

理财产品持仓报告
2019-06-30

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
产品规模	1,965,321,814.81
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	3.52%
第三方主动管理量化净值型	17.57%
股票质押式回购	1.09%
活期存款	3.00%
基金份额投资	31.08%
结构化定向增发	4.51%
结构化股票质押式回购	3.78%
结构化股权投资	19.86%
结构化流通股	2.41%
结构化员工持股	1.58%
流通股股票质押(场内)	1.84%
同业借款	1.27%
信托贷款	1.74%
一般公司债-非直接投资	6.75%
合计	100.00%