

利位1号私募证券投资基金 2023 年年度报告

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	利位1号私募证券投资基金
基金编码	STX088
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2022年7月18日
基金管理人	上海利位投资管理有限公司
基金托管人(如有)	中信证券股份有限公司
投资顾问(如有)	
期末基金总份额(万份) / 期末基金实缴总额(万元)	28,723.718088
基金到期日期	2032年7月17日

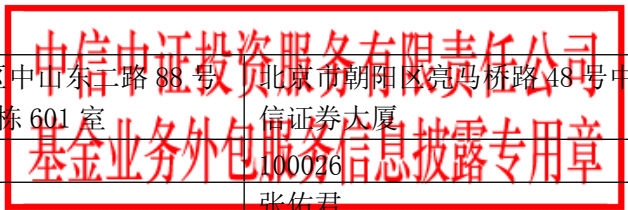
1.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下,实现基金资产的稳健增长。
投资策略	核心品种+板块配置+仓位匹配”是投资策略的重要组成部分,以核心品种为基础,不断地优化组合是管理人贯穿投资过程始终的策略。不同类型的投资标的适合不同的交易策略,对于弱周期的品种,左侧交易的策略比较适合,对于周期性较强的品种,右侧交易比较适合。
业绩比较基准(如有)	无
风险收益特征	本基金属于 R2 风险等级的投资品种,适合风险识别、评估、承受能力为 C5, C4, C3, C2 的合格投资者。

1.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上海利位投资管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨军智
	联系电话	95548-3
	电子邮箱	cust_serv@citics.com
传真		010-60834004
注册地址		广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

办公地址	上海市黄浦区中山东二路88号 外滩 SOHO D 栋 601 室	北京市朝阳区亮马桥路48号 中信证券大厦
邮政编码		100026
法定代表人		张佑君



1.4 信息披露方式

--

1.5 其他相关资料（如有）

项目	名称	办公地址
会计师事务所		
注册登记机构	中信中证投资服务有限责任公司	深圳市福田区中心三路8号 中信证券大厦21楼
外包机构	中信中证投资服务有限责任公司	深圳市福田区中心三路8号 中信证券大厦21楼

2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：元

期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	18,448,493.77	67,994.77	0.00
本期利润	24,317,806.42	71,043.84	0.00
期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	36,551,732.71	63,749.34	0.00
期末可供分配基金份额利润	0.1273	0.0637	0.0000
期末基金净资产	333,969,749.42	1,064,743.84	0.00
报告期期末单位净值	1.1627	1.0647	0.0000
累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率 (%)	19.27	6.47	0

备注：

无分级 二级 三级

2.2 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 (%)
当年	12.02			
自基金合同生效起至今	19.27			

备注：

2.3 过去三年基金的利润分配情况

中信中证投资服务有限责任公司

基金业务外包服务信息披露专用章

年度	每份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023	0.0300	4,180,532.78	1,712,553.05	5,893,085.83	
2022	0.0000	0.00	0.00	0.00	

备注：

3、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	100
报告期期间基金总申购份额	40,406.739667
减：报告期期间基金总赎回份额	11,783.021579
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	28,723.718088

备注：

4、管理人说明的其他情况

--

5、托管人报告（如有）

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期，基金托管人在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，在本基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现本基金的管理人损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由本基金管理人编制并经托管人复核审查的有关本基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6、年度财务报表

金额单位：元

6.1 资产负债表

资产	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	资产：	
银行存款	1,909,743.31	9,758.65
结算备付金	10,632,132.15	744.55
存出保证金	0.00	0.00
交易性金融资产	343,206,876.21	789,961.56
其中：股票投资	0.00	0.00
基金投资	0.00	0.00
债券投资	332,306,178.05	695,677.19
资产支持证券投资	10,900,698.16	94,284.37
贵金属投资	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	267,027.84
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
递延所得税资产	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产总计	355,748,751.67	1,067,492.60
负债和所有者权益	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	17,934,526.44	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	3,447,823.15	2,015.02
应付托管费	16,143.49	29.26
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	0.00	0.00
应交税费	364,365.68	675.22
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
递延所得税负债	0.00	0.00
其他负债	16,143.49	29.26
负债合计	21,779,002.25	2,748.76
所有者权益：		
实收基金	287,237,180.88	1,000,000.00
未分配利润	46,732,568.54	64,743.84

所有者权益合计	383,969,749.42	1,064,743.84
负债和所有者权益总计	355,748,751.67	1,067,492.60

备注：

中信中证投资服务有限责任公司
 基金业务外包服务信息披露专用章

6.2 利润表

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至 2023年12月31日	2022年7月18日至2022 年12月31日
一、收入	29,317,724.73	76,872.42
1. 利息收入	440,949.28	499.80
其中：存款利息收入	15,428.58	366.46
债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产收入	438,234.77	66.67
其他利息收入	-12,714.07	66.67
2. 投资收益（损失以“-”填列）	23,670,052.25	75,522.79
其中：股票投资收益	0.00	0.00
基金投资收益	0.00	0.00
债券投资收益	23,167,051.91	62,994.54
资产支持证券投资收益	503,000.34	12,528.25
贵金属投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	0.00	0.00
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”填列）	5,886,973.57	3,058.25
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
5. 其他收入（损失以“-”填列）	-680,250.37	-2,208.42
减：二、费用	4,999,918.31	5,828.58
1. 管理人报酬	4,336,996.14	4,655.98
其中：固定管理费	1,373,476.54	4,655.98
业绩报酬	2,963,519.60	0.00
2. 托管费	45,782.52	62.40
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 外包服务费	45,782.52	62.40
5. 交易费用	193,394.12	111.80
6. 利息支出	288,858.75	0.00
其中：卖出回购金融资产支出	288,858.75	0.00
7. 其他费用	89,104.26	936.00
三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）	24,317,806.42	71,043.84

减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	24,317,806.42	71,043.84

中信中证投资服务有限责任公司
 基金业务外包服务信息披露专用章

备注：

根据《资产管理产品相关会计处理规定》对资产管理产品管理人报酬的相关处理要求，本期末根据产品合同/协议相关约定条款计算方式得出暂估管理人报酬金额为 2081955.95，暂估后产品资产净值 331887793.47，暂估后产品单位净值 1.1554，暂估后产品累计净值 1.1854。暂估管理人报酬数据的真实性、准确性由基金管理人负责，该数据的复核情况托管人按照产品合同/协议相关约定执行。

6.3 所有者权益变动表

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,000,000.00	64,743.84	1,064,743.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	24,317,806.42	24,317,806.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	286,237,180.88	28,243,104.11	314,480,284.99
其中：1. 基金申购款	404,067,396.67	42,269,956.38	446,337,353.05
2. 基金赎回款	-117,830,215.79	-	-
		14,026,852.27	131,857,068.06
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	0.00	-	-5,893,085.83
		5,893,085.83	
五、期末所有者权益（基金净值）	287,237,180.88	46,732,568.54	333,969,749.42
项目	上年度可比期间 2022年7月18日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,000,000.00	0.00	2,000,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	71,043.84	71,043.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,000,000.00	-6,300.00	-1,006,300.00
其中：1. 基金申购款	0.00	0.00	0.00

2. 基金赎回款	1,000,000.00	-6,300.00	-1,006,300.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	1,000,000.00	64,743.84	1,064,743.84

中信中证投资服务有限责任公司
 基金业务外包服务信息披露专用章

备注：

7、期末投资组合情况

7.1 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	1,909,743.31
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	
	其中：优先股	
	其他股权类投资	
上市公司定向增发投资	上市公司定向增发股票投资	
新三板投资	新三板挂牌企业投资	
境内证券投资规模	结算备付金	10,632,132.15
	存出保证金	
	股票投资	
	债券投资	332,306,178.05
	其中：银行间市场债券	
	其中：利率债	18,116,289.86
	其中：信用债	314,189,888.19
	资产支持证券	10,900,698.16
	基金投资（公募基金）	
	其中：货币基金	
	期货及衍生品交易保证金	
	买入返售金融资产	
	其他证券类标的	
资管计划投资	商业银行理财产品投资	
	信托计划投资	
	基金公司及其子公司资产管理计划投资	
	保险资产管理计划投资	
	证券公司及其子公司资产管理计划投资	

中信中证印章（如有）
 仅对本报告中的财务数据负责

	期货公司及其子公司资产管理计划投资	
	私募基金产品投资	
	未在协会备案的合伙企业份额	
另类投资	另类投资	
境内债权类投资	银行委托贷款规模	
	信托贷款	
	应收账款投资	
	各类受（收）益权投资	
	票据（承兑汇票等）投资	
	其他债权投资	
境外投资	境外投资	
其他资产	其他资产	
基金负债情况	债券回购总额	17,934,526.44
	融资、融券总额	
	其中：融券总额	
	银行借款总额	
	其他融资总额	

中信中证投资服务有限责任公司
 基金业务外包服务信息披露专用章

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
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

备注：

该项目根据中国证券监督管理委员会发布的《上市公司行业分类指引（2012年修订）》中的分类指导进行填报

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合（如有）

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
合计	0.00	0.00

备注：

8、信息披露报告

信息披露报告是否经托管机构复核：是