

2010年工银财富全权委托系列可转债理财产品CFWT01（CFWT01）2015年第三季度季报

1、重要提示			
无。			
2、理财产品概况			
产品名称	2010年工银财富全权委托系列可转债理财产品CFWT01		
产品代码	CFWT01		
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	2010年09月20日		
产品到期日	--		
开放日	每月第一个工作日		
开放时间	开放日的9：00-15：00		
购买、赎回方式	投资者可在开放日交易时间段内提交申购、赎回申请，开放日15：00之后提交的申请属于预约交易，自动延至下一开放日处理。		
业绩比较基准	6.0%（年化）		
托管费率（年）	0.10%		
销售手续费率（年）	1.00%		
产品托管人	工商银行广东省分行营业部		
报告期末理财产品份额	278,468,063.31		
3、产品净值表现			
截止至2015年9月30日，理财产品CFWT01的净值为1.3596，年初以来净值增长率为4.76%，年化净值增长率为6.34%。上述数据未经核对，仅供参考。			
4、市场情况及产品运作回顾			
4.1、市场回顾			
债券市场方面，收益率出现了整体的下行，信用债收益率下行幅度较大，平均超过40bp，而3_10年期政策性银行债收益率也平均下降了36bp，3_10年期国债收益率平均下行了20bp。牛市氛围在压缩信用利差和税收利差（政策性银行债和国债利差）的同时，也在压缩期限利差，导致收益率曲线变平。三季度1年及以内期限债券收益率下行幅度最小，甚至1年期国债收益率出现了上升，从二季度末的1.73%上升到2.40%。在三季度利率债供给量创历史新高的情况下，债市仍然呈现出多头震荡的格局。			
4.2、操作回顾			
2015年3季度，我们一方面对于适当久期的债券做了一定的配置；另一方面，我们也尽量挖掘高收益债权类项目，并对其加大了投资力度。			
4.3、下一步投资策略			
未来我们将进一步加大对于高收益投资品的投资力度，以期在保持产品净值稳定的基础上为投资者创造更好的收益。			
5、投资组合详细情况			
5.1、投资组合的基本情况			
	资产种类	占投资组合的比例（%）期末	占投资组合的比例（%）期初
※	高流动性资产	26.01%	--
	活期存款	25.52%	--
	存款组合	0.49%	--

※	债权类资产	73.99%	--
	债权融资类信托	73.84%	--
	结构性股权投资	0.15%	--
合计		100%	--
5.2、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			
5.3、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			
5.4、债权类资产的行内评级			
行内信用评级		占比	
AAA		0.00%	
AA+		0.00%	
AA		0.00%	
AA-		99.80%	
A+		0.20%	
A		0.00%	
A-		0.00%	
A-以下		0.00%	
N(待评级)		0.00%	
5.5、需要特别说明的投资品情况			
无。			
6、其他重要信息			
无。			