

国泰君安资产托管部

基础报告

2023-07-03至2023-09-29

目录

总体表现	3
单位净值表现	3
周收益表现	3
收益分析	3
指标分析	3
动态回撤	4

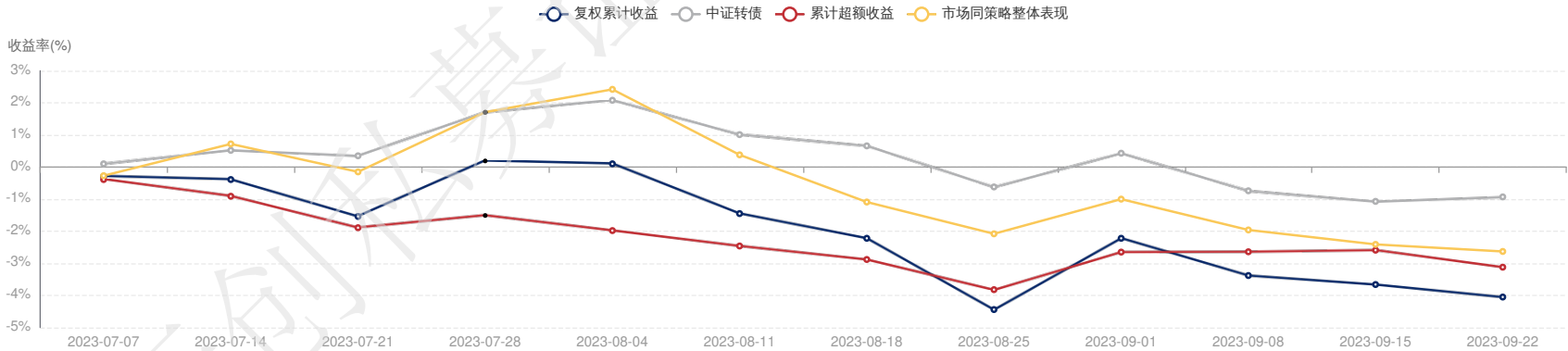
总体表现

产品名称	天创机遇6号私募证券投资基金
成立日期	2019-03-25
当前规模	- 万元
投资策略	宏观

最新净值日期	2023-09-29
累计净值	0.0000
单位净值	0.0000
同策略收益排名	64%

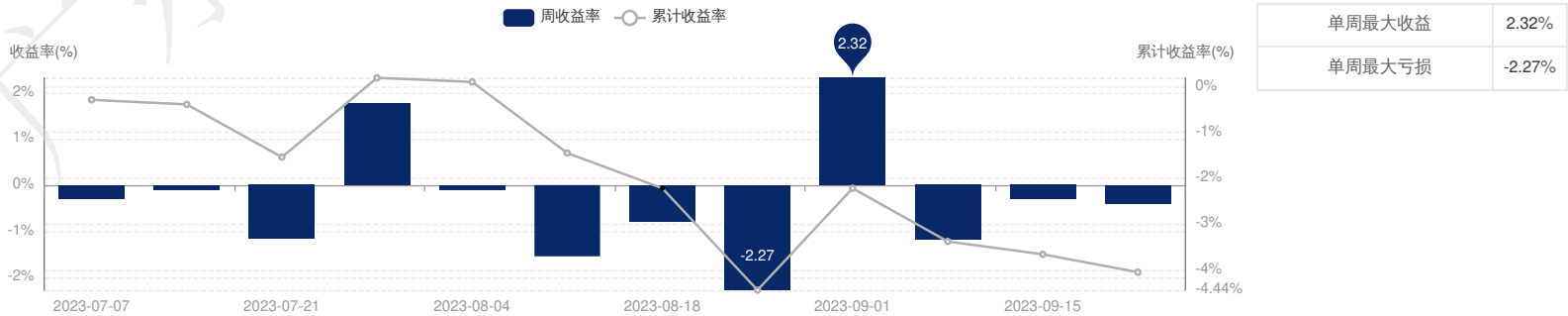
业绩统计	统计期间内产品总收益 -3.47% (年化 -14.47%), 主动收益 -2.95% (年化 -12.30%), 最大回撤 -4.62% , 夏普比率 -1.77 , β 2.38
收益风险特征	绝对收益风险类型属于 低收益低风险 , 主动收益风险类型属于 低收益低风险 , 同等风险下获利能力 较弱

单位净值表现



统计期间该产品绝对收益 **-4.05%**，基准收益率 **-0.93%**，超额收益 **-3.12%**，市场同策略整体表现数据来源:朝阳永续（宏观）

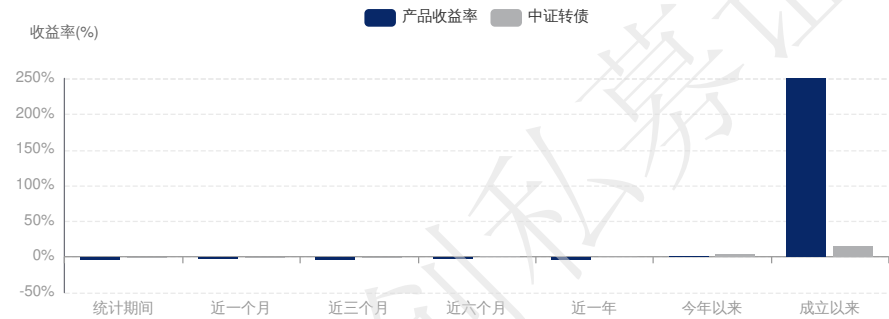
周收益表现



单周最大收益	2.32%
单周最大亏损	-2.27%

收益分析

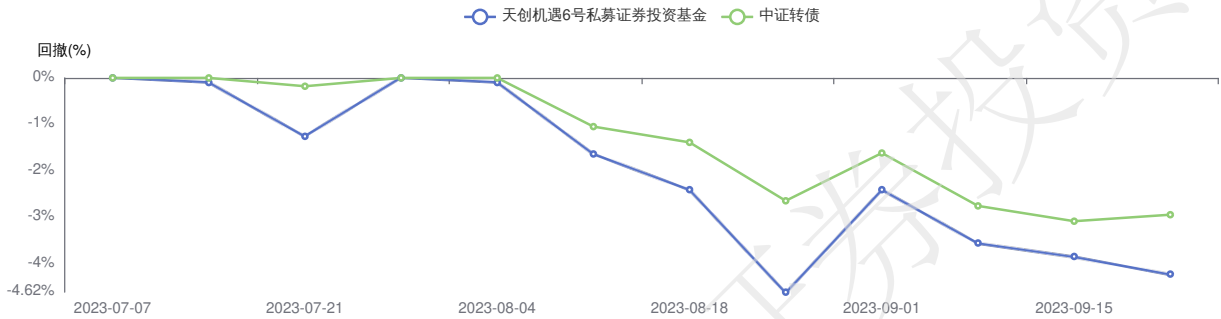
	*组合收益率(%)	*基准收益率(%)	*超额收益率(%)
统计期间	-4.05	-0.93	-3.12
近一个月	-1.49	-1.12	-0.37
近三个月	-3.30	-0.67	-2.63
近六个月	-2.75	0.36	-3.11
近一年	-4.12	0.67	-4.79
今年以来	0.56	3.39	-2.83
成立以来	250.67	15.02	235.65



指标分析

指标	统计期间	近一个月	近三个月	近六个月	近一年	今年以来	成立以来
*收益率(年化)	-16.88%	-18.56%	-12.71%	-5.49%	-4.20%	0.78%	57.76%
*波动率(年化)	9.14%	4.57%	9.02%	8.05%	10.15%	8.71%	20.56%
*跟踪误差(年化)	4.42%	2.20%	4.50%	4.33%	4.30%	4.09%	16.89%
*下行波动率(年化)	5.08%	3.42%	5.08%	4.99%	7.06%	5.02%	10.37%
*夏普比率(年化)	-2.04	-4.44	-1.60	-0.90	-0.59	-0.11	2.72
*索提诺比率(年化)	-3.67	-5.94	-2.85	-1.45	-0.84	-0.19	5.40
*信息比率(年化)	-2.94	-2.05	-2.25	-1.44	-1.14	-0.96	3.21
*最大回撤	-4.62%	-1.87%	-4.62%	-4.70%	-7.81%	-5.37%	-15.65%
最大回撤期间	自2023-07-28 至2023-08-25	自2023-09-01 至2023-09-22	自2023-07-28 至2023-08-25	自2023-06-02 至2023-08-25	自2022-10-14 至2022-12-23	自2023-02-03 至2023-08-25	自2020-12-04 至2021-02-05
最大回撤修复期(月)	-	-	-	-	-	-	0.77
*卡玛比率	-3.65	-9.93	-2.75	-1.17	-0.54	0.14	3.69
周胜率	15.38	20.00	21.43	33.33	43.14	39.47	52.59
月胜率	66.67	0.00	75.00	71.43	53.85	55.56	63.64

动态回撤



产品期间最大回撤	-4.62%
比较基准的最大回撤	-3.09%
产品最大回撤区间	自2023-07-28 至2023-08-25
比较基准的最大回撤区间	自2023-08-04 至2023-09-15
产品最大回撤修复期	自2023-08-25 至-
比较基准的最大回撤修复期	自2023-09-15 至-

免责声明

- 1、本报告由国泰君安证券股份有限公司资产托管部（以下简称“本部门”或“部门”）作为基金服务机构接受基金管理人委托制作，旨在反映管理人旗下产品在特定时间段的投资收益、风险及绩效归因。本报告的相关数据、分析结论不代表国泰君安证券股份有限公司作为基金托管人的观点。
- 2、本报告不构成相关基金合同项下的任何信息披露行为，本部门接受管理人委托发送报告的行为不构成相关基金合同项下信息披露义务的转移。如本报告中的数据与基金定期报告数据或管理人信息披露内容存在不一致的，应当以基金定期报告数据或管理人信息披露内容为准。
- 3、本报告涉及管理人相关产品的交易、持仓、绩效等敏感数据，报告接收方应当妥善履行相关保密义务。
- 4、本报告所包含的信息均基于该产品在本部门托管和基金运营外包服务中所涉及的交易与估值数据统计所得。本部门会尽力严谨审核报告所含信息和数据，提高数据的准确性、完整性及可靠性。由于数据统计方式与展现维度的不同，报告中的统计结果可能与估值核算业务统计的结果存在偏差，因此可能对信息的准确性、完整性或可靠性产生影响。报告中涉及的数据仅作为产品投资绩效分析的参考，不可作为产品申购、赎回、分红、转换等基金交易行为的依据，实际产品相关净值与资产收益等数据均以产品估值核算数据为准。
- 5、在任何情况下，本报告所载的信息、数据或分析模型均仅供客户参考之用，本报告不是本部门对任何人的投资建议，或作为任何特定计划投资决策的主要基础。投资者不应将本报告作为投资决策的唯一参考因素，投资人不应单纯依靠此报告而取代个人的独立判断。投资者务必注意，其据此做出的任何投资决策与本部门、本部门员工无关。