

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09月30日，产品净值为1.0754，累计净值为1.0754，产品资产净值1057951039.38，产品年化收益率为15.55%，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

根据市场情况，结合大类资产配置方案和市场监测指标变化情况，在风险预算内择机进行操作，适当增加权益资产比例，并结合量化套利、多资产投资策略方式控制产品回撤和波动

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45.21%，间接投资的比例为54.79%。其中直接投资中固收类100%；间接投资中固收类52.49%、权益类40.45%、商品及衍生品类7.06%。

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	67.45%	--

	货币类	28.70%	--
	债券类	22.23%	--
	非标准化债权类	16.52%	--
※	混合类资产	32.55%	--
	对冲基金类	0.22%	--
	混合基金类	32.33%	--
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	中信期货灵活配置1号集合资产管理计划	253563908.65	23.91%
2	20HH6815存浙江9天	200000000.00	18.86%
3	2020年上饶投资5亿元直投	175199305.56	16.52%
4	中信期货工银量化精选1号	130520859.46	12.31%
5	创金合信金泰1号	105195841.55	9.92%
6	活期存款	104267376.67	9.83%
7	光大期货多策略2号集合资产管理计划	54279465.17	5.12%
8	东证工银量化宏观配置3号资产管理计划	34919371.47	3.29%
9	东证期货工银慧享二号集合资产管理计划	2378843.28	0.22%

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	5	4.10%	理财计划直接投资 (债权类)	否	16.52%

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467188,单位价格为2.96,标的资产类别为基金

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3488372.92,单位价格为2.144,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20首钢MTN005(证券代码：102001475.IB)，交易数量为71788.71,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核建转债(证券代码：113024.SH)，交易数量为13898.29,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57430.97, 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35894.36, 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16中铁建(证券代码: 135495.SH), 交易数量为28715.48, 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16中船01(证券代码: 136774.SH), 交易数量为7210.46, 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2873991.59, 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21536.61, 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50252.1, 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18首业04(证券代码: 150541.SH), 交易数量为25126.05, 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21536.61, 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14451.84, 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首钢05(证券代码: 162506.SH), 交易数量为14357.74, 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1036839.55, 单位价格为4.98, 标的资产类别为股票