

利位 1 号私募证券投资基金 2024 年第 2 季度报告

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	利位 1 号私募证券投资基金
基金编码	STX088
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）	
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2022 年 7 月 18 日
期末基金总份额（万份）/ 期末基金实缴总额（万元）	43,324.868386
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，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。

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	2.79			
自基金合同生效 起至今	27.83			

备注：

√ 无分级 □ 二级基金 □ 三级基金

3、主要财务指标

金额单位：元

项目	2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日（元）
本期已实现收益	9,239,821.50
本期利润	10,416,197.71
期末基金净资产	524,346,205.29

报告期末单位净值

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

1.2103

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	9,130,099.02
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	18,145,384.36
	存出保证金	
	股票投资	
	债券投资	449,574,497.7
	其中：银行间市场债券	
	其中：利率债	18,440,447.67
	其中：信用债	431,134,050.03
	资产支持证券	1,748,259.49
	基金投资（公募基金）	5,956,626.43
	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	71,733,638.3
	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	
	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	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
	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	应收申购款#1, 710, 000. 00;
基金负债情况	债券回购总额	21, 970, 555. 08
	融资、融券总额	
	其中：融券总额	
	银行借款总额	
	其他融资总额	

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

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

4.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
合计		

备注：

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	32,602.24516
报告期期间基金总申购份额	16,349.720016
减：报告期期间基金总赎回份额	5,627.09679
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）	43,324.868386

备注：

6、管理人报告

--

信息披露报告是否经托管机构复核：是