

工银理财·恒睿平衡私银尊享混合类产品(20HH6810) (20HH6810) 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·恒睿平衡私银尊享混合类产品(20HH6810)
产品代码	20HH6810
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27日
产品到期日	2022年09月13日
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4.85%（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）	0.30%
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	121,034,000.00

3、产品净值表现

截至2020年6月30日，产品净值为1.0318，累计净值为1.0318，产品资产净值124877997.01，产品年化收益率为9.29%，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，把握市场波动机会，稳健提升产品收益。

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4.31%，间接投资的比例为95.69%。其中直接投资中固收类100%；间接投资中固收类77.85%、权益类19.54%、商品及衍生品类2.61%。

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	91.17%	--
	货币类	4.31%	--
	债券类	86.86%	--
※	混合类资产	8.83%	--
	混合基金类	8.83%	--
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	75985000.00	60.69%
2	中信期货工银量化精选1号	32764940.22	26.17%
3	光大期货多策略2号集合资产管理计划	11053038.36	8.83%
4	活期存款	5397512.29	4.31%

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193263.01, 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9252.13, 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30840.44, 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常城03(证券代码: 162026.SH), 交易数量为15420.22, 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15420.22, 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12336.18, 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15420.22, 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股份有限公司发行的工商银行(证券代码: 601398.SH), 交易数量为181407.49, 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15420.22, 单位价格为100, 标的资产类别为债券