

理财产品持仓报告  
2019-12-31

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	1,036,923,285.15
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	7.07%
定向工具 (PPN) - 直接投资	24.06%
回购型股权投资	19.90%
活期存款	11.16%
基金份额投资	4.87%
结构化股票质押式回购	7.02%
结构化员工持股	3.02%
流通股股票质押 (场内)	1.70%
同业借款	16.18%
一般中期票据 - 直接投资	5.00%
合计	100.00%