

私募投资基金信息披露重要内容模板第 1 号
《私募证券投资基金季度报告》

XXXX 私募证券投资基金 XXXX 年 XX 季度报告

基金管理人：

基金托管人：

报告基准日期：XXXX 年 XX 月 XX 日¹

¹ 此处填列报告期末的具体日期。

§ 重要提示

基金管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担责任。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证认（申）购资金本金不受损失。

基金托管人____复核了本报告中的基金财务情况等信息，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的宣传推介材料和基金合同。

本报告中财务资料未经审计。除特别说明外，本报告中涉及金额的单位均为人民币元。

本报告期自_年_月_日起至_月_日止。

§ 1 基金产品概况

1.1 基金基本情况

项目	信息
基金名称	
基金编码	
基金管理人	
基金运作方式 ²	
基金类型	

² 包括开放式、封闭式。

产品类型 ³ （选填）	
组织形式	
基金成立日期	
基金到期日期	
开放期安排（如有）	
封闭期安排（如有）	
份额锁定期安排（如有）	
是否结构化分级	
期末基金总份额	
期末基金净资产	
期末基金总资产	
投资顾问（如有）	
基金经理（投资经理）	
策略生成方式 ⁴	
投资策略 ⁵	
投资限制	
基金托管人	
基金估值服务机构	

³ 《私募证券投资基金运作指引》施行后新成立的私募证券基金必填。包括权益类、期货和衍生品类、混合类、固定收益类、私募证券投资母基金。

⁴ 包括主观投资、量化投资。

⁵ 包括股票多头策略、指数增强策略、股票多空策略、市场中性策略、股票定增策略、参与新股发行策略、套利策略、日内回转策略、信用债策略、高收益债策略、可转债策略、利率债策略、现金管理类策略、宏观策略、组合基金策略、事件驱动策略、期货管理策略、期权策略、可持续投资策略、其他策略等。若为其他策略，则需要说明具体投资策略。基金运作中的现金管理类资产配置在投资策略中不属于现金管理类策略。

基金份额登记机构	
财务数据是否经托管复核一致	
财务数据托管复核情况说明 ⁶	

注：

1.2 基金管理人以及托管人基本情况

项目		基金管理人	基金托管人
名称			
统一社会信用代码			---
法定代表人			---
信息披露负责人			
信息披露 联系人	姓名		
	联系电话		
	电子邮箱		
注册地址			
办公地址			

注：

⁶ 若复核不一致，需说明复核不一致的相关情况，并上传托管人复核报告。

§ 2 基金业绩表现情况

2.1 基金净值及收益表现情况

阶段	当期	今年以来	自基金成立日起至今
份额净值			
份额累计净值 ⁷			
基金收益率(%) ⁸			
业绩比较基准(如有) ⁹			
业绩比较基准收益率(%) ¹⁰ (如有)			
基金最大回撤(%) ¹¹			

注:

分级基金净值及收益表现情况¹²

XX 级基金净值及收益表现

阶段	当期	今年以来	自基金成立日起至今
份额净值			
份额累计净值			
基金收益率(%)			
业绩比较基准(如有)			

⁷ 当期期末份额累计净值=当期期末份额净值+基金成立后份额累计分红金额。

⁸ 详情可参考《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号<主要财务指标的计算与披露>》。精确至小数点后两位,如收益率为 6.85%。

⁹ 业绩比较基准按照合同约定的实际情况填列。

¹⁰ 精确至小数点后两位,如收益率为 6.85%。

¹¹ 基金最大回撤均应填写连续 12 个月最大回撤,具体是指从当期期末时点往前连续 12 个月内,基金份额累计净值波动至最低点时的收益率回撤幅度的最大值,最大回撤需填写正数。

¹² 如存在结构化分级,则需按情况分别列示。可根据具体的结构化分级情况,添加多张表格填写。存在份额分类的基金可参考披露。

业绩比较基准收益率(%) (如有)			
基金最大回撤(%)			

注：

2.2 基金份额变动情况¹³

	基金份额(份)
产品成立日	
期初总额	
加：当期增加	
减：当期减少	
期末总额	

注：

分级基金份额变动情况¹⁴

XX 级基金的份额变动

	基金份额(份)
产品成立日	
期初总额	
加：当期增加	
减：当期减少	
期末总额	

注：

¹³ 如基金成立日晚于报告期期初，则以基金成立日的基金份额总额作为报告期期初基金份额总额。

¹⁴ 如存在结构化分级，则需按情况分别列示。可根据具体的结构化分级情况，添加多张表格填写。存在份额分类的基金可参考披露。

2.3 基金主要财务指标¹⁵

项 目	金 额
1.已实现收益 ¹⁶	
其中：已扣除费用情况 ¹⁷	
（1）管理费	
（2）业绩报酬	
（3）托管费	
...	
2.公允价值变动收益（损失以” - “填列）	
3.利润总额（损失以” - “填列）	
4.净利润（损失以” - “填列）	

注：

§ 3 基金估值相关情况¹⁸

需披露报告期内对基金净值有重大影响的估值信息，包括但不限于估值原则、估值方法、估值程序，具体资产的估值方法不在此处披露（主要投向单一标的的基金，应当就估值情况进行具体说明）。

¹⁵ 此表格内数据按照权责发生制填写。

¹⁶ 指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

¹⁷ 按照基金合同约定应在基金中列支的费用。除管理费、业绩报酬及托管费外，自主列支主要费用情况。

¹⁸ 私募基金的估值方法发生变化的，除在定期报告中披露外，应及时进行临时披露。

§ 4 基金直接投资情况

4.1 期末基金资产组合情况¹⁹

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资		
	其中：1.股票 ²⁰		
	2.新三板挂牌公司股票		
2	固定收益投资		
	其中：1.债券		
	2.资产支持证券		
	3.公开募集基础设施证券投资基金		
3	期货及衍生品		
	其中：1.期货合约 ²¹		
	2.期权合约 ²²		
	3.场外衍生品 ²³		
4	资产管理产品		
	其中：1.公募基金（不包括货币基金）		
	2.信托计划		
	3.银行理财产品		
	4.保险资产管理产品		
	5.证券期货经营机构私募资产管理计划		
	6.私募基金		

¹⁹ 该表格填写基金直接投资情况，按照估值表数据填写。

²⁰ 投资于沪深北交易所发行的股票。

²¹ 期货合约填写金额为保证金金额。

²² 期权合约填写金额为合约价值及保证金金额。

²³ 场外衍生品填写金额为合约价值及保证金金额。

5	买入返售金融资产		
6	货币市场工具 ²⁴		
7	银行存款 ²⁵		
8	结算备付金		
9	境外投资 ²⁶		
	其中：1.股票		
	2.互联互通机制下投资的境外股票		
	3.债券		
	4.期货及衍生品 ²⁷		
	5.资产管理产品		
	6.其他		
10	其他资产		
	其中：1.应收申购款		
	2.证券清算款		
	3.其他 ²⁸		
合 计			

注：

4.2 按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值	占基金净资产比例 (%)
1	农、林、牧、渔业		
2	采矿业		
3	制造业		

²⁴ 包括银行存款（以投资为目的）、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、货币市场基金等。

²⁵ 银行存款指应对流动性需要的银行存款，不包括以投资为目的的银行存款。

²⁶ 该项填写直接投资境外资产情况，通过跨境收益互换投资境外资产的，不在此填写。

²⁷ 填写金额为合约价值及保证金金额。

²⁸ 若其他资产中其他金额占基金总资产比例超过 5%，则需要备注中列明其他明细。

4	电力、热力、燃气及水生产和供应业		
5	建筑业		
6	批发和零售业		
7	交通运输、仓储和邮政业		
8	住宿和餐饮业		
9	信息传输、软件和信息技术服务业		
10	金融业		
11	房地产业		
12	租赁和商务服务业		
13	科学研究和技术服务业		
14	水利、环境和公共设施管理业		
15	居民服务、修理和其他服务业		
16	教育		
17	卫生和社会工作		
18	文化、体育和娱乐业		
19	综合		
	合 计		

注：

4.3 按行业分类的境外股票投资组合

序号	行业类别	公允价值	占基金净资产比例 (%)
1			

...			
	合 计		

注：

4.4 按债券类型、评级分类的债券投资组合²⁹

序号	债券类型	公允价值	占基金净资产比例（%）
1	利率债 ³⁰		
	其中：...		
2	信用债 ³¹		
	其中：...		
	合 计		

注：

4.5 场外衍生品持仓情况³²

序号	衍生品类型 ³³	挂钩标的资产类别 ³⁴	权利金	保证金	杠杆率	期末合约市值 ³⁵	公允价值变动
1							
...							
合计							

注：

²⁹ 所采用的债券评级分类需经中国证监会核准的从事市场资信评级业务的机构所出。

³⁰ 包括国债、地方政府债、央行票据、政策性金融债等。

³¹ 包括金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、可转换公司债券、可交换债券等。

³² 披露内容为私募基金投资场外衍生品情况，需按照衍生品类型列示。

³³ 包括场外期权、收益互换、收益凭证、利率互换等。

³⁴ 包括权益类、大宗商品、利率、信用类、汇率等。

³⁵ 期末合约市值按照多空合约市值绝对值相加之和填列。

4.6 投资资产管理产品策略分布情况

序号	投资策略 ³⁶	投资规模 ³⁷	占基金净资产比例 (%)
1			
...			
	合计		

注：

4.7 所投资资产管理产品管理人情况³⁸

序号	管理人名称	管理人编码	投资产品 数量	投资产品 规模	投资产品规模占 基金净资产比例
1					
2					
...					

注：

4.8 标的基金情况³⁹

标的基金名称	投资规模	占基金净资产比例 (%)

注：

³⁶ 可参考表 1.1 中的投资策略。

³⁷ 投资规模均指投资资产的公允价值。

³⁸ 披露所投资资产管理产品涉及管理人情况，不包含公募基金。

³⁹ 百分之九十以上基金净资产投资于单一私募基金的披露该表，披露直接投资私募基金情况。

§ 5 基金穿透投资情况⁴⁰

5.1 基金穿透投资资产组合情况⁴¹

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资		
	其中：1.股票		
	2.新三板挂牌公司股票		
2	固定收益投资		
	其中：1.债券		
	2.资产支持证券		
	3.公开募集基础设施证券投资基金		
3	期货及衍生品		
	其中：1.期货合约		
	2.期权合约		
	3.场外衍生品		
4	公募基金（不包括货币基金）		
5	公募银行理财产品		
6	买入返售金融资产		
7	货币市场工具		
8	银行存款		

⁴⁰ 被投资的私募基金应当配合上层基金，提前披露相关内容。

⁴¹ 百分之九十以上基金净资产投资于本管理人管理的单一私募基金的，可不披露本表。

9	结算备付金		
10	境外投资		
	其中：1.股票		
	2.互联互通机制下投资的境外股票		
	3.债券		
	4.期货及衍生品		
	5.公募资产管理产品		
	6.其他		
11	其他资产		
	其中：1.应收申购款		
	2.证券清算款		
	3.其他 ⁴²		
合 计			
投资路径说明 ⁴³			

注：

⁴² 若其他资产中其他金额占基金总资产比例超过 5%，则需要在备注中列明其他明细。

⁴³ 通过资产管理产品投向底层资产的需说明投资路径中所投各层产品的管理人名称。

5.2 百分之九十以上基金净资产投资于本管理人管理的单一私募基金的，披露所投私募基金的信息披露报告。

§ 6 基金投资运作情况⁴⁴

6.1 高集中度持仓情况⁴⁵

序号	投资资产类型 ⁴⁶	投资资产数量 ⁴⁷	投资规模	占基金净资产比例	后续拟处理方式
1					
...					

注：

6.2 基金杠杆运用情况

期末基金总资产	期末基金净资产	期末杠杆率 ⁴⁸	期初杠杆率

注：

若为分级基金，则需要披露以下表格

优先级份额 ⁴⁹	劣后级份额	期末分级杠杆率 ⁵⁰	期初分级杠杆率

注：

⁴⁴ 该部分披露私募基金直接投资情况。

⁴⁵ 符合下列任一情况的需填列此表：投资于同一资产的资金占基金净资产比例 25%及以上；投资于同一债券的资金占基金净资产占比 10%及以上；持仓情况请按照投资同一类型资产规模降序填写。同一资产为基金类资产且在“标的基金情况”已披露的，本表中不再重复填写。

⁴⁶ 包括标准化股权类资产、标准化债权类资产、非标准化债权类资产、基金类资产、标准化期货和衍生品类资产、场外期权及证券公司发行的非保本型收益凭证、收益互换、其他场外衍生品类资产等。

⁴⁷ 披露高集中度投资该类资产涉及的标的个数。

⁴⁸ 杠杆率=基金总资产/基金净资产

⁴⁹ 中间级份额计入优先级份额计算。

⁵⁰ 分级杠杆率=优先级份额/劣后级份额。

6.3 流动性受限资产投资情况⁵¹

序号	受限类型 ⁵²	对应受限资产类别 ⁵³	期末成本总额	期末公允价值	公允价值占基金净资产比例	具体估值方法说明	流动性受限情况说明
1							
...							

注：

6.4 直接或者通过衍生品等间接方式投资境外资产情况⁵⁴

序号	跨境投资方式 ⁵⁵	境外资产交易场所所在国家或地区 ⁵⁶	是否直接投资	主要投资境外资产类别 ⁵⁷	投资规模 ⁵⁸	投资规模占基金净资产比例	跨境投资路径及其他事项 ⁵⁹
1							
...							

注：

⁵¹ 流动性受限资产合计占基金净资产比例超过 20%的需要披露该表。

⁵² 包括流动受限的新股、增发股票、停牌股票；通过大宗交易取得的带限售期的股票、到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（包含协议存款）、资产支持证券（票据）、违约债等。

⁵³ 包括权益投资、固定收益投资、期货及衍生品、资产管理产品、买入返售金融资产、货币市场工具等。

⁵⁴ 披露穿透后投资境外底层资产情况，需分别按照跨境投资方式及境外资产交易场所所在国家或地区列示。

⁵⁵ 包括互联互通机制下投资的股票、跨境收益互换、场外期权等。

⁵⁶ 包括中国香港、美国、欧洲、亚洲（不含中国香港）等。

⁵⁷ 说明直接或者通过衍生品等方式投资的主要底层资产类别，包括债券、股票、公募基金、期货及衍生品、存款、中资美元债、ETF 等。若投资资产为境外公募基金（如共同基金，UCITs 等），则无需穿透。

⁵⁸ 如投资资产类别为场外衍生品，则填写金额为合约价值及保证金金额。

⁵⁹ 通过跨境收益互换投资境外资产的，需要披露交易对手方名称；跨境投资涉及资产管理产品的，需要披露所投资资产管理产品名称、管理人名称及其基本情况。

§ 7 基金关联交易情况

7.1 基金关联方投资交易明细表⁶⁰

交易日期	关联交易类型	关联方名称	交易标的类型 ⁶¹	交易对手方	交易方向 ⁶²	交易价格	关联交易金额	关联交易说明 (包括但不限于履行基金合同约定的决策程序情况、价格确定依据)

注：

7.2 私募基金特定关联交易汇总表⁶³

产品名称	当期净申赎金额	期末投资余额	关联交易说明 (包括但不限于履行基金合同约定的决策程序情况、价格确定依据)

注：

§ 8 基金主要投资风险、投资策略运行情况及其他事项

--

⁶⁰ 报告期内，管理人运用基金资产与《信息披露办法》中规定的关联方发生投资交易行为的披露下表。

⁶¹ 包括股票、债券、场外衍生品、私募基金、信托计划、证券期货经营机构私募资产管理计划等。

⁶² 包括买入资产/卖出资产。

⁶³ 将百分之九十以上基金净资产投资本管理人管理的私募基金的，可以按照被投私募基金名称汇总披露投资金额及余额等相关情况。

§9 附件目录

--