工银理财·恒睿私银尊享量化FOF混合类理财产品（2019年第2期）（19HH6803）2021年上半年半年报

1、重要提示

尊敬的客户，感谢您选择工银理财！您购买的本款产品是由工银理财有限责任公司自主设计、投资、运作的理财产品。为保障您的合法权益，请您在进行金融投资时，警惕任何人与机构假借我公司理财产品之名推介、推销其他类型金融产品。

2、理财产品概况

产品名称	工银理财·恒睿私银尊享量化FOF混合类理财产品（2019年第2期）
产品代码	19HH6803
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01月03日
产品到期日	2022年09月26日
业绩比较基准	本产品业绩比较基准为4.4%-4.6%（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）	0.40%
杠杆水平	101.25%
产品托管人	中国工商银行总行
报告期末理财产品份额	66,285,000.00

3、产品净值表现

截至2021年06月30日，产品净值为1.1898,累计净值为1.1898,产品资产净值78864320.26,产品年化收益率为12.71%,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，2021年二季度呈现股债同涨的局面。十年期国债中债估值到期收益率略有下行，从3.1887%下行至3.0778%。权益方面A股经历一季度的调整后略有上涨。二季度上证综指上涨4.3%，沪深300指数上涨3.5%，创业板指上涨26.1%。同时，A股行业板块表现分化，涨幅前三位的中信一级行业为电力设备及新能源、电子、综合；跌幅前三位的中信一级行业为农林牧渔、房地产、家电。商品市场方面，上海黄金交易所现货黄金（AU9999）上涨2.5%，南华商品指数上涨9.3%。

4.2、操作回顾

根据市场波动情况，综合考虑股债商大类资产的性价比，按照量化策略调整大类资产配置，积极把握市场波动机会，提升产品收益。权益资产方面调整结构，增加低估值、顺周期、高景气度的行业板块配置。

4.3、下一步投资策略

基于产品剩余期限进行组合管理，以绝对收益策略思路灵活调整大类资产比例，控制组合波动和风险，增强组合收益。基于国内外宏观经济数据的边际变化，捕捉各类资产的配置机会，运用多种方式控制组合波动和回撤。

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6.37%，间接投资的比例为93.63%。其中直接投资中固收类100%；间接投资中固收类53.31%、权益类43.68%、商品及衍生品类3.01%。

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	6.37%	/
	货币类	6.37%	/
	债券类	0.00%	/
	非标准化债权类	0.00%	/
	标准化债权类	0.00%	/
※	权益类	0.00%	/
	股票类	0.00%	/
	资本市场项目类	0.00%	/
	股权类	0.00%	/
※	商品及金融衍生品类	0.00%	/
	商品类	0.00%	/
	衍生品类	0.00%	/
※	混合类资产	93.63%	/
	对冲基金类	43.57%	/
	混合基金类	50.06%	/
	其他类	0.00%	/
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	39956887.99	50.06%
2	东证期货工银慧享一号集合资产管理计划	34774305.08	43.57%
3	活期存款	5086991.61	6.37%

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	占投资组合的比列(%)
无							

5.7投资组合流动性风险分析

投资组合在报告期内，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

6.1托管人报告

本报告期内，本托管人严格按照国家法律法规和合同的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害投资者利益的行为。

本报告期内，本托管人受理财产品管理机构的委托，复核了本产品2021年半年度报告中产品份额、份额净值、累计净值、资产净值和穿透前资产持仓及占比等内容，未发现任何损害投资者利益的行为。

6.2 理财产品在报告期内投资关联方发行的证券的情况

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混合A(证券代码：000251.OF),交易数量为892694.56,单位价格为2.649，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文体产业股票A(证券代码：001714.OF),交易数量为508782.16,单位价格为3.757，标的资产类别为基金

6.3 理财产品在报告期内投资关联方承销的证券的情况

无

6.4 理财产品在报告期内的其他重大关联交易

无