

龙全 5 号私募证券投资基金 2022 年年度报告

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	龙全 5 号私募证券投资基金
基金编码	SJR651
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2020 年 03 月 06 日
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)	-
期末基金总份额 (万份) / 期末基金实缴总额 (万元)	5,122.555954
基金到期日期	2040 年 03 月 05 日

1.2 基金产品说明

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)	-
风险收益特征	本基金属于 R4 级 (中高风险) 投资品种。

1.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上海龙全投资管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘艳萍
	联系电话	021-50760368
	电子邮箱	tqinghua_ok@126.com
传真	-	0755-82960794
注册地址	上海市虹口区海宁路 137 号 7 层 C 座 774D 室	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
办公地址	上海市浦东新区祖冲之路 2290 号 1 号楼 301A 室	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码	201210	518000
法定代表人	谭清华	霍达

1.4 信息披露方式

基金管理人有权采用下列一种或多种方式向基金份额持有人提供报告或进行相关通知。

1、传真、电子邮件或短信

如基金份额持有人留有传真号、电子邮箱或手机号等联系方式，基金管理人可通过传真、电子邮件或短信等方式将报告信息告知基金份额持有人。

2、邮寄服务

基金管理人可向基金份额持有人邮寄年度报告等有关本基金的信息。基金份额持有人在募集机构留存的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，基金份额持有人应当及时以书面方式或以基金管理人规定的其他方式通知基金管理人。

3、基金管理人网站

基金管理人可通过基金管理人网站向基金份额持有人提供报告和信息查询，内容包括但不限于净值报告、季度报告、年度报告。

4、基金管理人指定的其他信息披露途径或方式

基金管理人可通过基金管理人指定的其他信息披露途径或方式向基金份额持有人提供报告和信息查询，内容包括但不限于净值报告、季度报告、年度报告，报告和信息的真实性、准确性、合法性、及时性由基金管理人负责。

5、其他中国证监会以及中国基金业协会规定的信息披露途径或方式。

1.5 其他相关资料（如有）

项目	名称	办公地址
会计师事务所	-	-
注册登记机构	招商证券股份有限公司	深圳市福田区福田街道福华一路111号
外包机构	招商证券股份有限公司	深圳市福田区福田街道福华一路111号
--	-	-

2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

2.1 主要会计数据和财务指标

期间数据和指标	2022年	2021年	2020年
本期已实现收益	239,397.52	12,175,309.25	4,415,511.09
本期利润	-8,982,103.04	14,907,160.56	5,533,670.49
期末数据和指标	2022年末	2021年末	2020年末
期末可供分配利润	44,786,364.35	37,594,052.91	6,514,867.20
期末可供分配基金份额利润	0.8743	0.8608	0.3510
期末基金净资产	105,742,771.51	97,384,090.68	28,935,370.49
报告期期末单位净值	2.0643	2.2298	1.5588
累计期末指标	2022年末	2021年末	2020年末
基金份额累计净值增长率	106.43%	122.98%	55.88%

2.2 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(%)
当年	-7.42	-	-	-
自基金合同生效起至今	106.43	-	-	-

注：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当年净值增长率=（本年度末累计净值-上年度末累计净值）/上年度末累计净值

2.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	每份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022	0.00	0.00	0.00	0.00	-
2021	0.00	0.00	0.00	0.00	-
2020	0.00	0.00	0.00	0.00	-

3、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	4,367.340482
报告期期间基金总申购份额	1,337.493776
减：报告期期间基金总赎回份额	582.278304
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	5,122.555954

4、管理人说明的其他情况

4.1、报告期内高管、基金经理及其管理基金经验

基金经理李龙全，上海龙全投资管理有限公司投资总监，中国矿业大学硕士，具备良好的经济理论基础，和扎实的证券研究经验和投资管理经验，管理业绩持续表现良好。

4.2、基金运作合规守信情况

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《私募基金投资监督管理办法》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3、报告期内基金投资策略和业绩表现

截止2022年12月31日本基金期末基金单位净值为2.0643元，期末基金累计单位净值2.0643元。

4.4、报告期内对宏观经济、证券市场及其行业走势展望

2022年，A股和港股市场在全球流动性紧缩、地缘事件、国内疫情三方面叠加下，震荡下行，全年最终录得自2018年以来的最大年度跌幅。龙全虽然在一季度也随市场出现回撤，但经过二季

度的反弹，积极调整持仓布局，在下半年显著跑赢市场，全年最终表现好于市场基准。展望 2023 年，我们看到压制 2022 年的三大因素，将均有好转，但也不可轻易乐观。流动紧缩必然告一段落，但是仍不会立刻转向大幅宽松的情形。国内的经济复苏在疫情反复持续三年后，也有待观察。不过总体投资环境仍然要温和于 2022 年，所以我们继续围绕自主可控、新能源汽车、农业和医药生物等板块挖掘低估优质的好公司，来为投资人获取持续的超额收益。

4.5、报告期内基金估值程序

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.6、报告期内基金运作情况和运作杠杆情况

截至报告期末，本基金资产总值为 106,151,180.30 元，净资产为 105,742,771.51 元，本基金总资产与净资产的比例为 100.39%

4.7、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。

4.8、报告期内对本基金持有人数或基金资产净值预警情形

本报告期内，本基金设置了预警线，未设置止损线，且在报告期间内，本基金未曾触及预警线。

5、托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人——招商证券股份有限公司在对本基金的托管过程中，严格遵守有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人按照基金合同的约定，对本基金报告期的基金资产净值进行了复核；同时依据法律法规和基金合同规定，在托管人履行的投资监督范围内，对本基金报告期的投资情况进行了监督。在本基金合同约定的投资监督范围内，托管人未发现报告期内管理人违反基金合同约定的事项。报告期内，本基金的利润分配情况详见本报告中“2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况”部分。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

基于基金管理人提供的必要的估值要素，本托管人参照《私募投资基金监督管理暂行办法》、《私募投资基金信息披露管理办法》等法律法规和基金合同的约定，对基金管理人报告中的主要财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容的真实性、准确性和完整性进行了复核，未发现异常。

6、年度财务报表

6.1 资产负债表

金额单位：元

资产	2022-12-31	2021-12-31
资产：		
银行存款	19,540.97	549,916.61
结算备付金	90,653.02	661,884.37
存出保证金	7,500,000.50	0.00
交易性金融资产	98,140,338.39	96,792,337.01
其中：股票投资	98,140,338.39	96,792,337.01
基金投资	0.00	0.00
债券投资	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
贵金属投资	0.00	0.00
衍生金融资产	251,156.80	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00
应收证券清算款	149,490.62	0.00
应收利息	0.00	145.82
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
递延所得税资产	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产总计	106,151,180.30	98,004,283.81
负债和所有者权益	2022-12-31	2021-12-31
负债：		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	381,871.52	425,141.44
应付托管费	6,364.55	10,361.31
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	52.40	0.00
应交税费	13,755.77	174,329.07
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
递延所得税负债	0.00	0.00

其他负债	6,364.55	10,361.31
负债合计	408,408.79	620,193.13
所有者权益：		
实收基金	51,225,559.54	43,673,404.82
未分配利润	54,517,211.97	53,710,685.86
所有者权益合计	105,742,771.51	97,384,090.68
负债和所有者权益总计	106,151,180.30	98,004,283.81

注：1、其他资产：未被统计进前列分类的资产科目，主要包括其他私募基金、基金公司专户、券商资管计划、有限合伙企业股权、未上市企业股权等。

2、其他负债：未被统计进前列分类的负债科目，主要包括应付外包服务费、应付投资顾问费、应付咨询服务费等。

3、6.1 资产负债表中“股票投资”统计所有股票（含新三板股票）投资市值，7.1 章节中“股票投资”统计除新三板投资和上市公司定向增发股票投资以外的市值，新三板投资和上市公司定向增发股票投资有单独指标统计。

4、6.1 资产负债表中“应收股利”、“应收申购款”、“应收利息”单独列示，“其他资产”是总资产与已列示明细资产项的轧差项，7.1 期末基金资产组合情况中“其他资产”中除总资产与已列示明细资产项的轧差项外，还包含“应收股利”、“应收申购款”、“应收利息”。

6.2 利润表

金额单位：元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022年12月31日	2021年01月01日至2021年12月31日
一、收入	-7,070,743.66	15,945,838.90
1. 利息收入	6,110.83	5,595.19
其中：存款利息收入	6,110.83	5,362.00
债券利息收入	0.00	233.19
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产收入	0.00	0.00
其他利息收入	0.00	0.00
2. 投资收益（损失以“-”填列）	2,181,162.45	13,592,940.77
其中：股票投资收益	1,253,729.16	12,977,580.74
基金投资收益	0.00	0.00
债券投资收益	0.00	225,013.85
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
贵金属投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	927,433.29	390,346.18
其他收益	0.00	0.00

3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	-9,221,500.56	2,731,851.31
4. 汇兑收益(损失以 “-”号填列)	0.00	0.00
5. 其他收入(损失以 “-”号填列)	-36,516.38	-384,548.37
减：二、费用		
1. 管理人报酬	1,911,359.38	1,038,678.34
其中：固定管理费	1,464,266.62	786,668.47
业绩报酬	0.00	786,668.47
2. 托管费	41,874.25	0.00
3. 销售服务费	0.00	26,222.33
4. 外包服务费	41,874.25	0.00
5. 交易费用	356,444.29	26,222.33
6. 利息支出	0.00	150,251.39
其中：卖出回购金融 资产支出	0.00	0.00
7. 其他费用	6,899.97	49,313.82
三、利润总额(亏损 总额以“-”号填列)	-8,982,103.04	14,907,160.56
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润(净亏损 以“-”号填列)	-8,982,103.04	14,907,160.56

注：其他收益：未被统计进前列分类的损益类科目，主要包括投资于其他私募基金、基金公司专户、券商资管计划、有限合伙企业股权、未上市企业股权等产生的投资收益。

截至2022年12月31日暂估业绩报酬为2769597.72元。暂估管理人报酬仅在此披露，未入账，仅供参考，与投资者实际承担的管理人报酬可能存在差异。

6.3 所有者权益变动表

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	43,673,404.82	53,710,685.86	97,384,090.68
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	0.00	-8,982,103.04	-8,982,103.04
三、本期基金份额交 易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	7,552,154.72	9,788,629.15	17,340,783.87
其中：1. 基金申购款	13,374,937.76	14,365,062.24	27,740,000.00
2. 基金赎回款	-5,822,783.04	-4,576,433.09	-10,399,216.13
四、本期向基金份额 持有人分配利润产	0.00	0.00	0.00

生的基金净值变动 (净值减少以“-” 号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	51,225,559.54	54,517,211.97	105,742,771.51
项目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	18,563,168.10	10,372,202.39	28,935,370.49
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	0.00	14,907,160.56	14,907,160.56
三、本期基金份额交 易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	25,110,236.72	28,431,322.91	53,541,559.63
其中:1.基金申购款	27,227,570.71	30,882,429.29	58,110,000.00
2.基金赎回款	-2,117,333.99	-2,451,106.38	-4,568,440.37
四、本期向基金份额 持有人分配利润产 生的基金净值变动 (净值减少以“-” 号填列)	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益 (基金净值)	43,673,404.82	53,710,685.86	97,384,090.68

7、期末投资组合情况

7.1 期末基金资产组合情况

项目		金额单位: 元
		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
	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	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	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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	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

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合（如有）

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例 (%)
能源	0.00	0.00
原材料	0.00	0.00
工业	141,762.40	0.13
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
医疗保健	3,887,719.78	3.68
金融	8,385,071.55	7.93
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