**大越期货海赢一号集合资产管理计划 2021年第三季度报告**

**基金管理人：大越期货股份有限公司**

**基金托管人：海通证券股份有限公司**

**送出日期：2022年01月19日**

**私募基金信息披露季度报表**

**1、基金基本情况**

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 信息 |
| 基金名称 | 大越期货海赢一号集合资产管理计划 |
| 基金编码 | SJD232 |
| 基金管理人 | 大越期货股份有限公司 |
| 基金托管人（如有） | 海通证券股份有限公司 |
| 投资顾问（如有） | - |
| 基金运作方式 | 开放式 |
| 基金成立日期 | 2019-11-01 |
| 期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元） | 713.159366 |
| 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 | 1.43 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 自基金合同生效起至今 | 22.33 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

备注：

|  |
| --- |
| - |

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

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 | 2021-07-01 | 至 | 2021-09-30 | (元) |
| 本期已实现收益 | 432,554.68 | | | |
| 本期利润 | 92,866.93 | | | |
| 期末基金净资产 | 7,523,533.82 | | | |
| 报告期期末单位净值 | 1.0550 | | | |

备注：

|  |
| --- |
| - |

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 | 24,865.63 |
| 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 | 1,390,261.67 |
| 存出保证金 | 406,740.00 |
| 股票投资 | 501,195.00 |
| 债券投资 | - |
| 其中：银行间市场债券 | - |
| 其中：利率债 | - |
| 其中：信用债 | - |
| 资产支持证券 | - |
| 基金投资（公募基金） | 5,256,267.85 |
| 其中：货币基金 | - |
| 期货及衍生品交易保证金 | 406,740.00 |
| 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 | 0.00 |
| 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 | - |
| 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 | 应收利息#11.20; |
| 基金负债情况 | 债券回购总额 | - |
| 融资、融券总额 | - |
| 其中：融券总额 | - |
| 银行借款总额 | - |
| 其他融资总额 | - |

4.2.1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 | 0 |
| B | 采矿业 | 0 | 0 |
| C | 制造业 | 116,974.00 | 1.55 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 0 | 0 |
| E | 建筑业 | 0 | 0 |
| F | 批发和零售业 | 0 | 0 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 0 | 0 |
| H | 住宿和餐饮业 | 0 | 0 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 0 | 0 |
| J | 金融业 | 224,396.00 | 2.98 |
| K | 房地产业 | 159,825.00 | 2.12 |
| L | 租赁和商务服务业 | 0 | 0 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 0 | 0 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 0 | 0 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | 0 | 0 |
| P | 教育 | 0 | 0 |
| Q | 卫生和社会工作 | 0 | 0 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 0 | 0 |
| S | 综合 | 0 | 0 |
|  | 合计 | 501,195.00 | 6.66 |

备注：

|  |
| --- |
| - |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 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（%） |
| 港股通 | 0.00 | 0.00 |
| 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 | 610.018250 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 103.141116 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 0.000000 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.000000 |
| 报告期期末基金份额总额 | 713.159366 |

**备注：**

|  |
| --- |
| - |

**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（如报告期内高管、基金经理及其关联基金经验、基金运作遵规守信情况、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）**

|  |
| --- |
| - |

|  |  |
| --- | --- |
| 信息披露报告是否经托管机构复核： | 是 |