

龙全 5 号私募证券投资基金 2022 年第 4 季度报告

1、基金基本情况

| 项目 | 信息 |
|--------------------------|--|
| 基金名称 | 龙全 5 号私募证券投资基金 |
| 基金编码 | SJR651 |
| 基金管理人 | 上海龙全投资管理有限公司 |
| 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 03 月 06 日 |
| 期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元） | 5,122.555954 |
| 投资目标 | 通过科学扎实的基本面研究，选择稳健的交易策略，实现基金资产的长期收益最大化。 |
| 投资策略 | 股票价值投资策略。 |
| 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 | -13.56 | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 106.43 | - | - | - |

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 | 2022-10-01 至 2022-12-31 |
|-----------|-------------------------|
| 本期已实现收益 | 4,486,077.44 |
| 本期利润 | 12,166,214.19 |
| 期末基金净资产 | 105,742,771.51 |
| 报告期期末单位净值 | 2.0643 |

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 | 19,540.97 |
| 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 | 90,653.02 |
| 境内证券投资规模 | 存出保证金 | 7,500,000.50 |
| | 股票投资 | 98,140,338.39 |
| | 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 | 7,500,000.50 |
| | 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 |
| 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 | 其他资产#149,490.62； |
| 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 | 11,734,125.00 | 11.10 |
| B | 采矿业 | 0.00 | 0.00 |
| C | 制造业 | 43,686,457.13 | 41.31 |
| 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 | 5,532,480.00 | 5.23 |
| 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 | 1,909,336.95 | 1.81 |
| 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 | 12,245,850.48 | 11.58 |
| 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 | 75,108,249.56 | 71.03 |

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 | 5,493,136.48 | 5.19 |
| 日常消费品 | 2,024,429.68 | 1.91 |
| 能源 | 0.00 | 0.00 |
| 金融 | 8,385,071.55 | 7.93 |
| 医疗保健 | 3,887,719.78 | 3.68 |
| 工业 | 141,762.40 | 0.13 |
| 信息技术 | 25,114.75 | 0.02 |
| 通讯业务 | 461,689.28 | 0.44 |
| 公用事业 | 351,549.29 | 0.33 |
| 房地产 | 2,261,615.62 | 2.14 |
| 合计 | 23,032,088.83 | 21.78 |

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 | 4,946.560214 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 175.99574 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 0.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额） | 0.00 |

| | |
|------------------|--------------|
| 减少以“-”填列) | |
| 期末基金总份额/期末基金实缴总额 | 5,122.555954 |

6、管理人报告

回顾四季度，A股和港股在加速探底后，随着防疫政策调整，地产政策持续放松，及美联储加息节奏放缓的预期下。A股和港股走出一波反弹行情，尤其是深度下跌后的港股反弹更为猛烈。展望2023年，外部流动性收紧基本结束，全球流动性预期稳定；国内地产政策和防疫政策均已转向，国内经济有望见底后迎来一波新的增长。我们将在这种相对温和的环境中，积极在自主可控、新能源汽车、农业和医药生物等板块挖掘符合龙全低估+优质的好公司，来为投资人获取持续的超额收益。

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。