

# 申万利稳双周盈1号集合资产管理计划

## 2021年四季度报告

基金管理人：申银万国期货有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

## 1、基金基本情况

| 项目            | 信息                  |
|---------------|---------------------|
| 基金名称          | 申万利稳双周盈 1 号集合资产管理计划 |
| 基金编码          | SNH702              |
| 基金管理人         | 申银万国期货有限公司          |
| 基金托管人（如有）     | 国泰君安证券股份有限公司        |
| 投资顾问（如有）      |                     |
| 基金运作方式        | 开放式                 |
| 基金成立日期        | 2021-03-26          |
| 报告期末基金份额总额（份） | 34,608,901.14       |

## 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(%) | 业绩比较基准收益标准差(%) |
|------------|----------|-------------|--------------|----------------|
| 当季         | 2.88     | -           | -            | -              |
| 自基金合同生效起至今 | 7.00     | -           | -            | -              |

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）/上季度末累计净值

如为分级基金，应按级别分别列示。

表中指标均以不带百分号数值形式填写，请保留至小数点后2位。

## 3、主要财务指标

金额单位：元

| 项目       | 2021-10-01 | 至 | 2021-12-31 | (元)           |
|----------|------------|---|------------|---------------|
| 本期已实现收益  |            |   |            | 702,370.03    |
| 本期利润     |            |   |            | 970,307.92    |
| 期末基金资产净值 |            |   |            | 37,028,050.48 |
| 期末基金份额净值 |            |   |            | 1.070         |

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

## 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 |

|   |                   |               |
|---|-------------------|---------------|
| 1 | 权益投资              | 0.00          |
|   | 其中：普通股            | 0.00          |
|   | 存托凭证              | 0.00          |
| 2 | 基金投资              | 0.00          |
| 3 | 固定收益投资            | 4,977,900.00  |
|   | 其中：债券             | 4,977,900.00  |
|   | 资产支持证券            | 0.00          |
| 4 | 金融衍生品投资           | 0.00          |
|   | 其中：远期             | 0.00          |
|   | 期货                | 0.00          |
|   | 期权                | 0.00          |
|   | 权证                | 0.00          |
| 5 | 买入返售金融资产          | 0.00          |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | 0.00          |
| 6 | 货币市场工具            | 0.00          |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 1,167,684.10  |
| 8 | 其他                | 30,987,234.61 |

注：

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

本报表“其他”项中列示的主要包括期货交易保证金、各类应收款等，具体情况见《其他资产构成报表》。

## 4.2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### 4.2.1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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：

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

#### 4.2.2、报告期末按行业分类的港股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(%) |
|---------|-----------|--------------|
| 基础材料    | 0.00      | 0.00         |
| 消费者非必需品 | 0.00      | 0.00         |
| 消费者常用品  | 0.00      | 0.00         |
| 能源      | 0.00      | 0.00         |
| 金融      | 0.00      | 0.00         |
| 医疗保健    | 0.00      | 0.00         |
| 工业      | 0.00      | 0.00         |
| 信息技术    | 0.00      | 0.00         |
| 电信服务    | 0.00      | 0.00         |
| 公用事业    | 0.00      | 0.00         |
| 房地产     | 0.00      | 0.00         |
| 合计      | 0.00      | 0.00         |

注：

以上分类采用全球行业标准（GICS）。

## 5、基金份额变动情况

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 47,455,705.01 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 12,759,204.58 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 25,606,008.45 |
| 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 | 34,608,901.14 |
|-------------|---------------|

注：

如为分级基金，应按级别分别列示。

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。

## 6、管理人报告

### 1) 基金运作遵规守信情况：

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，本管理人委托国泰君安证券股份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。

### 4) 本报告期内投资经理变更为朱旭颖、邵骏

信息披露报告是否经托管机构复核：是

## 附：其他资产构成报表

金额单位：元

| 序号  | 名称         | 金额            |
|-----|------------|---------------|
| 1   | 交易保证金      | 0.00          |
| 1.1 | 其中：期货交易保证金 | 0.00          |
| 2   | 应收证券清算款    | 0.00          |
| 3   | 应收股利       | 0.00          |
| 4   | 应收基金红利     | 0.00          |
| 5   | 应收利息       | 159,735.66    |
| 6   | 应收申购款      | 0.00          |
| 7   | 其他应收款      | 0.00          |
| 8   | 待摊费用       | 0.00          |
| 9   | 其他         | 30,827,498.95 |
| 10  | 合计         | 30,987,234.61 |