石锋资产大巧2号私募证券投资基金

2022年2季度报告

SEP776 石锋资产大巧2号私募证券投资基金
上海石锋资产管理有限公司

基金管理人：上海石锋资产管理有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	石锋资产大巧2号私募证券投资基金
基金编码	SEP776
基金管理人	上海石锋资产管理有限公司
基金托管人（如有）	国泰君安证券股份有限公司
投资顾问（如有）	
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2018-11-01
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	14,295.816926
投资目标	本基金在深入研究的基础上构建投资组合，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	本基金坚持产业研究推动的投资，自上而下通过宏观研究挖掘宏观经济中的关键点，在关键点上进行自下而上的盈利模式研究。选取标的公司，并跟踪公司报表变化，力争在合适的价格买入股票并中长期持有，赚取的公司业绩成长的钱。放弃对市场风格的选择，减少对市场走势的判断，力争通过对公司及行业的深度分析，寻找具备高壁垒的“好生意”，等待合理的价格买入，长期并集中持有，赚取公司业绩增长带来的股票收益。采用均衡配置行业和股票的组合投资模式，力争降低单一行业和股票给组合带来的风险。
业绩比较基准（如有）	
风险收益特征	本基金属于成长级（R4）风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力为成长型（C4）及以上的合格投资者。

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	6.66	0.96	-	-
自基金合同生效起至今	146.50	1.44	-	-

石锋资产大巧2号私募证券投资基金A

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	6.99	0.97	-	-
自基金合同生效起至今	163.20	1.43	-	-

石锋资产大巧2号私募证券投资基金B

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	6.57	0.96	-	-
自基金合同生效起至今	145.10	1.43	-	-

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）/上季度末累计净值

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

SEP776 石锋资产大巧2号私募证券投资基金 上海石锋资产管理有限公司

金额单位：元

项目	2022-04-01	至	2022-06-30	(元)
本期已实现收益				-16,599,895.20
本期利润				22,070,000.36
期末基金资产净值				310,550,351.67
期末基金份额净值				2.172

石锋资产大巧2号私募证券投资基金A

项目	2022-04-01	至	2022-06-30	(元)
本期已实现收益				-1,230,637.65
本期利润				1,896,447.62
期末基金资产净值				25,659,771.71
期末基金份额净值				2.339

石锋资产大巧2号私募证券投资基金B

项目	2022-04-01	至	2022-06-30	(元)
本期已实现收益				-15,369,257.55
本期利润				20,173,552.74
期末基金资产净值				284,890,579.96
期末基金份额净值				2.158

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

序号	项目	金额 人民币
1	银行存款	1,267,472.61
2	股权投资	
3	其中：优先股	
4	其他股权类投资	
5	上市公司定向增发股票投资	
6	新三板挂牌企业投资	
7	结算备付金	29,964,191.78
8	存出保证金	
9	股票投资	229,227,407.17
10	债券投资	
11	其中：银行间市场债券	
12	其中：利率债	
13	其中：信用债	
14	资产支持证券	
15	基金投资（公募基金）	20,371,225.00
16	其中：货币基金	

SEP776 石锋资产大巧2号私募证券投资基金 上海石锋资产管理有限公司

17	期货及衍生品交易保证金	
18	买入返售金融资产	32,989,329.89
19	其他证券类标的	
20	商业银行理财产品投资	
21	信托计划投资	
22	基金公司及其子公司资产管理计划投资	
23	保险资产管理计划投资	
24	证券公司及其子公司资产管理计划投资	
25	期货公司及其子公司资产管理计划投资	
26	私募基金产品投资	
27	未在协会备案的合伙企业份额	
28	另类投资	
29	银行委托贷款规模	
30	信托贷款	
31	应收账款投资	
32	各类受（收）益权投资	
33	票据（承兑汇票等）投资	
34	其他债权投资	
35	境外投资	
36	其他资产	应收股利#514059.49；
37	债券回购总额	
38	融资、融券总额	
39	其中：融券总额	
40	银行借款总额	
41	其他融资总额	

注：

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

4.2、报告期末按行业分类的股票投资组合

4.2.1、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	18,079,076.00	5.82
C	制造业	179,622,275.55	57.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	1,485,396.00	0.48
F	批发和零售业	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	586,365.00	0.19
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	651,513.05	0.21
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	6,414,462.00	2.07
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

SEP776 石锋资产大巧2号私募证券投资基金 上海石锋资产管理有限公司

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	1,020,756.00	0.33
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
S	综合	0.00	0.00
	合计	207,859,843.60	66.93

注：

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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(%)
基础材料	0.00	0.00
消费者非必需品	4,928,945.84	1.59
消费者常用品	0.00	0.00
能源	0.00	0.00
金融	0.00	0.00
医疗保健	11,411,599.48	3.67
工业	0.00	0.00
信息技术	0.00	0.00
电信服务	0.00	0.00
公用事业	0.00	0.00
房地产	5,027,018.25	1.62
合计	21,367,563.57	6.88

注：

以上分类采用全球行业标准 (GICS)。

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	15,061.619862
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	765.802936
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.000000
期末基金总份额/期末基金实缴总额	14,295.816926

石锋资产大巧2号私募证券投资基金A

报告期期初基金份额总额	1,096.849685
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	0.000000
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.000000
期末基金总份额/期末基金实缴总额	1,096.849685

石锋资产大巧2号私募证券投资基金B

报告期期初基金份额总额	13,964.770177

SEP776 石锋资产大巧2号私募证券投资基金 上海石锋资产管理有限公司

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	765.802936
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.000000
期末基金总份额/期末基金实缴总额	13,198.967241

注：
如为分级基金，应按级别分别列示。

6、管理人报告

6.1 报告期内高管、基金经理及其管理基金经验

报告期内，基金经理无变动。

6.2 报告期内基金运作遵规守信情况

报告期内，本基金投资运作符合基金合同的约定。

6.3 报告期内基金投资策略和业绩表现

报告期内，基金投资策略未发生变动，业绩表现详见季报“2.基金净值表现”章节。

6.4 报告期内对宏观经济及其行业走势展望

A股市场在5-6月份期间走出了全球的独立行情，这反映了国内疫情的缓解及社会经济生活的适当恢复，但是需要看清楚的是，国内的经济也不会非常快速恢复。但是国内的流动性又是极其充沛的状态，所以国内资本市场在基本面平淡和流动性充沛的局面下，预计会走出轻指数重结构的市场格局。

6.5 报告期内内部基金监察稽核工作

不涉及。

6.6 报告期内基金估值程序

截止到报告期末，本管理人委托国泰君安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。

6.7 报告期内基金运作情况和运用杠杆情况

截至报告期末，本基金资产总值为314,333,685.94元，净资产为310,550,351.67元，本基金总资产与净资产的比例为101.22%。

6.8 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。

6.9 报告期内会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项

不涉及。

6.10 报告期内对本基金持有人数或基金资产净值预警情形

不涉及。

6.11 报告期内可能存在的利益冲突

不涉及。

SEP776 石锋资产大巧2号私募证券投资基金 上海石锋资产管理有限公司

6.12 报告期内其他说明情况

无。

6.13 托管人意见

本报告期内，托管人根据《私募投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定和基金合同的约定，对本基金管理人编制的定期报告进行如下复核确认： 报告期内，托管人对管理人所编制的本报告中的财务数据进行了复核，确认所复核内容准确。 报告期内，托管人依据基金合同约定对本基金投资运作情况进行了监督，未发现不符合基金合同约定的情况。

信息披露报告是否经托管机构复核：是

SEP776 石锋资产大巧2号私募证券投资基金
上海石锋资产管理有限公司

中国银河证券股份有限公司
资产托管业务
信息披露专用章