

工银理财·恒睿私银固定收益类封闭净值型理财产品（20GS6809）（20GS6809）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·恒睿私银固定收益类封闭净值型理财产品（20GS6809）		
产品代码	20GS6809		
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07月16日		
产品到期日	2021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4.0%（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）	0.30%		
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	999,948,000.00		
3、产品净值表现			
截至2020年09月30日，产品净值为1.0022,累计净值为1.0022,产品资产净值1002138248.92,因市场波动导致产品净值年化收益率低于业绩基准			
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			
产品刚成立，根据市场波动情况和产品类型、期限等要素情况进行大类资产配置，逐步配置资产，运用量化策略把握市场投资机会，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55.03%，间接投资的比例为44.97%。其中直接投资中固收类100%；间接投资中固收类84.45%、权益类12.41%、商品及衍生品类3.14%。			
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	88.12%	100.00%

	货币类	55.02%	100.00%
	债券类	33.10%	0.00%
※	混合类资产	11.88%	0.00%
	对冲基金类	11.88%	0.00%
合计		100%	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	20GS6809存浙江9天	400000000.00	39.88%
2	国信证券稳1号集合资产管理计划	251402685.80	25.07%
3	活期存款	151915882.50	15.15%
4	创金合信鼎泰10号资产管理计划	99848513.54	9.96%
5	中信期货工银量化精选1号	80560115.89	8.03%
6	东证期货工银慧享二号集合资产管理计划	19264509.02	1.92%

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

报告期内投资于工银瑞信基金管理有限公司发行的工银金融地产股票(证券代码: 000251.OF),交易数量为323069.79,单位价格为2.393,标的资产类别为基金

报告期内投资于中国工商银行承销的19海通恒信PPN002(证券代码: 031900472.IB),交易数量为22395.15,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19市北高新PPN002(证券代码: 031900818.IB),交易数量为4479.03,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19戴姆勒PPN003BC(证券代码: 031900827.IB),交易数量为14930.1,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宜宾国资PPN002(证券代码: 032000678.IB),交易数量为14930.1,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19光穗节能ABN001优先(证券代码: 081900685.IB),交易数量为19409.13,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20金风科技MTN001(证券代码: 102001672.IB),交易数量为13437.09,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长沙01(证券代码: 135562.SH),交易数量为4479.03,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1047208.17,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2986.02,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融和02(证券代码: 151621.SH),交易数

量为28786.02,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01(证券代码:151673.SH),交易数量为2986.02,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首钢01(证券代码:151749.SH),交易数量为22395.15,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95953.4,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常城03(证券代码:162026.SH),交易数量为47976.7,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1493.01,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47976.7,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38381.36,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电建Y3(证券代码:163957.SH),交易数量为2986.02,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20兴港02(证券代码:166123.SH),交易数量为19409.13,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20津资D1(证券代码:166148.SH),交易数量为47976.7,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02(证券代码:167393.SH),交易数量为8958.06,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上汽通用债(证券代码:2022018.IB),交易数量为10451.07,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578991.5,单位价格为4.92,标的资产类别为股票