

哈尔滨银行-丁香花理财睿赢3个月01号 2021年第3季度报告

产品管理人：哈尔滨银行股份有限公司

产品托管人：招商银行股份有限公司

重要提示

产品托管人招商银行股份有限公司根据《商业银行理财业务监督管理办法》规定，复核了本报告中的产品收益表现、主要财务指标、投资组合情况等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

产品管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用理财资产，但不保证一定盈利。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的发行文件。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021-07-01 起 2021-09-30 止。

1、产品基本情况

项目	信息
产品名称	哈尔滨银行-丁香花理财睿赢 3 个月 01 号
产品登记编码	C1085520000376
产品管理人	哈尔滨银行股份有限公司
产品托管人	招商银行股份有限公司
产品运作方式	公募开放式净值型（固定收益非保本浮动收益类）
产品成立日	2020-12-25
产品到期日	2099-12-31
报告期末产品份额总额	5,273,797,567.93
业绩比较基准（如有）	[3.6%-4.3%]/年
估值方法	市值法

2、主要财务指标及产品收益情况

金额单位：元

项目	2021-07-01 至 2021-09-30
本期已实现收益	66,223,744.28
本期利润	63,191,903.60
期末产品资产净值	5,466,072,059.16
期末产品份额净值	1.0365

3、投资组合情况及流动性风险分析

3.1 期末资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	直接投资	
		金额	占产品总资产的比例 (%)
1	权益投资	0.00	0.00
	其中：普通股	0.00	0.00
	存托凭证		
2	基金投资	0.00	0.00
3	固定收益投资	6,255,346,212.93	92.17
	其中：债券	6,255,346,212.93	92.17
	资产支持证券	0.00	0.00
4	金融衍生品投资	0.00	0.00
	其中：远期		
	期货		
	期权	0.00	0.00
	权证		
5	买入返售金融资产	10,000,000.00	0.15
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
6	货币市场工具		
7	银行存款和结算备付金合计	382,771,764.10	5.64
8	拆放同业	0.00	0.00
9	资管产品	0.00	0.00
10	其他资产	138,757,985.26	2.04
	合计	6,786,875,962.29	100.00

3.2 投资组合流动性风险分析

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。

3.3 报告期末占资产净值比例大小排序的前十项资产明细

金额单位：元

序号	资产名称	金额	占产品资产净值比例(%)
1	17 汉口银行二级	110,629,200.00	2.02
2	20 川能投 MTN003	81,711,680.00	1.49
3	19 武纾 01	81,013,280.00	1.48
4	17 盐城资产 MTN001	80,622,480.00	1.47
5	19 桂投 01	80,183,600.00	1.47
6	18 联投 Y1	70,084,490.00	1.28
7	21 国债 01	70,058,800.00	1.28
8	18 城发 01	69,949,530.00	1.28
9	20 中节能 MTN003	61,012,260.00	1.12
10	20 启东 02	60,793,560.00	1.11

注：前十项资产明细仅包含证券投资、场外投资，不包含银行存款、存出保证金、清算备付金、应收利息等资产。

4、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。

哈尔滨银行股份有限公司

2021-10-15