IB),期末持仓数量为274779.89,期末价格为100.55,标的资产类别为债券;报告期内投资于21锦江国际MTN001(证券代码:102100796.IB),期末持仓数量为497446.4,期末价格为105.04,标的资产类别为债券;报告期内投资于21金地MTN005(证券代码:102101091.IB),期末持仓数量为135793.73,期末价格为101.75,标的资产类别为债券;报告期内投资于21金地MTN004(证券代码:102100991.IB),期末持仓数量为994892.81,期末价格为101.8,标的资产类别为债券;报告期内投资于21交通银行永续债(证券代码:2128022.IB),期末持仓数量为543174.91,期末价格为105.19,标的资产类别为债券;报告期内投资于21交通银行二级(证券代码:2128030.IB),期末持仓数量为543174.91,期末价格为102.59,标的资产类别为债券;报告期内投资于21

建设银行二级01(证券代码: 2128025. IB), 期末持仓数量为543174. 91, 期末价格为102. 21, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于21华为MTN002(证券代码: 102100344. IB), 期末持仓数量为271587. 45, 期末价格为101. 39, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于21华侨城MTN002A(乡村振兴)(证券代码: 102100893. IB), 期末持仓数量为1044637. 45, 期末价格为104. 18, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于21广晟MTN001(证券代码: 102100445. IB), 期末持仓数量为162952. 47, 期末价格为101. 94, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于21戴姆勒财PPN004BC(证券代码: 032100573. IB), 期末持仓数量为1492339. 21, 期末价格为103. 34, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于21大唐集MTN006(证券代码: 102102138. IB), 期末持仓数量为271587. 45, 期末价格为102. 15, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于21川高速MTN005(证券代码: 102100755. IB), 期末持仓数量为203690. 59, 期末价格为104. 47, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于21成渝高速MTN001(证券代码: 102100999. IB), 期末持仓数量为746169. 61, 期末价格为103. 67, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于21奔驰汽车债02(证券代码: 2122035. IB), 期末持仓数量为407381. 18, 期末价格为103. 97, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于20中核MTN002(证券代码: 102002011. IB), 期末持仓数量为447701. 76, 期末价格为102. 2, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于20中国银行二级01(证券代码: 2028038. IB), 期末持仓数量为543174. 91, 期末价格为105. 31, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于20邮储银行永续债(证券代码: 2028006. IB), 期末持仓数量为339484. 32, 期末价格为101. 4, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于20浦发银行永续债(证券代码: 2028051. IB), 期末持仓数量为285166. 83, 期末价格为106. 02, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于20浦发银行二级01(证券代码: 2028025. IB), 期末持仓数量为305535. 89, 期末价格为104. 38, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于中国工商银行交易的20京能电力MTN001(证券代码: 102001636. IB), 期末持仓数量为448119. 3, 期末价格为104. 23, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于20交通银行二级(证券代码: 2028018. IB), 期末持仓数量为407381. 18, 期末价格为103. 03, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于20光德南电ABN001优先(证券代码: 082001001. IB), 期末持仓数量为2016803. 09, 期末价格为101. 67, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于20光大银行永续债(证券代码: 2028037. IB), 期末持仓数量为339484. 32, 期末价格为106. 24, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于20工银租赁债02(证券代码: 2022048. IB), 期末持仓数量为248723. 2, 期末价格为102. 9, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于19中核MTN005A(证券代码: 101901633. IB), 期末持仓数量为248723. 2, 期末价格为101. 99, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于19中国银行二级03(证券代码: 1928033. IB), 期末持仓数量为244428. 71, 期末价格为103. 8, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于19平安银行二级(证券代码: 1928010. IB), 期末持仓数量为312325. 57, 期末价格为107. 26, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于19农业银行永续债02(证券代码: 1928023. IB), 期末持仓数量为135793. 73, 期末价格为104. 81, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于19农业银行永续债01(证券代码: 1928021. IB), 期末持仓数量为271587. 45, 期末价格为105. 52, 标的资产类别为债券; 报告期内投资于19交通银行永续债(证券代码: 1928025. IB), 期末持仓数量为190111. 22, 期末价格为104. 66, 标的资产类别为债券。