

茂典资产盛典季开纯债1号私募证券投资基金 2024年第二季度报告

基金管理人：上海茂典资产管理有限公司
基金托管人：兴业证券股份有限公司



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	茂典资产盛典季开纯债 1 号私募证券投资基金
基金编码	SGV011
基金管理人	上海茂典资产管理有限公司
基金托管人 (如有)	兴业证券股份有限公司
投资顾问 (如有)	-
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2019-07-04
期末基金总份额 (万份) / 期末基金实缴总额 (万元)	600.81184
投资目标	在严格控制投资风险的前提下, 力求获得长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金将根据宏观经济分析和整体市场估值水平的变化自上而下的进行资产配置降低市场风险。
业绩比较基准 (如有)	-
风险收益特征	中等风险中等收益

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	-3.2558	0.00	0.00	0.00
自基金合同生效起至今	-37.6000	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	2024-04-01 至 2024-06-30
本期已实现收益	36,594.76
本期利润	0.00

期末基金净资产	3,746,173.44
报告期期末单位净值	0.6240

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	63,044.66	
境内未上市、未挂牌公司股权投资	银行存款	63,044.66
	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	-
	存出保证金	24.23
	股票投资	-
	债券投资	1,309,146.14
	其中：银行间市场债券	-
	其中：利率债	-
	其中：信用债	1,309,146.14
	资产支持证券	2,116,140.47
	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	-
	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	应收债券利息#156,911.54； 应收资产支持证券利息#165,547.64
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	应交税费#64641.24；

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	0	0
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	0	0
K	房地产业	0	0
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	0	0

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	623.952813
报告期期间基金总申购份额	0.000000
减：报告期期间基金总赎回份额	23.140973
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	600.81184

备注:

-基金份额的变动，系因基金财产的清算分配所致。

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、基金运作合规守信情况、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)

报告期内，本基金投资运作符合基金合同的约定。

截止到报告期末，本管理人委托兴业证券股份有限公司为本基金提供估值核算服务。对于与基金资产有关的估值与会计核算问题，经相关当事人在平等基础上充分讨论后，达成一致意见。

(1) 本基金成立前，本管理人协调本基金其他当事人商定本基金的估值与会计核算方法。

(2) 在本基金的存续期内，本基金管理人定期评估基金估值与会计核算方法的合理性。

(3) 在本基金的运作过程中，经济环境发生重大变化且对基金资产的估值产生重大影响的，由本管理人协调本基金其他当事人采取必要措施，调整估值方法。

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

