

“丁香花理财智赢定开净值型 12 号 03 期”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 12 号 03 期
产品编码	DXH20703
全国银行业理财信息登记系统编码	C1085519000479
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	339,318,400.00
业绩比较基准	4.05%-4.80%
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	1,456,629.48
2. 本期利润	4,069,723.97
3. 期末产品资产净值	347,838,604.32

4. 期末产品份额净值	1.02511
5. 期末产品份额累计净值	1.07217

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	329,392,980.96	93.74%
	其中：债券	220,225,082.04	62.67%
	非标资产	0.00	0.00%
2	基金投资	0.00	0.00%
3	权益投资	0.00	0.00%
4	金融衍生品投资	0.00	0.00%
5	买入返售金融资产	0.00	0.00%
	其中：买断式回购	0.00	0.00%
6	银行存款合计	16,652,941.07	4.74%
7	其他资产	5,353,177.56	1.52%
	其中：应计利息/应收利息	5,353,177.56	1.52%
8	合计	351,399,099.59	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	0.00	0.00%
2	央行票据	0.00	0.00%
3	金融债券	19,983,855.04	5.75%
	其中：政策性金融债	19,983,855.04	5.75%
4	企业债券	200,241,227.00	57.57%
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	220,225,082.04	63.32%
---	----	----------------	--------

4.3 报告期末按市值占产品资产净值比例大小排名的前十名资产投资明细

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	ZRZQJX3	中融基金-债券精选3号集合资产管理计划	48,261,253.31	52,764,028.24	15.17%
2	ZRZQJX2	中融基金-债券精选2号集合资产管理计划	29,270,135.02	31,664,432.06	9.10%
3	102002222	20大庆城投MTN003	300,000.00	29,024,850.00	8.34%
4	102001301	20大庆城投MTN002	290,000.00	28,601,279.00	8.22%
5	SS177454	20眉资03	270,000.00	27,651,645.00	7.95%
6	SS167717	20资开03	250,000.00	24,934,925.00	7.17%
7	ZRZQJX1	中融基金-债券精选1号集合资产管理计划	22,682,166.15	24,739,438.62	7.11%
8	032000642	20铜梁金龙PPN001	200,000.00	20,246,800.00	5.82%
9	SS166387	20复地F1	200,000.00	19,988,720.00	5.75%
10	210201	21国开01	200,000.00	19,983,855.04	5.75%

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(%)
36,970,990.10	347,838,604.32	10.63%

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

