

星辰系列之量化对冲平衡1号理财计划持仓报告
2017-06-30

1. 理财产品概况

产品名称	星辰系列之量化对冲平衡1号理财计划
产品代码	2301167501
币种	人民币(CNY)
收益类型	非保本浮动收益
产品成立日	2016-02-03
产品到期日	2099-12-30
托管费率(年)	0.05%
销售手续费率(年)	0.50%
产品托管人	浦发银行总行

2. 投资组合结构状况

资产类别	占投资组合比重(%)
第三方主动管理量化净值型	20.01
定向工具(PPN)-非直接投资	43.66
回购型股权投资	10.03
活期存款	1.37
基金份额投资	0.00
结构化定向增发	4.94
结构化股权投资	7.52
结构化流通股	0.00
结构化员工持股	2.62
同业借款	1.40
一般公司债-非直接投资	2.06
资产支持证券(ABS/ABN)(债券型)-非直接投资	6.39
合计	100.00%

3. 非标准化债权资产明细

序号	融资客户	资产名称	剩余融资期限(月)	资产收益率(%)	交易结构	合作机构	组合占比(%)
1	哈尔滨恒世达昌科技有限公司	浦银安盛资管-华能信托京东金融股权收益权专项资产管理计划	20	7.90	回购型股权投资	上海浦银安盛资产管理有限公司	2.51
2	哈尔滨恒世达昌科技有限公司	浦银安盛资管-华能信托京东金融股权收益权专项资产管理计划	33	7.90	回购型股权投资	上海浦银安盛资产管理有限公司	3.76
3	哈尔滨恒世达昌科技有限公司	浦银安盛资管-华能信托京东金融股权收益权专项资产管理计划	47	7.90	回购型股权投资	上海浦银安盛资产管理有限公司	3.76