

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年第三季度季报

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09月30日，产品净值为1.1285,累计净值为1.1285,产品资产净值16176483.71,产品年化收益率为15.9%,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年三季度市场宽幅波动，十年期国债中债估值到期收益率2.82%上行至3.15%；A股方面市场整体上涨，上证综指涨7.82%，沪深300指数涨10.17%，创业板指涨5.6%。A股行业板块表现分化，涨幅前三位的中信一级行业为国防军工、消费者服务、电力设备及新能源，跌幅前三位的中信一级行业为通信、商贸零售、综合金融。商品市场方面，上海黄金交易所现货黄金（AU9999）上涨1.4%，南华商品指数上涨0.6%。			
4.2、操作回顾			
结合三季度市场宽幅震荡的情况，根据资产配置方案，做适当的止盈操作，落袋为安，实时监测市场情况，寻找优秀的投资机会，稳健提升产品收益			
4.3、下一步投资策略			
国内经济基本面逐步复苏，下一步将根据产品的最近净值情况，灵活调整大类资产比例，监测市场指标情况，运用多种方式控制回撤。			
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21.34%，间接投资的比例为78.66%。其中直接投资中固收类100%；间接投资中固收类66.55%、权益类30.06%、商品及衍生品类3.39%。			
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	54.05%	40.58%
	货币类	21.34%	25.61%

	债券类	32.71%	14.97%
※	混合类资产	45.95%	59.42%
	混合基金类	45.95%	59.42%
合计		100%	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	7480909.10	45.95%
2	活期存款	3474473.34	21.34%
3	华泰证券资管工行2号定向资产管理计划	3192000.00	19.60%
4	中信期货工银量化精选2号	2134600.00	13.11%

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245.2, 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572.13, 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3678, 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271.87, 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977.04, 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25201.96, 单位价格为4.02, 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212.4, 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297.36, 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212.4, 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722.16, 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424.8, 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424.8, 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254.88, 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19融和03(证券代码: 151911.SH), 交易数量为42.48, 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127.44, 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晋交03(证券代码: 162289.SH), 交易数量为467.28, 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常城05(证券代码: 162415.SH), 交易数量为424.8, 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637.2, 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中航Y1(证券代码: 163661.SH), 交易数量为163.47, 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20豫水01(证券代码: 167121.SH), 交易数量为212.4, 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20汇丰银行02(证券代码: 2026003.IB), 交易数量为408.67, 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8000.62, 单位价格为4.92, 标的资产类别为股票