

私募基金信息披露季度报表

1、基金基本情况

| 项目 | 信息 |
|--------------------------|--|
| 基金名称 | 民生期货-周周盈5号集合资产管理计划 |
| 基金编码 | SVQ659 |
| 基金管理人 | 民生期货有限公司 |
| 基金托管人（如有） | 广发证券股份有限公司 |
| 投资顾问（如有） | |
| 基金运作方式 | 开放式 |
| 基金成立日期 | 2022-05-16 |
| 期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元） | 6355.256189 |
| 投资目标 | 通过对宏观经济、利率走势、资金供求、公司经营情况、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测，在严格的风险控制基础上，主动构建及调整投资组合，力求实现委托财产的稳健增值。 |
| 投资策略 | 1、信用策略通过主动承担适度的信用风险来获取较高的收益，所以在个债的选择中特别重视信用风险的评估和防范。本资管计划采用经认可的评级机构的评级结果进行债券筛选，同时辅以内部评估体系对债券发行人以及债务信用风险的评估进行债券投资范围的调整及投资策略的运用。根据国民经济运行周期阶段，对债券发行人进行全面分析，评价债券发行人的信用风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用等级，确定债券的信用风险利差。2、收益率曲线策略收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的依据之一。本资管计划将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，并且通过对收益率曲线变化的预测，适时采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合，并进行动态调整。3、债券选择策略根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。 |
| 业绩比较基准（如有） | 本资产管理计划不设置业绩比较基准。 |
| 风险收益特征 | 基于本计划的投资范围及投资策略，本计划不承诺保本及最低收益，属预期风险等级【R3】级的投资品种，适合具有【C3及以上】级别风险识别、评估、承受能力的合格投资者。 |

2、基金净值表现

| 阶段 | 净值增长率（%） | 净值增长率标准差（%） | 业绩比较基准收益率（%） | 业绩比较基准收益率标准差（%） |
|-------|----------|-------------|--------------|-----------------|
| 当季 | 2.63 | | | |
| 自基金合同 | | | | |

| | | | |
|-------|-------|--|--|
| 生效起至今 | 16.31 | | |
|-------|-------|--|--|

说明：净值增长率 = (期末累计净值 - 期初累计净值) / 期初累计净值

当季净值增长率 = (本季度末累计净值 - 上季度末累计净值) / 上季度末累计净值

3、主要财务指标

金额单位：元

| 项目 | 2024-01-01至2024-03-31 |
|-----------|-----------------------|
| 本期已实现收益 | 762411.31 |
| 本期利润 | 1522381.93 |
| 期末基金净资产 | 73917874.81 |
| 报告期期末单位净值 | 1.1631 |

4、投资组合情况

4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

| 项目 | | 金额 |
|-----------------|-------------------|-------------|
| 现金类资产 | 银行存款 | 567.54 |
| 境内未上市、未挂牌公司股权投资 | 股权投资 | |
| | 其中：优先股 | |
| | 其他股权类投资 | |
| 上市公司定向增发投资 | 上市公司定向增发股票投资 | |
| 新三板投资 | 新三板挂牌企业投资 | |
| 境内证券投资规模 | 结算备付金 | 600524.22 |
| | 存出保证金 | |
| | 股票投资 | |
| | 债券投资 | 66005372.33 |
| | 其中：银行间市场债券 | 28748861.08 |
| | 其中：利率债 | |
| | 其中：信用债 | 66005372.33 |
| | 资产支持证券 | |
| | 基金投资（公募基金） | |
| | 其中：货币基金 | |
| | 期货及衍生品交易保证金 | |
| | 买入返售金融资产 | 7449091.77 |
| | 其他证券类标的 | |
| 资管计划投资 | 商业银行理财产品投资 | |
| | 信托计划投资 | |
| | 基金公司及其子公司资产管理计划投资 | |
| | 保险资产管理计划投资 | |
| | 证券公司及其子公司资产管理计 | |

| | | |
|---------|-------------------|--|
| | 划投资 | |
| | 期货公司及其子公司资产管理计划投资 | |
| | 私募基金产品投资 | |
| | 未在协会备案的合伙企业份额 | |
| 另类投资 | 另类投资 | |
| 境内债权类投资 | 银行委托贷款规模 | |
| | 信托贷款 | |
| | 应收账款投资 | |
| | 各类受（收）益权投资 | |
| | 票据（承兑汇票等）投资 | |
| | 其他债权投资 | |
| 境外投资 | 境外投资 | |
| 其他资产 | 其他资产 | |
| 基金负债情况 | 债券回购总额 | |
| | 融资、融券总额 | |
| | 其中：融券总额 | |
| | 银行借款总额 | |
| | 其他融资总额 | |

4.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：元

| 序号 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 0.00 | 0.00 |
| B | 采矿业 | 0.00 | 0.00 |
| C | 制造业 | 0.00 | 0.00 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 0.00 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 0.00 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 0.00 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 0.00 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | 0.00 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 0.00 | 0.00 |
| J | 金融业 | 0.00 | 0.00 |
| K | 房地产业 | 0.00 | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | 0.00 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 0.00 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 0.00 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | 0.00 | 0.00 |
| P | 教育 | 0.00 | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作 | 0.00 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 0.00 | 0.00 |
| S | 综合 | 0.00 | 0.00 |
| | 合计 | 0.00 | 0.00 |

注：以上分类采用中证协行业分类。

4.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|------|-----------|--------------|
| 港股通 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

5、基金份额变动情况

单位：万份/万元

| | |
|---------------------------|-------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 4165.750848 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 4171.409094 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 1981.903753 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.000000 |
| 期末基金总份额/期末基金实缴总额 | 6355.256189 |

6、管理人报告（如有）

| |
|--|
| <p>1、报告期内高管、基金经理及其关联基金经验： 李宝春，现担任民生期货有限公司投资经理，从事资管产品投资工作，曾就职于华夏银行，具有丰富的资产管理和投研经验，尤其擅长固收领域自上而下分析，对宏观经济指标走势有长期跟踪经验，在国内债券市场区域风险分析及寻找价值洼地的标的资产领域有比较深入的研究，拥有丰富的交易经验和稳定的业绩管理能力。</p> <p>2、基金运作合规守信情况： 报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《私募基金投资监督管理办法》、基金合同和其他有关法律、法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。</p> <p>3、基金投资策略和业绩表现： 截至2024年第1季度，报告期期末单位净值为1.1628。</p> <p>4、对宏观经济、证券市场及其行业走势展望：</p> <p>5、内部基金监察稽核工作、基金估值程序（见基金合同“基金的估值”章节）、基金运作情况和运用杠杆情况： 根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。</p> <p>6、投资收益分配和损失承担情况、（适用基金合同中允许分配条款的产品，如不适用本项空） 本基金本报告期末未进行利润分配，无损失承担情况发生，符合相关法规及基金合同的规定。</p> <p>7、会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项：（不适用则本项空）</p> <p>8、对本基金持有人数或基金资产净值预警情形、可能存在的利益冲突等： 无</p> |
|--|

| | |
|-----------------|---|
| 信息披露报告是否经托管机构复核 | 是 |
|-----------------|---|

托管人复核说明：本基金托管人按照相关法律法规、基金合同的规定，对本基金在本报告中的财务数据进行了复核。对按照规定应由托管人复核的数据，托管人无异议。

