

# 福泽滚雪球 6 号资产管理计划

## 2019 年第三季度季度报告

### 1、基金基本情况

| 项目            | 信息                                                                      |
|---------------|-------------------------------------------------------------------------|
| 基金名称          | 福泽滚雪球 6 号资产管理计划                                                         |
| 基金编号          | SW9486                                                                  |
| 基金管理人         | 福能期货股份有限公司                                                              |
| 基金托管人（如有）     | 国信证券股份有限公司                                                              |
| 投资顾问（如有）      | 无                                                                       |
| 基金运作方式        | 开放式                                                                     |
| 基金合同生效日期      | 2017-09-14                                                              |
| 报告期末基金份额总额（份） | 21,062,432.04                                                           |
| 投资目标          | 本计划力求在有效控制投资风险的基础上，追求资产的稳健增值。                                           |
| 投资策略          | 本计划主要通过全市场多维度精选优秀私募基金、资管计划进行灵活配置，辅以期货策略及流动性管理等策略，在风险可控的前提下，追求长期稳定的盈利回报。 |
| 业绩比较基准（如有）    | 无                                                                       |
| 风险收益特征        | 本计划为 R4 风险等级产品                                                          |

### 2、基金净值表现

#### 2.1 份额净值增长率

| 阶段         | 净值增长率(%) |
|------------|----------|
| 当季         | -0.86    |
| 自基金合同生效起至今 | -19.30   |

注：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

## 2.2 份额净值走势图



## 3、主要财务指标

单位：元

| 项目       | 2019-04-01 至 2019-06-30 |
|----------|-------------------------|
| 本期已实现收益  | -64,348.51              |
| 本期利润     | -146,140.96             |
| 期末基金资产净值 | 17,006,152.39           |
| 期末基金份额净值 | 0.807                   |

## 4、投资组合情况

### 4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

| 序号 | 项目      | 金额<br>(人民币) | 占基金总资产的<br>比例 (%) |
|----|---------|-------------|-------------------|
| 1  | 权益投资    | 0.00        | 0                 |
|    | 其中：普通股  | 0.00        | 0                 |
|    | 存托凭证    | 0.00        | 0                 |
| 2  | 基金投资    | 0.00        | 0                 |
| 3  | 固定收益投资  | 0.00        | 0                 |
|    | 其中：债券   | 0.00        | 0                 |
|    | 资产支持证券  | 0.00        | 0                 |
| 4  | 金融衍生品投资 | 0.00        | 0                 |

| 序号 | 项目                | 金额<br>(人民币)   | 占基金总资产的<br>比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|-------------------|
|    | 其中：远期             | 0.00          | 0                 |
|    | 期货                | 0.00          | 0                 |
|    | 期权                | 0.00          | 0                 |
|    | 权证                | 0.00          | 0                 |
| 5  | 买入返售金融资产          | 0.00          | 0                 |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | 0.00          | 0                 |
| 6  | 货币市场工具            | 0.00          | 0                 |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 78,365.84     | 0.46              |
| 8  | 其他                | 16,992,388.70 | 99.54             |
|    | 合计                | 17,070,754.54 | 100.00            |

#### 4.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合(注：不包括港股通数据)

报告期内，本计划未交易股票。

#### 4.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

报告期内，本计划未投资沪港通股票。

#### 4.2.3 报告期末本计划投资的其他资产交易情况

报告期内，本计划持有福鑫滚雪球6号私募投资基金，管理人为福建滚雪球投资管理有限公司，该私募基金投资范围：在上海证券交易所、深圳证券交易所交易的股票（包括网下和网上新股申购）、期权、债券及其它金融产品；中国金融期货交易所交易的期货、期权及其它金融产品；在银行间市场挂牌交易的金融产品；央行票据；银行理财产品、银行存款、现金；公募证券投资基金、证券公司或其子公司发行的资产管理计划、基金公司或其子公司发行的资产管理计划、期货公司或其子公司发行的资产管理计划、具有证券投资基金托管人资质的托管机构托管的私募证券投资基金、信托计划（以下统称“标的金融产品”，投资于前述标的金融产品时，不投资于其劣后级份额）。

截止2019年6月30日，持有基金份额20,448,112.95份，单位净值为0.831。

### 5、基金份额变动情况

单位：份

|              |               |
|--------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额  | 21,062,432.04 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 0.00          |



|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 0.00          |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.00          |
| 报告期期末基金份额总额               | 21,062,432.04 |

## 6、管理人报告

本报告期内，管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理规定》以及其他有关法律法规的规定，按照《福泽滚雪球6号资产管理计划资产管理合同》要求，本着诚实守信、审慎尽责的原则，管理和运用计划资产，保证投资者合法权益不受侵害。报告期内未发生风险事件，未存在利益冲突的情况。

## 7、托管人报告

本报告期内，托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，对资产净值的计算、利润分配、费用开支等业务进行了认真复核，未发现有损害计划份额持有人利益的行为。

本报告中的财务数据、净值表现、投资组合情况等数据真实、准确和完整。

