

工银理财·恒睿平衡三年封闭净值型理财产品私银2019第2号 (19HH6801) 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·恒睿平衡三年封闭净值型理财产品私银2019第2号
产品代码	19HH6801
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	2019年12月11日
产品到期日	2022年12月06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4.1%-4.65%（年化），该业绩比较基准仅作为计算浮动管理费的依据，不构成工银理财有限责任公司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	中国工商银行总行
报告期末理财产品份额	14,334,000.00

3、产品净值表现

截至2020年6月30日，产品净值为1.0837，累计净值为1.0837，产品资产净值15533421.93，产品年化收益率为15.05%，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，适时调整产品持仓，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22.18%，间接投资的比例为77.82%。其中直接投资中固收类100%；间接投资中固收类54.78%、权益类39.57%、商品及衍生品类5.65%。

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	56.01%	--
	货币类	22.18%	--
	债券类	33.83%	--
※	混合类资产	43.99%	--
	混合基金类	43.99%	--

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	光大期货多策略2号集合资产管理计划	6864700.11	43.99%
2	活期存款	3460148.33	22.18%
3	华泰证券资管工行2号定向资产管理计划	3162000.00	20.26%
4	中信期货工银量化精选2号	2116800.00	13.57%

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承销的19西永PPN002(证券代码: 031900721. IB), 交易数量为324.53, 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海城建设PPN001(证券代码: 032000022. IB), 交易数量为757.25, 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承销的18中色MTN002(证券代码: 101811151. IB), 交易数量为4868.02, 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兴城Y1(证券代码: 114610. SZ), 交易数量为276.84, 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甘公03(证券代码: 114624. SZ), 交易数量为994.88, 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27107.6, 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首业04(证券代码: 151587. SH), 交易数量为216.28, 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甘交01(证券代码: 151641. SH), 交易数量为302.79, 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中企01(证券代码: 151662. SH), 交易数量为216.28, 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兴城01(证券代码: 151673. SH), 交易数量为735.35, 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不动01(证券代码: 151700. SH), 交易数量为432.56, 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首业06(证券代码: 151812. SH), 交易数量为432.56, 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不动02(证券代码: 151822. SH), 交易数量为259.53, 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融和03(证券代码: 151911. SH), 交易数量为43.26, 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04(证券代码: 162283. SH), 交易数

量为129.77,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19晋交03(证券代码:162289.SH),交易数量为475.81,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05(证券代码:162415.SH),交易数量为432.56,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G20FXY3(证券代码:163559.SH),交易数量为648.84,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豫水01(证券代码:167121.SH),交易数量为216.28,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8605.59,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432.56,单位价格为100,标的资产类别为债券