

稳博 500 指数增强多策略 1 号私募证券投资基金

2024 年第 1 季度报告



1. 基金基本情况

| 项目 | 信息 |
|--------------------------|-----------------------------|
| 基金名称 | 稳博 500 指数增强多策略 1 号私募证券投资基金 |
| 基金编码 | SLS211 |
| 基金管理人 | 上海稳博投资管理有限公司 |
| 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 | 2020 年 09 月 01 日 |
| 期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元） | 4,534.455753 |
| 投资目标 | 在控制风险的前提下，实现客户资产长期、持续、稳定的增值 |
| 投资策略 | 复合策略 |
| 业绩比较基准（如有） | 无 |
| 风险收益特征 | 本基金属于 R4 级（中高风险）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 | -3.54 | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 44.36 | - | - | - |

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

2.1 分级基金净值表现

LS211A 级基金净值表现

| 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 | -3.83 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 自基金合同生效起至今 | 39.54 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

LS211B 级基金净值表现

| 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 | -3.44 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 自基金合同生效起至今 | 24.82 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

3、主要财务指标

金额单位：元

| 项目 | 2024-01-01 至 2024-03-31 |
|-----------|-------------------------|
| 本期已实现收益 | -4,033,252.54 |
| 本期利润 | -3,260,528.35 |
| 期末基金净资产 | 42,721,935.52 |
| 报告期期末单位净值 | 0.9422 |

3.1 分级基金主要财务指标

LS211A 级主要财务指标

金额单位：元

| 项目 | 2024-01-01 至 2024-03-31 |
|-----------|-------------------------|
| 本期已实现收益 | -1,123,029.72 |
| 本期利润 | -1,054,704.22 |
| 期末基金净资产 | 10,824,752.16 |
| 报告期期末单位净值 | 0.9391 |

LS211B 级主要财务指标

金额单位：元

| 项目 | 2024-01-01 至 2024-03-31 |
|-----------|-------------------------|
| 本期已实现收益 | -2,910,222.82 |
| 本期利润 | -2,205,824.13 |
| 期末基金净资产 | 31,897,183.36 |
| 报告期期末单位净值 | 0.9432 |

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 | 银行存款 | 1,833.25 |
| 境内未上市、未挂牌公司股权投资 | 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 | 1,695,750.33 |
| | 存出保证金 | 126,532.80 |
| 境内证券投资规模 | 股票投资 | 41,854,141.90 |
| | 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 | 0.00 |
| | 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 | 126,532.80 |
| | 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 | 0.00 |
| | 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 |
| | 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 | 238,807.00 | 0.56 |
| B | 采矿业 | 1,460,582.56 | 3.42 |
| C | 制造业 | 26,634,152.41 | 62.34 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,616,920.20 | 3.78 |
| E | 建筑业 | 876,685.87 | 2.05 |
| F | 批发和零售业 | 1,536,472.00 | 3.60 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,108,988.00 | 2.60 |
| H | 住宿和餐饮业 | 15,400.00 | 0.04 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,567,341.26 | 8.35 |
| J | 金融业 | 1,142,101.58 | 2.67 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| K | 房地产业 | 668,268.58 | 1.56 |
| L | 租赁和商务服务业 | 572,904.00 | 1.34 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 548,085.36 | 1.28 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 367,194.08 | 0.86 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | 0.00 | 0.00 |
| P | 教育 | 3,948.00 | 0.01 |
| Q | 卫生和社会工作 | 133,060.00 | 0.31 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,341,675.00 | 3.14 |
| S | 综合 | 21,556.00 | 0.05 |
| | 合计 | 41,854,141.90 | 97.97 |

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 | 5,046.983171 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 84.087969 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 596.615387 |
| 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 | 4,534.455753 |

5.1 分级基金基金份额变动情况

LS211A 级基金份额变动情况

单位：万份/万元

| | |
|----------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,446.882734 |
| 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 | 294.204379 |

| | |
|---------------------------|--------------|
| 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 | 1,152.678355 |

LS211B 级基金份额变动情况

单位：万份/万元

| | |
|---------------------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 3,600.100437 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 84.087969 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 302.411008 |
| 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 | 3,381.777398 |

6、管理人报告

1) 基金运作遵规守信情况： 本报告期内，本基金管理人严格遵守《私募投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、基金合同等规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。 报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。2) 基金估值程序： 截止到报告期末，本管理人委托招商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，经济环境未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。 本报告期内，托管人根据《私募投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、基金合同等规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督。 报告期内，管理人在本基金的投资运作遵规守信、净值计算、基金份额申购赎回价格、基金费用开支及利润分配等情况下，托管人未发现管理人存在损害份额持有人利益的行为。

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。