

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）	17,662,432.04
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

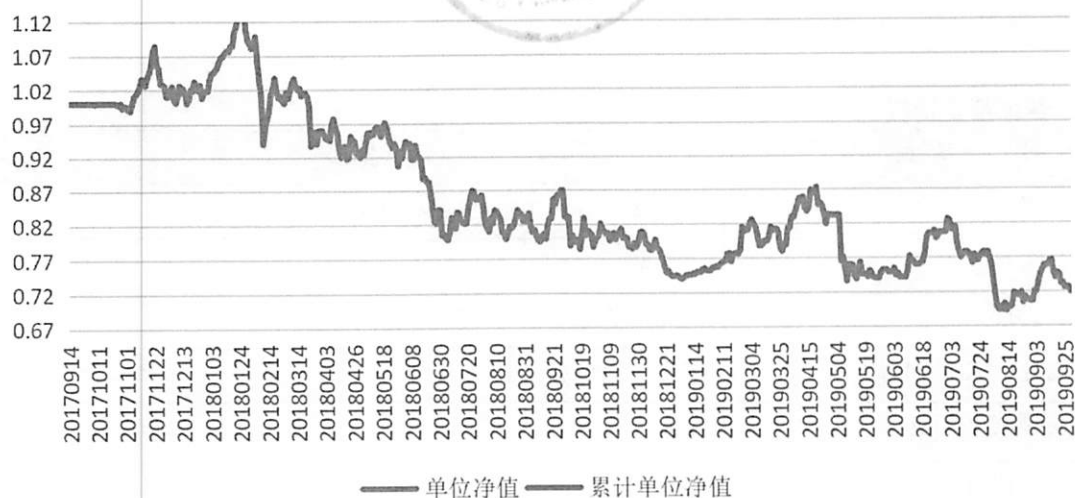
2、基金净值表现

2.1 份额净值增长率

阶段	净值增长率(%)
当季	-10.90
自基金合同生效起至今	-28.10

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	2019-07-01 至 2019-09-30
本期已实现收益	-827,688.55
本期利润	-1,702,342.7
期末基金资产净值	12,699,409.69
期末基金份额净值	0.719

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 (人民币)	占基金总资产的 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 (人民币)	占基金总资产的 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	150,131.48	1.18
8	其他	12,609,419.14	98.82
	合计	12,759,550.62	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9月30日，持有基金份额16,948,112.95份，单位净值为0.744。

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	3,400,000.00
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	17,662,432.04

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。