

工银理财·恒睿私银尊享混合类封闭净值型理财产品（20HH6816）（20HH6816）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·恒睿私银尊享混合类封闭净值型理财产品（20HH6816）		
产品代码	20HH6816		
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05月21日		
产品到期日	2022年10月25日		
业绩比较基准	本产品业绩比较基准为4.8%（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	工商银行上海分行		
报告期末理财产品份额	272,439,000.00		
3、产品净值表现			
截至9月30日，产品净值为1.0678，份额累计净值为1.0678，产品资产净值为290898622.2。			
4、市场情况及产品运作回顾			
4.1、市场回顾			
2020年三季度，国内经济延续复苏趋势，货币政策回归正常化，长短端利率回升。A股市场先扬后抑，七月初大幅反弹，八至九月震荡后小幅回落，指数涨跌分化较大。三季度，上证综指上涨7.82%，沪深300上涨10.17%，中证500上涨5.59%，中小板指上涨8.19%，创业板指上涨5.82%。			
4.2、操作回顾			
2020年三季度，通过量化策略进行大类资产配置，根据市场波动情况，及时调整产品内各类资产持仓，稳健提升产品收益，降低产品净值波动。			
4.3、下一步投资策略			
结合国内经济复苏进展，动态跟踪货币政策和财政政策对各类资产价格的影响，把握债券市场和权益市场的市场的投资机会，及时通过量化择时模型对市场系统性进行对冲，适当提升资产配置分散度，降低产品整体波动，控制净值回撤。			
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49.04%，间接投资的比例为50.96%。其中直接投资固收类100%；间接投资固收类36.13%、权益类58.27%、商品及衍生品类5.60%。			
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	49.04%	100.00%
	货币类	4.46%	100.00%
	非标准化债权类	44.58%	0.00%

※	混合类资产	50.96%	0.00%
	对冲基金类	22.97%	0.00%
	混合基金类	27.99%	0.00%
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	中信期货灵活配置1号集合资产管理计划	81715468.22	27.99%
2	2020年绍兴镜湖5亿元理财投资业务	80091564.45	27.43%
3	东证期货工银慧享一号集合资产管理计划	67065000.00	22.97%
4	江苏信托-御信十二期(南京江宁)信托计划	50057534.25	17.15%
5	20HH6816存深圳9天	13000000.00	4.45%

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	绍兴市镜湖新区开发集团有限公司	2020年绍兴镜湖5亿元理财投资业务	18	4.12%	债权融资类投资	否	27.43%
2	南京江宁经济技术开发区总公司	江苏信托-御信十二期(南京江宁)信托计划	22	4.20%	债权融资类投资	否	17.15%

5.7 投资组合流动性风险分析

无

6、其他重要信息

6.1 理财产品在报告期内投资关联方发行的证券的情况

- 1) 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150559.62, 单位价格为3.093, 标的资产类别为基金
- 2) 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1656408.83, 单位价格为2.393, 标的资产类别为基金
- 3) 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1275429.14, 单位价格为4.02, 标的资产类别为股票

6.2 理财产品在报告期内投资关联方承销的证券的情况

无

6.3 理财产品在报告期内的其他重大关联交易

无