

工银理财·恒睿平衡私银尊享(湖北优享)混合类产品(20HH6807) (20HH6807) 2020年上半年半年报

1、重要提示

无

2、理财产品概况

产品名称	工银理财·恒睿平衡私银尊享(湖北优享)混合类产品(20HH6807)
产品代码	20HH6807
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	2020年02月18日
产品到期日	2022年05月23日
业绩比较基准	业绩比较基准 本产品为净值型产品，其业绩表现将随市场波动，具有不确定性。本产品业绩比较基准为5%（年化），该业绩比较基准仅作为计算浮动管理费的依据，不构成工银理财对该理财产品的任何收益承诺
托管费率（年）	0.02%
销售手续费率（年）	0.00%
杠杆水平	100%
产品托管人	工商银行广东省分行营业部
报告期末理财产品份额	505,270,000.00

3、产品净值表现

截至2020年6月30日，产品净值为1.0563，累计净值为1.0563，产品资产净值533707602.29，产品年化收益率为15.34%，超过业绩基准

4、市场情况及产品运作回顾

4.1、市场回顾

市场方面，2020年上半年市场大幅波动，十年期国债中债估值到期收益率3.14%下行至2.59%，又上行至2.96%；A股方面市场结构分化，上证综指微跌2.19%，创业板指则上涨35.6%。

4.2、操作回顾

根据市场波动情况，及时调整产品内资产持仓，运用量化对冲、多资产投资等策略减少净值波动。

4.3、下一步投资策略

结合国内经济修复情况，把握债市和股市的市场波动机会，在市场调整时应用量化对冲等方式降低市场波动，配置多种大类资产，降低风险。

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36.38%，间接投资的比例为63.62%。其中直接投资中固收类100%；间接投资中固收类57.31%、权益类33.73%、商品及衍生品类8.96%。

5.2 投资组合基本情况

序号	资产种类	占投资组合的比例(%) 期末	占投资组合的比例(%) 期初
※	固定收益类	78.34%	--
	货币类	36.38%	--
	债券类	41.96%	--
※	混合类资产	21.66%	--

	对冲基金类	10.05%	--
	混合基金类	11.61%	--
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	国信证券稳1号集合资产管理计划	135335714.39	25.33%
2	20HH6807存北京7天	100000000.00	18.72%
3	活期存款	94379740.45	17.66%
4	中信期货工银量化精选1号	88858000.00	16.63%
5	工银量化永安国富1期	53710000.00	10.05%
6	东证工银量化宏观配置3号资产管理计划	33444000.00	6.26%
7	光大期货多策略2号集合资产管理计划	28602500.00	5.35%

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

本产品投资的债券、权益和商品及衍生品类资产均可在二级市场变现。

6、其他重要信息

报告期内投资于腾讯控股有限公司发行的腾讯控股(证券代码: 0700.HK), 交易数量为7599.89, 单位价格为498.6, 标的资产类别为股票
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的中信转债(证券代码: 113021.SH), 交易数量为1249.62, 单位价格为100, 标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的海印转债(证券代码: 127003.SZ), 交易数量为539.88, 单位价格为100, 标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的北方转债(证券代码: 127014.SZ), 交易数量为597.19, 单位价格为100, 标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的奥瑞转债(证券代码: 128096.SZ), 交易数量为625.6, 单位价格为100, 标的资产类别为债券
 报告期内投资于中国工商银行有限公司发行的工商银行(证券代码: 1398.HK), 交易数量为827605.85, 单位价格为4.7, 标的资产类别为股票
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19融和02(证券代码: 151621.SH), 交易数量为16478.83, 单位价格为100, 标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19首钢02(证券代码: 151857.SH), 交易数量为54929.44, 单位价格为100, 标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19延长Y3(证券代码: 155871.SH), 交易数量为20593.47, 单位价格为100, 标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19常城03(证券代码: 162026.SH), 交易数量为27464.72, 单位价格为100, 标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19华通01(证券代码: 162700.SH), 交易数量为27464.72, 单位价格为100, 标的资产类别为债券
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的20津投03(证券代码: 163146.SH), 交易数

量为21971.78,单位价格为100,标的资产类别为债券
报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的20津资D1(证券代码:166148.SH),交易数量为27464.72,单位价格为100,标的资产类别为债券
报告期内投资于华夏基金管理有限公司发行的华夏中证5G通信主题ETF(证券代码:515050.SH),交易数量为256828.02,单位价格为1.281,标的资产类别为基金
报告期内投资于中国工商银行股份有限公司发行的工商银行(证券代码:601398.SH),交易数量为730300.62,单位价格为4.98,标的资产类别为股票
报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19江控02(证券代码:151670.SH),交易数量为27464.72,单位价格为100,标的资产类别为债券
报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的小康转债(证券代码:113016.SH),交易数量为83.06,单位价格为100,标的资产类别为债券
报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的顺丰转债(证券代码:128080.SZ),交易数量为59.8,单位价格为100,标的资产类别为债券