

## 基本信息

管理人	上海勤辰私募基金管理合伙企业(有限合伙)	投资策略	股票多头策略
投资经理	崔莹	成立时间	2022年7月18日
存续期限	20年	托管机构	国泰君安证券股份有限公司
期末单位净值	0.9310	期末累计净值	0.9310

注: 以上为交易层母基金的基金信息, 投资人持有产品如为交易层母基金下子基金的, 相关费率和开放日以子基金合同约定内容为准

## 业绩风险指标

本月收益率	-2.34%
今年以来收益率	-2.34%
成立以来收益率	-6.90%
前十大股票占比*	19.61%
运作以来夏普比率	-0.75
运作以来卡玛比率	-0.51
运作以来月度最大回撤	-9.54%

注: 前十大股票占比=前十大重仓股市值/基金资产净值×100%

## 净值曲线



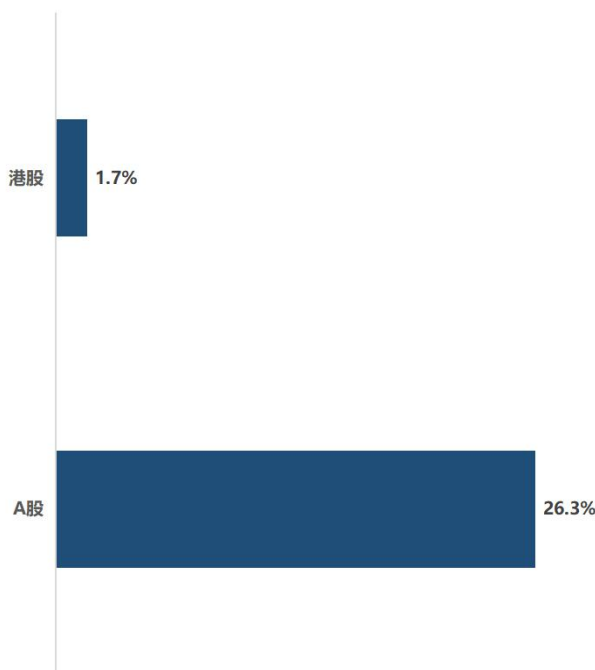
注: 因需办理基金业协会备案、证券账户开立等事宜, 产品正式运作时间为2022年8月12日。

## 业绩表现 (按产品净值算)

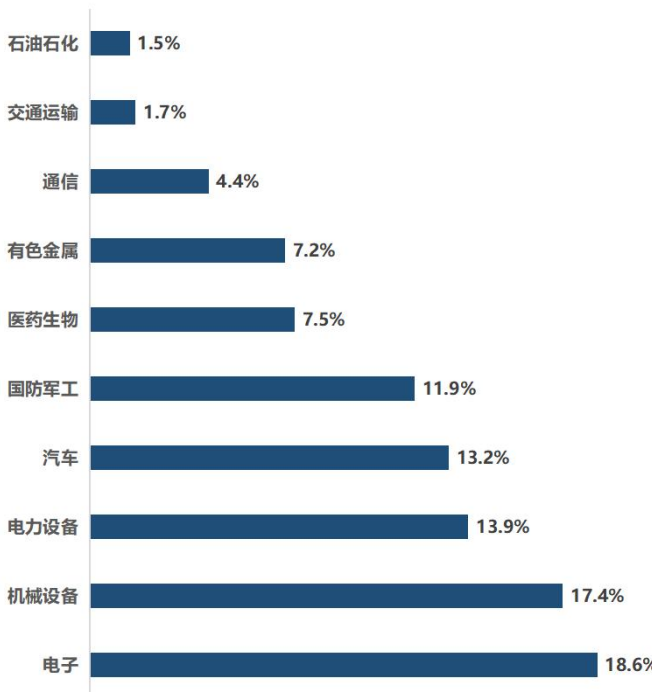
月度收益	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	年度累计
2022年	-	-	-	-	-	-	-0.01%	-0.30%	-2.43%	3.80%	-3.23%	-3.01%	-5.23%
2023年	2.90%	0.71%	1.49%	1.70%	-2.40%	4.03%	-3.52%	-2.21%	-1.39%	-1.91%	1.12%	0.37%	0.59%
2024年	-2.34%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-2.34%

注: 产品正式运作时间为2022年8月12日, 前期净值波动为费用扣除与现金管理

## 投资组合比例



## 前十大行业分布 (申万一级)



免责声明: 本报告为内部资料, 具有保密性, 仅限收件人且基金持有人阅读使用, 未经管理人书面许可, 收件人不得以任何方式转载或提供给第三方, 或整体或部分地用于其他商业用途。本报告信息仅供参考, 不构成任何具有法律约束力之产品投资要约或要约邀请, 并且不可用于对投资的评估, 亦非对任何交易的正式确认。本报告所载信息和资料的来源皆被本公司认为可靠, 但本公司对其准确性、充分性、完整性及其使用的适当性等不作任何担保。产品的过往业绩不代表任何确定性判断, 并不预示其未来表现, 亦不作为管理人其他产品业绩表现的保证。市场有风险, 投资需谨慎。

## 市场回顾

基于流动性风险考虑, 我们在1月减仓了部分中小市值公司的持仓

## 市场展望

投资的本质是寻找一个个风险收益比不对称的机会, 而不是买入以后祈祷或者抱怨市场环境

2024年我们看好的方向包括

- 1、以人工智能为代表的MT行业;
- 2、具有全球竞争力的出口产业链, 分散在机械, 医药, 轻工等行业;
- 3、高股息资产;
- 4、部分颇具竞争力的央国企