

守朴价值 1 号私募证券投资基金 2022 年年度报告

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

| | |
|------------------------------|------------------|
| 基金名称 | 守朴价值 1 号私募证券投资基金 |
| 基金编码 | SEZ246 |
| 基金运作方式 | 开放式 |
| 基金成立日期 | 2019-01-21 |
| 基金管理人 | 上海守朴资产管理有限公司 |
| 基金托管人（如有） | 招商证券股份有限公司 |
| 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） | 5,979.195253 |
| 基金到期日期 | 2039-01-20 |

1.2 基金产品说明

| | |
|------------|--|
| 投资目标 | 本产品主要投资于债券等固定收益资产，在谨慎投资的前提下，力争获取持续稳定的投资收益。 |
| 投资策略 | 本产品将采取现金管理策略、利率策略、期限结构策略、信用策略、债券选择策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，以实现组合增值的目标。 |
| 业绩比较基准（如有） | 无 |
| 风险收益特征 | 本基金属于 R3 级（中风险）投资品种。 |

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 | | 上海守朴资产管理有限公司 | 招商证券股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 刘茜 | 韩鑫普 |
| | 联系电话 | 021-58956166 | 0755-82943666 |
| | 电子邮箱 | 392530350@qq.com | tgb@cmschina.com.cn |
| 传真 | | 021-58956166 | 0755-82960794 |
| 注册地址 | | 上海市虹口区东大名路 391-393 号（单号）4 层（集中登记地） | 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区民生路 1403 号 上海信息大厦 516 室 | 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 |
| 邮政编码 | | 200035 | 518000 |
| 法定代表人 | | 翟建业 | 霍达 |

1.4 信息披露方式

1、基金管理人官网：www.shoupufund.com 2、中国基金业协会指定的私募基金信息披露备份平台

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 | 招商证券股份有限公司 | 深圳市福田区福田街道福华一路111号 |
| 外包机构 | 招商证券股份有限公司 | 深圳市福田区福田街道福华一路111号 |
| - | - | - |

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 | 2022年 | 2021年 | 2020年 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期已实现收益 | 3,983,114.22 | 9,959,662.35 | 1,563,783.17 |
| 本期利润 | 4,246,981.71 | 10,590,069.67 | 1,890,279.60 |
| 期末数据和指标 | 2022年末 | 2021年末 | 2020年末 |
| 期末可供分配利润 | -6,775,300.68 | -9,189,547.33 | 1,779,460.90 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1133 | -0.1022 | 0.0934 |
| 期末基金净资产 | 60,716,671.49 | 92,454,661.20 | 23,204,371.31 |
| 报告期期末单位净值 | 1.0155 | 1.0281 | 1.2174 |
| 累计期末指标 | 2022年末 | 2021年末 | 2020年末 |
| 基金份额累计净值增长率（%） | 37.02 | 32.7000 | 21.7400 |

√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 | 3.26 | | | |
| 自基金合同生效起至今 | 37.02 | | | |

2.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：元

| 年度 | 每份基金份额分红 | 现金形式发放总 | 再投资形式发放 | 年度利润分 | 备注 |
|----|----------|---------|---------|-------|----|
| | | | | | |

| | 数 | 额 | 总额 | 配合计 | |
|------|--------|---------------|------|---------------|---|
| 2022 | 0.0558 | 5,503,779.25 | 0.00 | 5,503,779.25 | - |
| 2021 | 0.2989 | 52,031,368.48 | 0.00 | 52,031,368.48 | - |
| 2020 | 0.0000 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - |

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 | 8,992.942242 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 21,113.32994 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 24,127.076929 |
| 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/期末基金实缴总额 | 5,979.195253 |

4、管理人说明的其他情况

4.1、报告期内基金投资策略和业绩表现 截止 2022 年 12 月 31 日本基金期末基金单位净值为 1.0155 元，期末基金累计单位净值 1.3702 元。 4.2、报告期内基金估值程序 根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。 4.3、报告期内基金运作情况和运作杠杆情况 无。 4.4、报告期内投资收益分配和损失承担情况 本基金本报告期内进行利润分配 1 次，分配收益 5503779.25 元。 4.5、报告期内对本基金持有人数或基金资产净值预警情形 本报告期内，本基金未设置预警线及止损线。

5、托管人报告（如有）

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人——招商证券股份有限公司在对本基金的托管过程中，严格遵守有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

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

本托管人按照基金合同的约定，对本基金报告期的基金资产净值进行了复核；同时依据法律法规和基金合同规定，在托管人履行的投资监督范围内，对本基金报告期的投资情况进行了监督。在本基金合同约定的投资监督范围内，托管人未发现报告期内管理人违反基金

合同约定的事项。 报告期内，本基金的利润分配情况详见本报告中“2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况”部分。

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

基于基金管理人提供的必要的估值要素，本托管人参照《私募投资基金监督管理暂行办法》、《私募投资基金信息披露管理办法》等法律法规和基金合同的约定，对基金管理人报告中的主要财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容的真实性、准确性和完整性进行了复核，未发现异常。

6、年度财务报表

金额单位：元

6.1 资产负债表

| 资产 | 本期末 2022-12-31 | 上年度末 2021-12-31 |
|-----------------|-----------------------|------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 71,401.64 | 9,756.24 |
| 结算备付金 | 4,657,920.73 | 17,048.05 |
| 存出保证金 | 0.00 | 0.00 |
| 交易性金融资产 | 205,735.54 | 67,093,308.29 |
| 其中：股票投资 | 0.00 | 0.00 |
| 基金投资 | 0.00 | 0.00 |
| 债券投资 | 0.00 | 57,055,268.29 |
| 资产支持证券投资 | 205,735.54 | 10,038,040.00 |
| 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 | 23,561,228.00 |
| 应收证券清算款 | 0.00 | 0.00 |
| 应收利息 | 0.00 | 2,119,669.02 |
| 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 | 56,123,547.63 | 0.00 |
| 资产总计 | 61,058,605.54 | 92,801,009.60 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2022-12-31 | 上年度末 2021-12-31 |
| 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 | 0.00 | 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 | 113,481.31 | 127,708.56 |
| 应付托管费 | 9,078.48 | 10,216.72 |

| | | |
|---------------|---------------|---------------|
| 应付销售服务费 | 210,111.78 | 127,708.56 |
| 应付交易费用 | 0.00 | 0.00 |
| 应交税费 | 184.00 | 70,497.84 |
| 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 | 9,078.48 | 10,216.72 |
| 负债合计 | 341,934.05 | 346,348.40 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 59,791,952.53 | 89,929,422.42 |
| 未分配利润 | 924,718.96 | 2,525,238.78 |
| 所有者权益合计 | 60,716,671.49 | 92,454,661.20 |
| 负债和所有者权益总计 | 61,058,605.54 | 92,801,009.60 |

6.2 利润表

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| | 2022-01-01 至 2022-12-31 | 2021-01-01 至 2021-12-31 |
| 一、收入 | 5,378,579.25 | 12,155,488.64 |
| 1. 利息收入 | 274,935.45 | 7,305,402.70 |
| 其中：存款利息收入 | 21,199.26 | 32,562.08 |
| 债券利息收入 | 0.00 | 2,883,547.66 |
| 资产支持证券利息收入 | 0.00 | 1,252,523.71 |
| 买入返售金融资产收入 | 253,736.19 | 3,136,769.25 |
| 其他利息收入 | 0.00 | 0.00 |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 4,902,342.10 | 4,570,787.88 |
| 其中：股票投资收益 | 0.00 | 0.00 |
| 基金投资收益 | 0.00 | -0.64 |
| 债券投资收益 | 1,983,796.17 | 4,558,826.03 |
| 资产支持证券投资收益 | -187,124.46 | 11,960.00 |
| 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 | 2.48 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列） | 263,867.49 | 630,407.32 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”填列） | 0.00 | 0.00 |
| 5. 其他收入（损失以“-”填列） | -62,565.79 | -351,109.26 |
| 减：二、费用 | 1,131,597.54 | 1,565,418.97 |
| 1. 管理人报酬 | 516,424.95 | 694,937.33 |
| 其中：固定管理费 | 514,199.80 | 694,937.33 |

| | | |
|--------------------------------|--------------|---------------|
| 业绩报酬 | 2,225.15 | 0.00 |
| 2. 托管费 | 41,136.00 | 55,595.04 |
| 3. 销售服务费 | 514,199.80 | 694,937.33 |
| 4. 外包服务费 | 41,136.00 | 55,595.04 |
| 5. 交易费用 | 5,141.90 | 21,858.14 |
| 6. 利息支出 | 0.00 | 0.00 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 0.00 | 0.00 |
| 7. 其他费用 | 13,558.89 | 42,496.09 |
| 三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列) | 4,246,981.71 | 10,590,069.67 |
| 减：所得税费用 | 0.00 | 0.00 |
| 四、净利润 (净亏损以“-”号填列) | 4,246,981.71 | 10,590,069.67 |

6.3 所有者权益变动表

| 项目 | 本期 2022-01-01 至 2022-12-31 | | |
|--|------------------------------------|---------------|----------------|
| | 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） | 89,929,422.42 | 2,525,238.78 | 92,454,661.20 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | 0.00 | 4,246,981.71 | 4,246,981.71 |
| 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） | -30,137,469.89 | -343,722.28 | - |
| 其中：1. 基金申购款 | 211,133,299.40 | 3,706,700.60 | 214,840,000.00 |
| 2. 基金赎回款 | -241,270,769.29 | - | - |
| 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 | - | -5,503,779.25 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 59,791,952.53 | 924,718.96 | 60,716,671.49 |
| 项目 | 上年度可比期间 2021-01-01 至 2021-12-31 | | |
| | 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） | 19,060,137.33 | 4,144,233.98 | 23,204,371.31 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | 0.00 | 10,590,069.67 | 10,590,069.67 |
| 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 | 70,869,285.09 | 39,822,303.61 | 110,691,588.70 |

| | | | |
|--|-----------------|----------------|-----------------|
| 填列) | | | |
| 其中：1. 基金申购款 | 291,615,423.75 | 63,594,576.25 | 355,210,000.00 |
| 2. 基金赎回款 | -220,746,138.66 | -23,772,272.64 | -244,518,411.30 |
| 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 | -52,031,368.48 | -52,031,368.48 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 89,929,422.42 | 2,525,238.78 | 92,454,661.20 |

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 | 71,401.64 |
| 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 | 4,657,920.73 |
| | 存出保证金 | |
| | 股票投资 | |
| | 债券投资 | |
| | 其中：银行间市场债券 | |
| | 其中：利率债 | |
| | 其中：信用债 | 0.00 |
| | 资产支持证券 | 205,735.54 |
| | 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 | 0.00 |
| | 买入返售金融资产 | 0.00 |
| | 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 | STT666#56123547.63; |
| | 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 | |
| | 融资、融券总额 | |
| | 其中：融券总额 | |
| | 银行借款总额 | |
| | 其他融资总额 | |

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 |

| 序号 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|---------------|------|---------------|
| 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 |

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 (%) |
|----------|-----------|---------------|
| 能源 | 0.00 | 0.00 |
| 原材料 | 0.00 | 0.00 |
| 工业 | 0.00 | 0.00 |
| 非日常生活消费品 | 0.00 | 0.00 |
| 日常消费品 | 0.00 | 0.00 |
| 医疗保健 | 0.00 | 0.00 |
| 金融 | 0.00 | 0.00 |
| 信息技术 | 0.00 | 0.00 |
| 通讯业务 | 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 |

8、信息披露报告

此处请上传管理人向投资者披露的信息披露报告 pdf 文件，需加盖管理人公章。

请点击工具栏上“附件列表”按钮上传附件。

信息披露报告是否经托管机构复核：是

