

申万利位1号集合资产管理计划

2021年三季度报告

基金管理人：申银万国期货有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	申万利位 1 号集合资产管理计划
基金编码	SQF719
基金管理人	上海利位投资管理有限公司
基金托管人(如有)	宁波银行股份有限公司
投资顾问(如有)	
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2021 年 04 月 20 日
期末基金总份额(万份)/期末基金实缴总额(万元)	1675.307307
投资目标	
投资策略	
业绩比较基准(如有)	
风险收益特征	

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	3.30	0.11		
自基金合同生效起至今	3.79	0.08		

注：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)/上季度末净值
表中指标均已不带百分号数值形式表示，一般保留至小数点后 2 位。

3、主要财务指标

金额单位：元

项目	2021/07/01	至	2021/09/30	(元)
本期已实现收益	338,850.34			
本期利润	338,849.48			
期末基金净资产	17,388,116.05			
报告期期末单位净值	1.0379			

4、投资组合情况

4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

申万利位 1 号集合资产管理计划_SQA027_季报(证券投资类)_申银万国期货有限公司

项目	金额
现金类资产	银行存款 64,060.63
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资 0
	其中：优先股 0
	其他股权类投资 0
上市公司定向增发投资	上市公司定向增发股票投资 0
新三板投资	新三板挂牌企业投资 0
境内证券投资规模	结算备付金 700,841.78
	存出保证金 0
	股票投资 0
	债券投资 16,266,200.00
	其中：银行间市场债券 0
	其中：利率债 0
	其中：信用债 16,266,200.00
	资产支持证券 0
	基金投资（公募基金） 0
	其中：货币基金 0
	期货及衍生品交易保证金 0
	买入返售金融资产 0
	其他证券类标的 0
	资管计划投资
信托计划投资 0	
基金公司及其子公司资产管理计划投资 0	
保险资产管理计划投资 0	
证券公司及其子公司资产管理计划投资 0	
期货公司及其子公司资产管理计划投资 0	
私募基金产品投资 0	
未在协会备案的合伙企业份额 0	
另类投资	另类投资 0
境内债权类投资	银行委托贷款规模 0
	信托贷款 0
	应收账款投资 0
	各类受（收）益权投资 0
	票据（承兑汇票等）投资 0
	其他债权投资 0
境外投资	境外投资 0
其他资产	其他资产 应收利息#404,594.94;
基金负债情况	债券回购总额 0
	融资、融券总额 0
	其中：融券总额 0
	银行借款总额 0
	其他融资总额 0

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

4.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

金额单位：元

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	1509.850457
报告期期间基金总申购份额	1408.389714
减：报告期期间基金总赎回份额	1242.932864
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	1675.307307

6、管理人报告（如报告期内高管、基金经理及其关联基金经验、基金运作合规守信情况、基金投资策略和业绩表现、对宏观经济、证券市场及其行业走势展望、内部基金监察稽核工作、基金估值程序、基金运作情况和运用杠杆情况、投资收益分配和损失承担情况、会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项、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）

1) 基金运作合规守信情况:

本报告期内，本基金管理人严格遵守《私募投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、基金合同等规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

2) 基金估值程序:

截止到报告期末，本管理人委托申万宏源证券有限公司为本基金提供估值核算服务。对于与基金资产有关的估值与会计核算问题，经相关当事人在平等基础上充分讨论后，达成一致意见。

1、本基金成立前，本管理人协调本基金其他当事人商定本基金的估值与会计核算方法，并在合同中约定。

2、在本基金的存续期内，本基金管理人定期评估基金估值与会计核算方法的合理性。

3、在本基金的运作过程中，经济环境发生重大变化且对基金资产的估值产生重大影响的，由本管理人协调本基金其他当事人采取必要措施，调整估值方法。

3) 基金运作情况和运用杠杆情况:

本基金无运用杠杆情况。