

福泽德胜 3 号资产管理计划
2019 年第二季度季度报告

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	福泽德胜 3 号资产管理计划
基金编码	SX7522
基金管理人	福能期货股份有限公司
基金托管人（如有）	招商证券股份有限公司
投资顾问（如有）	无
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2017 年 11 月 15 日
报告期末基金份额总额	14,719,756.07
投资目标	在控制风险的前提下，实现客户资产长期、持续、稳定的增值。
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	本计划属于 R4 级（中高风险）投资品种。
报告是否经托管机构复核	是

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	-0.22
自基金合同生效起至今	-2.03

说明：净值增长率等于（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

福泽德胜3号



3、主要财务指标

单位：人民币元

项目	2019 年 04 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
本期已实现收益	-30,755.46
本期利润	12,779.39
期末基金资产净值	14,420,739.20
期末基金份额净值	0.9797

4、投资组合报告

4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	0.00	0.00
	其中：普通股	0.00	0.00
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	0.00	0.00
3	固定收益投资	0.00	0.00
	其中：债券	0.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00

4	金融衍生品投资	0.00	0.00
	其中：远期	0.00	0.00
	期货	0.00	0.00
	期权	0.00	0.00
	权证	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
6	货币市场工具	0.00	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	326,069.25	2.25
8	其他各项资产	14,142,817.66	97.75
	合计	14,468,886.91	100.00

4.2 期末按行业分类的股票投资组合(不含港股通)

报告期内，本计划未交易股票。

4.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期内，本计划未投资港股通股票。

4.4 报告期末其他各项资产交易情况

报告期内，本计划持有德胜独角兽6号私募投资基金。

德胜独角兽6号私募投资基金，管理人为共青城独角兽投资管理合伙企业(有限合伙)，该私募基金投资范围本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的股票、债券（包括银行间债券、交易所债券、可转换债券、可交换债券）、优先股、证券回购、存款、公开募集证券投资基金（不包括非货币类ETF基金一级市场申购、赎回）、期货、场内期权、权证、资产支持证券、收益互换及场外期权（仅限于证券公司及其子公司、期货公司及其子公司作为交易对手）、证券公司收益凭证、信托计划、证券公司（含证券公司子公司）资产管理计划、基金公司（含基金子公司）特定客户资产管理计划、期货公司（含期货子公司）资产管理计划、保险公司（含保险子公司）资产管理计划、在基金业协会登记的私募基金管理人发行并由具有证券投资基金托管资格的机构托管或由具有相关资质的机构提供私募基金综合服务的契约式私募投资基金、银行理财产品。本基金可以参与融资融券交易、港股通交易、新股申购，也可以将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司。

截止2019年6月30日，持有基金份额14,307,352.21份，单位净值为0.9885。



5、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	19,818,536.42
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	5,098,780.35
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	14,719,756.07

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《福泽德胜3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

报告期内，托管人招商证券股份有限公司在对本计划的托管过程中，严格遵守有关法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在损害份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

托管人按照资产管理合同的约定，对本计划报告期的计划份额净值进行了复核；同时依据法律法规和资产管理合同规定，在托管人履行的投资监督范围内，对本计划报告期的投资情况进行了监督。在本资产管理合同约定的投资监督范围内，托管人未发现报告期内管理人违反资产管理合同约定的事项。

基于计划管理人提供的必要的估值要素，托管人参照有关法律法规和资产管理合同的约定，对计划管理人报告中的主要财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容的真实性、准确性和完整性进行了复核，未发现异常。

