

工银理财·恒睿私银尊享混合类封闭净值型理财产品（20HH6840）（20HH6840）2020年年报

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（20HH6840）		
产品代码	20HH6840		
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08月12日		
产品到期日	2022年02月14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4.15%（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	工商银行深圳分行		
报告期末理财产品份额	239,730,000.00		
3、产品净值表现			
截至2020年12月31日，产品净值为1.0199,累计净值为1.0199,产品资产净值244506653.65,产品年化收益率为5.12%,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年受疫情影响，市场宽幅波动，十年期国债中债估值到期收益率先下后上，先有3.12%下行至最低2.47%，之后又上行回到3.15%；A股方面年初大幅波动，全年市场整体上涨，上证综指涨14.2%，沪深300指数涨27.7%，创业板指涨65.7%。A股行业板块表现分化，涨幅前三位的中信一级行业为食品饮料、电力设备及新能源、消费者服务；跌幅前三位的中信一级行业为综合金融、房地产、通信。商品市场方面，上海黄金交易所现货黄金（AU9999）上涨14.3%，南华商品指数上涨7.4%。			
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32.79%，间接投资的比例为67.21%。其中直接投资中固收类100%；间接投资中固收类82.51%、权益类14.1%、商品及衍生品类3.38%。			
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	91.83%	100.00%

	货币类	32.79%	100.00%
	债券类	59.04%	0.00%
※	混合类资产	8.17%	0.00%
	混合基金类	8.17%	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	中信期货工银量化精选2号	100531865.26	41.02%
2	活期存款	80369274.46	32.79%
3	中信期货工银量化精选1号	44156943.30	18.02%
4	中信期货灵活配置1号集合资产管理计划	20028526.50	8.17%

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

无

6、其他重要信息

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179790.33,单位价格为2.144,标的资产类别为基金

报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的19兴城Y1(证券代码:114610.SZ),交易数量为7484.1,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19甘公03(证券代码:114624.SZ),交易数量为26895.97,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19首业04(证券代码:151587.SH),交易数量为5846.95,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甘交01(证券代码:151641.SH),交易数量为8185.73,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中企01(证券代码:151662.SH),交易数量为5846.95,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兴城01(证券代码:151673.SH),交易数量为19879.63,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不动01(证券代码:151700.SH),交易数量为11693.9,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19首业06(证券代码:151812.SH),交易数量为11693.9,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19不动02(证券代码:151822.SH),交易数量为7016.34,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融和03(证券代码:151911.SH),交易数量为1169.39,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04(证券代码:162283.SH),交易数量为3508.17,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晋交03(证券代码: 162289.SH), 交易数量为12863.29, 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19常城05(证券代码: 162415.SH), 交易数量为11693.9, 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G20FXY3(证券代码: 163559.SH), 交易数量为17540.85, 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豫水01(证券代码: 167121.SH), 交易数量为5846.95, 单位价格为100, 标的资产类别为债券

报告期内投资于华夏基金管理有限公司发行的华夏磐泰混合(证券代码: 160323.OF), 交易数量为200170.62, 单位价格为1.1703, 标的资产类别为基金

报告期内投资于中信建投证券股份有限公司承销的20华电Y5(证券代码: 175557.SH), 交易数量为17540.85, 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金街01(证券代码: 149174.SZ), 交易数量为12863.29, 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中信建投证券股份有限公司承销的20工银租赁债02(证券代码: 2022048.IB), 交易数量为5846.95, 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承销的19中核MTN005A(证券代码: 101901633.IB), 交易数量为5846.95, 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承销的20中核MTN002(证券代码: 102002011.IB), 交易数量为10524.51, 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绿城1A(证券代码: 168553.SH), 交易数量为5262.25, 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承销的20光穗南电ABN001优先(证券代码: 082001001.IB), 交易数量为46775.6, 单位价格为100, 标的资产类别为债券