

工银理财·“全鑫权益”私银尊享量化策略理财产品HHPB1901 (HHPB1901) 2020年上半年半年报

1、重要提示			
无			
2、理财产品概况			
产品名称	工银理财·“全鑫权益”私银尊享量化策略理财产品HHPB1901		
产品代码	HHPB1901		
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07月11日		
产品到期日	2022年07月11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4.5%-5.50%（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）	0.50%		
杠杆水平	100%		
产品托管人	工商银行北京分行		
报告期末理财产品份额	92,697,000.00		
3、产品净值表现			
截至2020年6月30日，产品净值为1.0784,累计净值为1.0784,产品资产净值99961975.3,产品年化收益率为8.04%,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年上半年市场大幅波动，十年期国债中债估值到期收益率3.14%下行至2.59%，又上行至2.96%；A股方面市场结构分化，上证综指微跌2.19%，创业板指则上涨35.6%。			
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，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			
结合国内经济修复情况，把握债市和股市的市场波动机会，在市场调整时应用量化对冲等方式降低市场波动，应用大类资产配置模型，稳健提升收益。			
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16.68%，间接投资的比例为83.32%。其中直接投资中固收类100%；间接投资中固收类57.27%、权益类32.29%、商品及衍生品类10.44%。			
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	49.02%	--
	货币类	16.68%	--
	债券类	32.34%	--
※	混合类资产	50.98%	--
	对冲基金类	50.98%	--

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	国信证券稳1号集合资产管理计划		32565000.00		32.34%		
2	工银量化永安国富1期		27929200.00		27.74%		
3	东证期货工银慧享二号集合资产管理计划		23396000.00		23.24%		
4	活期存款		16794527.41		16.68%		
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							
无							