

2009年第1期中国工商银行私人银行全权委托资产管理—混合型 平衡增长理财计划（830006）2017年第二季度季报

1、重要提示

本投资管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用产品资产，但不保证产品一定盈利。产品的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本产品的产品说明书。请密切关注工商银行与本理财计划有关的信息披露，以免造成不必要的损失。

2、理财产品概况

产品名称	2009年第1期中国工商银行私人银行全权委托资产管理—混合型平衡增长理财计划
产品代码	830006
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	2009年03月31日
产品到期日	--
开放日	每周第一个工作日
开放时间	开放日的9:30至15:00
购买、赎回方式	客户可在理财计划封闭期过后，在每个开放日申购、赎回，办理时间为开放日的9:30至15:00。
业绩比较基准	当理财计划单周的收益率年化达到5%以上时，超过5%的部分管理人将按照25%的比例提取浮动管理费。
托管费率（年）	0.10%
销售手续费率（年）	0.00%
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	196,769,850.61

3、产品净值表现

截止2017年6月30日，产品净值为1.4439 产品净值增长2.51%，二季度净值表现低于业绩基准。

4、市场情况及产品运作回顾

4.1、市场回顾

二季度，宏观经济继续企稳迹象，CPI和PPI继续分化，货币政策中性偏紧，特别是5月份同业杠杆下降明显，金融去杠杆阶段性效果显现。在二季度，债券市场经历了明显的震荡调整。

4.2、操作回顾

目前操作以稳健为主，缩短久期，侧重配置盘，减少交易盘。

4.3、下一步投资策略

展望三季度，在金融去杠杆背景下，债券的调整可能还将继续，不排除由于政策等因素变化出现超调的可能。产品的债券投资以短久期配置策略为主。

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	67.83%	60.15%
	债券及债券基金	65.37%	60.15%
	活期存款	2.46%	0.00%
※	债权类资产	32.11%	36.47%

	标准债权投资计划	32.11%	36.47%
※	权益类资产	0.06%	3.38%
	新股及转债申购	0.05%	0.05%
	股票型证券投资	0.01%	0.00%
	结构化证券优先份额投资	0.00%	3.33%
合计		100%	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-	0.00%
A+	0.00%
A	0.00%
A-	0.00%
A-以下	0.00%
N(待评级)	100.00%

5.5、需要特别说明的投资品情况

--

6、其他重要信息

无
