

守朴价值1号私募证券投资基金

2023年第1季度报告

1、基金基本情况

| | |
|--------------------------|--|
| 项目 | 信息 |
| 基金名称 | 守朴价值1号私募证券投资基金 |
| 基金编号 | SEZ246 |
| 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) | - |
| 基金运作方式 | 开放式 |
| 基金成立日期 | 2019年01月21日 |
| 期末基金总份额(万份)/期末基金实缴总额(万元) | 4,684.860977 |
| 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) | - |
| 风险收益特征 | 本基金属于R3级(中风险)投资品种。 |
| 信息披露报告是否经托管机构复核 | 是 |

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 | 1.57 | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 39.17 | - | - | - |

注:净值增长率等于(期末累计净值-期初累计净值)/期初累计净值
当季净值增长率等于(本季度末累计净值-上季度末累计净值)/上季度末累计净值

3、主要财务指标

金额单位:元

| 项目 | 2023-01-01至2023-03-31 |
|-----------|-----------------------|
| 本期已实现收益 | 157,152.25 |
| 本期利润 | 1,058,915.14 |
| 期末基金净资产 | 48,583,292.26 |
| 报告期期末单位净值 | 1.0370 |

4、投资组合报告

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 | 25,916.91 | |
| 境内未上市、未挂牌公司股权投资 | 银行存款 | 25,916.91 |
| | 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 | 1,238.88 |
| 境内证券投资规模 | 存出保证金 | 0.00 |
| | 股票投资 | 0.00 |
| | 债券投资 | 0.00 |
| | 其中：银行间市场债券 | 0.00 |
| | 其中：利率债 | 0.00 |
| | 其中：信用债 | 0.00 |
| | 资产支持证券 | 214,037.73 |
| | 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 | STT666#48,478,116.51; |
| 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 | 0.00 |
| 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 |

证券
资产
核算
2030

| | |
|--------|------|
| 其他融资总额 | 0.00 |
|--------|------|

4.2 期末按行业分类的股票投资组合(不含港股通)

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 |

4.3 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 (%) |
|----------|-----------|---------------|
| 原材料 | 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 |
| 能源 | 0.00 | 0.00 |
| 金融 | 0.00 | 0.00 |
| 医疗保健 | 0.00 | 0.00 |
| 工业 | 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 |

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 | 5,979.195253 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 0.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 1,294.334276 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.00 |
| 期末基金总份额/期末基金实缴总额 | 4,684.860977 |

6、管理人报告

6.1、报告期内基金投资策略和业绩表现

截止 2023 年 03 月 31 日本基金期末基金单位净值为 1.0370 元，期末基金累计单位净值 1.3917 元。

6.2、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。

6.3、报告期内基金运作情况和运作杠杆情况

无。

6.4、报告期内投资收益分配和损失承担情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.5、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。

托管人复核说明：本基金托管人按照相关法律法规、基金合同的规定，对本基金在本报告中的财务数据进行了复核。对按照规定应由托管人复核的数据，托管人无异议。