

丁香花理财睿赢 18 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	丁香花理财睿赢 18 个月 01 号
产品登记编码	C1085520000381
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	2021-01-27
产品到期日	2099-12-31
报告期末产品份额总额	5,894,486,492.67
业绩比较基准（如有）	[4.2%-6.2%]/年
估值方法	市值法

1、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	12,080,218.00
本期利润	51,340,925.72
期末产品资产净值	6,105,003,812.12
期末产品份额净值	1.0357

2、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		间接投资	
		金额	占产品总资产的比例 (%)	金额	占产品总资产的比例 (%)
1	权益投资	0.00	0.00	0.00	0.00
	其中：普通股	0.00	0.00	0.00	0.00
	存托凭证				
2	基金投资	24,623,879.34	0.40	0.00	0.00
3	固定收益投资	5,800,800,137.6	94.95	0.00	0.00
	其中：债券	1,553,887,500.42	25.44	0.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00	0.00	0.00
4	金融衍生品投资	0.00	0.00	0.00	0.00
	其中：远期				
	期货				
	期权	0.00	0.00	0.00	0.00
	权证				
5	买入返售金融资产	110,000,000.00	1.80	0.00	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00
6	货币市场工具				
7	银行存款和结算备付金合计	8,133,674.11	0.13	0.00	0.00
8	拆放同业	0.00	0.00	0.00	0.00
9	资管产品	144,062,920.69	2.36	0.00	0.00
10	其他资产	21,454,605.42	0.35	0.00	0.00
	合计	6,109,075,217.16	100.00	0.00	0.00

注 1：间接投资占产品总资产的比例（%）为占本产品总资产的比例（%）。

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	创金合信汇盈 169 号	1,438,677,976.60	23.57
2	华润信托·富赢 1 号	1,170,154,804.51	19.17
3	中金启赢 1 号集合资产管理计划	596,237,608.81	9.77
4	中融基金-债券精选 1 号集合资产管理	502,866,166.43	8.24
5	安信证券优选 1 号集合资产管理计划	278,333,889.17	4.56
6	中融基金-债券精选 2 号集合资产管理	260,642,191.66	4.27
7	21 天风 C1	199,970,410.96	3.28
8	泰康资产-FOF 进取 2 号	144,062,920.69	2.36
9	17 大连银行二级	119,750,160.00	1.96
10	19 德感工业 MTN001	100,712,600.00	1.65

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。

3、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