

## 工银理财·恒睿私银尊享(私银嘉年华)混合封闭净值型产品20HH6815 (20HH6815) 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·恒睿私银尊享(私银嘉年华)混合封闭净值型产品20HH6815
产品代码	20HH6815
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04月07日
产品到期日	2021年11月22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5.0%（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）	0.10%
杠杆水平	100%
产品托管人	工商银行深圳分行
报告期末理财产品份额	983,794,000.00

### 3、产品净值表现

截至2020年6月30日，产品净值为1.0434，累计净值为1.0434，产品资产净值1026473182.58，产品年化收益率为18.64%，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51.21%，间接投资的比例为48.79%。其中直接投资中固收类100%；间接投资中固收类40.36%、权益类49.6%、商品及衍生品类10.04%。

#### 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	73.32%	--
	货币类	34.16%	--
	债券类	22.11%	--
	非标准化债权类	17.05%	--

※	混合类资产	26.68%	--
	对冲基金类	4.03%	--
	混合基金类	22.65%	--
合计		100%	--

### 5.3 产品投资前十项资产明细

序号	资产名称	规模	规模占比 (%)
1	20HH6815存深圳7天	300000000.00	29.19%
2	中信期货灵活配置1号集合资产管理计划	218175585.43	21.23%
3	2020年上饶投资5亿元直投	175199305.56	17.05%
4	中信期货工银量化精选1号	120371670.91	11.71%
5	创金合信金泰1号	106900220.29	10.40%
6	活期存款	51051648.50	4.97%
7	东证期货工银慧享二号集合资产管理计划	41468235.59	4.03%
8	东证工银量化宏观配置3号资产管理计划	14635042.89	1.42%

### 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 (%)
1	上饶投资控股集团有限公司	2020年上饶投资5亿元直投	8	4.10%	理财计划直接投资(债权类)	否	17.05%

### 5.7 投资组合流动性风险分析

本产品投资的非标债权到期日早于产品到期日，期限匹配；其他债券、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

报告期内投资于华夏基金管理有限公司发行的华夏复兴股票(证券代码：000031.OF)，交易数量为479783.27,单位价格为2.96,标的资产类别为基金  
 报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的核建转债(证券代码：113024.SH)，交易数量为13949.77,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15首开01(证券代码：125787.SH)，交易数量为57643.69,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18中油EB(证券代码：132015.SH)，交易数量为36027.31,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16中铁建(证券代码：135495.SH)，交易数量为28821.85,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16中船01(证券代码：136774.SH)，交易数量为7237.17,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3529829.98,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18首置01(证券代码:143812.SH),交易数量为21616.39,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18首业02(证券代码:150279.SH),交易数量为50438.23,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18首业04(证券代码:150541.SH),交易数量为25219.12,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中粮01(证券代码:155123.SH),交易数量为21616.39,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9011.67,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05(证券代码:162506.SH),交易数量为14410.92,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112387.55,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1298534.69,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包钢01(证券代码:151837.SH),交易数量为14410.92,单位价格为100,标的资产类别为债券