

“丁香花理财智赢定开净值型 01 号 11 期(24 个月)” 定期报告

产品管理人：哈尔滨银行

产品托管人：招商银行

发布时间：2021 年 09 月 30 日

1 重要提示

产品的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本产品说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

2 产品概况

产品名称	丁香花理财智赢定开净值型 01 号 11 期(24 个月)
产品编码	DXH20706
全国银行业理财信息登记系统编码	C1085520000036
产品运作方式	开放式净值型
产品类型	固定收益类
募集方式	公募
报告期末产品份额总额	175,069,700.00
业绩比较基准	4.50%-5.50%
产品管理人	哈尔滨银行

3 主要财务指标和产品净值表现

3.1 主要财务指标

(单位：元)

主要财务指标	报告期(2021 年 07 月 01 日-2021 年 09 月 30 日)
1. 本期已实现收益	1,582,980.89
2. 本期利润	2,204,508.13
3. 期末产品资产净值	187,401,560.02

4. 期末产品份额净值	1.07044
5. 期末产品份额累计净值	1.07044

注：所述产品业绩指标不包括持有人认购或交易产品的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4 投资组合报告

4.1 报告期末产品资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占产品总资产的比例（%）
1	固定收益投资	151,919,922.68	80.51%
	其中：债券	126,339,430.00	66.95%
	非标资产	0.00	0.00%
2	基金投资	10,341,017.60	5.48%
3	权益投资	1,565,759.88	0.83%
4	金融衍生品投资	0.00	0.00%
5	买入返售金融资产	20,000,000.00	10.60%
	其中：买断式回购	0.00	0.00%
6	银行存款合计	3,212,592.16	1.70%
7	其他资产	1,662,978.75	0.88%
	其中：应计利息/应收利息	1,662,978.75	0.88%
8	合计	188,702,271.07	100.00%

4.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	金额（元）	占产品资产净值比例（%）
1	国家债券	9,396,945.00	5.01%
2	央行票据	0.00	0.00%
3	金融债券	25,069,135.00	13.38%
	其中：政策性金融债	0.00	0.00%
4	企业债券	91,873,350.00	49.02%
5	企业短期融资券	0.00	0.00%
6	可转债	0.00	0.00%
7	其他	0.00	0.00%

8	合计	126,339,430.00	67.41%
---	----	----------------	--------

序号	资产代码	资产名称	数量	市值(元)	占产品资产净值比例(%)
1	102001097	20 渝兴永 MTN001	150,000.00	15,266,745.00	8.15%
2	032000826	20 长春润德 PPN002	150,000.00	15,200,265.00	8.11%
3	101901126	19 德感工业 MTN001	150,000.00	15,106,890.00	8.06%
4	SZ115103	19 一创 C1	150,000.00	15,089,955.00	8.05%
5	SZ149233	20 长新 03	150,000.00	14,958,930.00	7.98%
6	101900358	19 南川惠农 MTN001	140,000.00	14,169,400.00	7.56%
7	1780387	17 南通开元债	150,000.00	12,192,405.00	6.51%
8	921023	中金启赢 1 号集合资产管理计划	9,928,514.69	10,778,395.55	5.75%
9	AD8610	安信证券优选 1 号集合资产管理计划	9,992,006.39	10,641,486.81	5.68%
10	003363	鹏华兴泰定期开放灵活配置混合型证券投资基金	6,820,351.93	10,341,017.60	5.52%

4.4 报告期末投资组合流动性风险分析

流动性资产市值(元)	产品资产净值(元)	流动性资产占比(%)
12,741,091.26	187,401,560.02	6.80%

报告期内，产品管理人通过合理安排资产配置结构，保持一定比例的高流动性资产，控制资产久期、杠杆融资比例，管控产品流动性风险。持仓中利率债、同业存单及高等级信用债占比较高，对于关键时点的规模变动和资金面波动都有充足的准备，且融资渠道畅通多元，风险总体可控。

5. 托管人报告

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

特此公告。

2021年09月30日

