

工银理财·恒睿平衡私银尊享混合类产品(20HH6810) (20HH6810) 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09月30日，产品净值为1.0651,累计净值为1.0651,产品资产净值128908264.5,产品年化收益率为10.95%,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			
根据市场波动情况，及时调整产品内资产持仓，运用大类资产配置方案、多资产投资、多策略投资的方式进行灵活调整，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			
结合产品净值情况，结合大类资产配置方案和市场数据，参照产品期限调整产品仓位，在市场低位适当增加低风险资产比例，运用止盈、止损、分散化投资等方式控制回撤			
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4.18%，间接投资的比例为95.82%。其中直接投资中固收类100%；间接投资中固收类78.08%、权益类18.36%、商品及衍生品类3.56%。			
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	90.70%	92.37%
	货币类	4.18%	68.84%

	债券类	86.52%	23.53%
※	混合类资产	9.30%	7.63%
	混合基金类	9.30%	7.63%
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	国信证券稳1号集合资产管理计划	76531000.00	59.09%
2	中信期货工银量化精选1号	35527530.07	27.43%
3	光大期货多策略2号集合资产管理计划	12045213.03	9.30%
4	活期存款	5419857.99	4.18%

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177872.8, 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融和02(证券代码: 151621.SH), 交易数量为8762.92, 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29209.75, 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14604.87, 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华通01(证券代码: 162700.SH), 交易数量为14604.87, 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20津投03(证券代码: 163146.SH), 交易数量为11683.9, 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14604.87, 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166634.46, 单位价格为4.92, 标的资产类别为股票