

理财产品持仓报告  
2018-09-30

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
产品规模	3,411,890,594.53
销售手续费	0.50%
固定管理费	0.20%
托管费	0.05%
托管人	浦发银行总行

2. 投资组合情况

资产类别	占投资组合比重
第三方主动管理混合净值型	1.49%
第三方主动管理量化净值型	11.52%
定向工具 (PPN)-非直接投资	23.23%
活期存款	0.89%
基金份额投资	27.92%
结构化定向增发	0.89%
结构化股票质押式回购	2.23%
结构化股权投资	2.24%
结构化流通股	1.37%
流通股股票质押 (场内)	2.20%
信托贷款	4.10%
证券公司债-非直接投资	7.15%
中小企业私募债 (债券型)-非直接投资	8.09%
资产支持证券 (ABS/ABN) (债券型)-非直接投资	6.68%
合计	100.00%