

申万利位 1 号集合资产管理计划

2022 年第三季度报告



申银万
骑

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	申银万国期货有限公司
基金托管人(如有)	宁波银行股份有限公司
投资顾问(如有)	上海利位投资管理有限公司
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2021年4月20日
报告期末基金份额总额(份)	108,544,121.78

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	1.39	-	-	-
自基金合同生效起至今	10.63	-	-	-

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
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	2022年7月1日至2022年9月30日(元)
本期已实现收益	1,911,862.60
本期利润	1,766,649.23
期末基金资产净值	120,084,819.77
期末基金份额净值	1.1063

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

项目	金额
----	----

现金类资产	银行存款	405,540.01
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	0.00
	其中：优先股	0.00
	其他股权类投资	0.00
上市公司定向增发投资	上市公司定向增发股票投资	0.00
新三板投资	新三板挂牌企业投资	0.00
境内证券投资规模	结算备付金	1,385,133.26
	存出保证金	0.00
	股票投资	0.00
	债券投资	118,988,232.21
	其中：银行间市场债券	0.00
	其中：利率债	0.00
	其中：信用债	118,988,232.21
	资产支持证券	0.00
	基金投资（公募基金）	0.00
	其中：货币基金	0.00
	期货及衍生品交易保证金	0.00
	买入返售金融资产	0.00
其他证券类标的	0.00	
资管计划投资	商业银行理财产品投资	0.00
	信托计划投资	0.00
	基金公司及其子公司资产管理计划投资	0.00
	保险资产管理计划投资	0.00
	证券公司及其子公司资产管理计划投资	0.00
	期货公司及其子公司资产管理计划投资	0.00
	私募基金产品投资	0.00
	未在协会备案的合伙企业份额	0.00
另类投资	另类投资	0.00
境内债权类投资	银行委托贷款规模	0.00
	信托贷款	0.00
	应收账款投资	0.00
	各类受（收）益权投资	0.00
	票据（承兑汇票等）投资	0.00
	其他债权投资	0.00
境外投资	境外投资	0.00
其他资产	其他资产	应收申购款#70000.00;

期货有
专户

基金负债情况	债券回购总额	0.00
	融资、融券总额	0.00
	其中：融券总额	0.00
	银行借款总额	0.00
	其他融资总额	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、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（%）
港股通	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	116,489,359.34
报告期期间基金总申购份额	13,051,319.31
减：报告期期间基金总赎回份额	20,996,556.87
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	108,544,121.78

注：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：

本基金总资产与净资产的比值为 101%

信息披露报告是否经托管机构复核：是

