
巨曦3号私募证券投资基金 2023年年度报告

2023年12月31日



上海巨曦私募基金管理有限公司

海通证券股份有限公司

送出日期：2024年04月10日

私募基金信息披露年度报表

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	巨曦3号私募证券投资基金
基金编码	SJV578
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2020-03-19
基金管理人	上海巨曦私募基金管理有限公司
基金托管人(如有)	海通证券股份有限公司
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)	1,953.271996
基金到期日期	2035-03-19

1.2 基金产品说明

投资目标	本基金为灵活配置型基金，主要配置股票类资产，采取“自下而上”和“自上而下”相结合的研究方法，灵活进行资产配置，在有效控制风险的前提下，分享中国经济的持续增长和结构性机会，谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金将采取自上而下和自下而上相结合的研究方法，以基本面研究为基础，充分发挥基金管理人的投研优势，在分析和判断宏观经济环境和市场趋势变化的基础上，自上而下灵活配置各类资产，积极动态调整投资组合比例；并通过分析判断行业发展趋势及行业景气程度变化，挖掘预期具有良好增长前景的优势行业，并运用严谨、规范化的选股方法，精选个股；并依据对宏观和市场的判断，采取积极主动的投资风格，对投资组合进行积极、有效的风险管理。
业绩比较基准(如有)	本基金无业绩比较基准。
风险收益特征	基于本基金的投资范围及投资策略，本基金不承诺保本及最低收益。本基金产品的风险等级为 R4，适合风险承受能力等级为 C4、C5 型的合格投资者。

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	上海巨曦私募基金管理有限公司	海通证券股份有限公司

信息披露负责人	姓名	陈炳辉	邓来承
	联系电话	021-61763769	021-23185481
	电子邮箱	binghui_chen@163.com	dlc11913@haitong.com
传真		021-61763761	021-63410637
注册地址		上海市静安区西康路658弄5号6层	上海市黄浦区广东路689号
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1001-1002室	上海市中山南路888号海通外滩金融广场
邮政编码		-	200011
法定代表人		董高峰	周杰

1.4 信息披露方式

传真、电子邮件或短信、邮寄服务、基金管理人网站或基金管理人指定的第三方机构。管理人通过中国基金业协会指定的私募基金信息披露备份平台发布产品月报、季报和年报，投资者可登录进行查询。基金份额持有人留有微信等即时联系方式的，管理人可通过微信等即时聊天工具将报告信息告知基金份额持有人。其他中国证监会以及基金业协会规定的信息披露途径或方式。管理人官方网站：www.genxifund.com。

1.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	-	-
注册登记机构	海通证券股份有限公司	上海市中山南路888号海通外滩金融广场
外包机构	海通证券股份有限公司	上海市中山南路888号海通外滩金融广场C栋2层

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

金额单位：元

期间数据和指标	2023年	2022年	2021年
本期已实现收益	-906,042.71	-4,020,966.29	3,639,785.42
本期利润	-2,118,739.14	-5,788,344.72	8,169,032.98
期末数据和指标	2023年末	2022年末	2021年末
期末可供分配利润	8,025,454.09	8,642,260.13	13,347,502.49
期末可供分配基金份额利润	0.4109	0.4566	0.6789
期末基金净资产	28,428,993.14	29,547,732.28	36,831,464.64
报告期期末单位净值	1.4555	1.5611	1.8733

累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	45.55%	56.11%	87.33%

备注：

-

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

巨曦 3 号私募证券投资基金 A 级基金主要会计数据和财务指标

期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-53,270.85	-413,975.70	561,628.93
本期利润	-177,121.80	-596,708.26	1,077,998.00
期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	971,821.15	1,025,092.00	1,439,067.70
期末可供分配基金份额利润	0.4860	0.5126	0.7196
期末基金净资产	3,062,728.40	3,239,850.20	3,836,558.46
报告期期末单位净值	1.5315	1.6201	1.9185
累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	53.15%	62.01%	91.85%

巨曦 3 号私募证券投资基金 B 级基金主要会计数据和财务指标

期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-852,771.86	-3,606,990.59	3,078,156.49
本期利润	-1,941,617.34	-5,191,636.46	7,091,034.98
期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	7,053,632.94	7,617,168.13	11,908,434.79
期末可供分配基金份额利润	0.4023	0.4500	0.6743
期末基金净资产	25,366,264.74	26,307,882.08	32,994,906.18
报告期期末单位净值	1.4468	1.5541	1.8682
累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	44.68%	55.41%	86.82%

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	-6.76	0.00	0.00	0.00
自基金合同生效起至今	45.55	0.00	0.00	0.00

备注:

-

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

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, 一般保留至小数点后 2 位。

巨曦 3 号私募证券投资基金 A 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(%)
当年	-5.47	0.00	0.00	0.00
自基金合同生效起至今	53.15	0.00	0.00	0.00

巨曦 3 号私募证券投资基金 B 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(%)
当年	-6.90	0.00	0.00	0.00
自基金合同生效起至今	44.68	0.00	0.00	0.00

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
2023	0	0	0	0	-
2022	0	0	0	0	-
2021	0	0	0	0	-

备注：

-

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

巨曦3号私募证券投资基金A级基金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 情况	备注
2023	0	0	0	0	-
2022	0	0	0	0	-
2021	0	0	0	0	-

巨曦3号私募证券投资基金B级基金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 情况	备注
2023	0	0	0	0	-
2022	0	0	0	0	-
2021	0	0	0	0	-

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	1,892.753962
报告期期间基金总申购份额	60.518034
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	1,953.271996

备注：

-

如为分级基金，应按级别分别列示。

如基金成立日晚于报告期期初，则以基金成立日的基金份额总额作为报告期期初基金份额总额。

巨曦3号私募证券投资基金A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	199.980004
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	199.980004

巨曦3号私募证券投资基金B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	1,692.773958
报告期期间基金总申购份额	60.518034
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	1,753.291992

4、管理人说明的其他情况（如报告期内高管、基金经理及其关联基金经验、基金运作合规守信情况、基金投资策略和业绩表现、对宏观经济、证券市场及其行业走势展望、内部基金监察稽核工作、基金估值程序、基金运作情况和运用杠杆情况、投资收益分配和损失承担情况、会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项、对本基金持有人数或基金资产净值预警情形、可能存在的利益冲突等）

5、托管人报告（如有）

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本年度，海通证券股份有限公司作为本基金托管人依据有关法律法规与基金合同，托管本基金资产，并依规依约履行托管人义务。

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

本年度，海通证券股份有限公司对管理人的投资运作行为按合同约定进行监督，未发现存在损害委托人利益的行为。海通证券股份有限公司对报告期内资产净值的计算、利润分配等方面进行了复核，未发现管理人存在损害委托人利益的行为。

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

海通证券股份有限公司复核了基金本年度报告中的有关财务数据部分，内容真实、准确、完整。

6、年度财务报表

金额单位：元

6.1 资产负债表

资产	2023-12-31	2022-12-31
资产：	0	0
银行存款	28,083.05	13,935.90
结算备付金	120,929.88	22,582.09
存出保证金	0	0

交易性金融资产	28,382,881.56	29,613,976.34
其中：股票投资	28,382,881.56	29,613,976.34
基金投资	0	0
债券投资	0	0
资产支持证券投资	0	0
贵金属投资	0	0
衍生金融资产	0	0
买入返售金融资产	0	0
应收证券清算款	0	0
应收利息	0	0
应收股利	0	0
应收申购款	0	0
递延所得税资产	0	0
其他资产	0	0
资产总计	28,531,894.49	29,650,494.33
负债和所有者权益	2023-12-31	2022-12-31
负债：	0	0
短期借款	0	0
交易性金融负债	0	0
衍生金融负债	0	0
卖出回购金融资产款	0	0
应付证券清算款	3.16	1.82
应付赎回款	0	0
应付管理人报酬	97,856.59	97,714.92
应付托管费	2,520.80	2,520.80
应付销售服务费	0	0
应付交易费用	0	0
应交税费	0	3.71
应付利息	0	0
应付利润	0	0
递延所得税负债	0	0
其他负债	2,520.80	2,520.80
负债合计	102,901.35	102,762.05
所有者权益：	0	0
实收基金	19,532,719.96	18,927,539.62
未分配利润	8,896,273.18	10,620,192.66
所有者权益合计	28,428,993.14	29,547,732.28
负债和所有者权益总计	28,531,894.49	29,650,494.33

备注：

-

6.2 利润表

项目	本期	上年度可比期间
	2023-01-01 至 2023-12-31	2022-01-01 至 2022-12-31
一、收入	-1,564,317.88	-5,286,623.54
1.利息收入	3,766.36	18,411.32
其中：存款利息收入	3,766.36	18,411.32
债券利息收入	0	0
资产支持证券利息收入	0	0
买入返售金融资产收入	0	0
其他利息收入	0	0
2.投资收益（损失以“-”填列）	-313,337.94	-3,537,719.76
其中：股票投资收益	-467,486.09	-3,755,686.32
基金投资收益	0	0
债券投资收益	0	107,055.10
资产支持证券投资收益	0	0
贵金属投资收益	0	0
衍生工具收益	0	0
股利收益	154,148.15	110,911.46
3.公允价值变动收益 （损失以“-”填列）	-1,212,696.43	-1,767,378.43
4.汇兑收益（损失以“-”填列）	0	0
5.其他收入（损失以“-”填列）	-42,049.87	63.33
减：二、费用	554,421.26	501,721.18
1. 管理人报酬	400,681.46	385,677.22
其中：固定管理费	400,681.46	385,677.22
业绩报酬	0	0
2. 托管费	10,001.00	10,001.00
3. 销售服务费	0	0
4. 外包服务费	10,001.00	10,001.00
5. 交易费用	128,693.28	94,678.18
6. 利息支出	0	0
其中：卖出回购金融资产支出	0	0
7. 其他费用	5,044.52	1,363.78
三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）	-2,118,739.14	-5,788,344.72
减：所得税费用	0	0
四、净利润 （净亏损以“-”号填列）	-2,118,739.14	-5,788,344.72

备注：

按照合同约定的业绩报酬条款，本产品【20231231】的暂估业绩报酬金额为【218524】元，暂估业绩报酬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 2023-01-01 至 2023-12-31		
	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)	18,927,539.62	10,620,192.66	29,547,732.28
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	0	-2,118,739.14	-2,118,739.14
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)	605,180.34	394,819.66	1,000,000.00
其中：1、基金申购款	605,180.34	394,819.66	1,000,000.00
2、基金赎回款	0	0	0
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	0	0
五、期末所有者权益 (基金净值)	19,532,719.96	8,896,273.18	28,428,993.14
项目	2022-01-01 至 2022-12-31		
	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)	19,661,142.95	17,170,321.69	36,831,464.64
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	0	-5,788,344.72	-5,788,344.72
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)	-733,603.33	-761,784.31	-1,495,387.64
其中：1、基金申购款	1,229,105.21	770,894.79	2,000,000.00
2、基金赎回款	-1,962,708.54	-1,532,679.10	-3,495,387.64
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	0	0
五、期末所有者权益 (基金净值)	18,927,539.62	10,620,192.66	29,547,732.28

备注：

-

7、期末投资组合情况

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

项目	金额	
现金类资产	28,083.05	
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	-
	其中：优先股	-
	其他股权类投资	-
上市公司定向增发投资	-	
新三板投资	-	
境内证券投资规模	结算备付金	120,929.88
	存出保证金	-
	股票投资	28,382,881.56
	债券投资	-
	其中：银行间市场债券	-
	其中：利率债	-
	其中：信用债	-
	资产支持证券	-
	基金投资（公募基金）	-
	其中：货币基金	-
	期货及衍生品交易保证金	-
	买入返售金融资产	-
	其他证券类标的	-
资管计划投资	商业银行理财产品投资	-
	信托计划投资	-
	基金公司及其子公司资产管理计划投资	-
	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	-
	期货公司及其子公司资产管理计划投资	-
	私募基金产品投资	-
未在协会备案的合伙企业份额	-	
另类投资	-	
境内债权类投资	银行委托贷款规模	-
	信托贷款	-
	应收账款投资	-
	各类受（收）益权投资	-
	票据（承兑汇票等）投资	-

	其他债权投资	-
境外投资	境外投资	-
其他资产	其他资产	-
基金负债情况	债券回购总额	-
	融资、融券总额	-
	其中：融券总额	-
	银行借款总额	-
	其他融资总额	-

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	0	0
B	采矿业	0	0
C	制造业	9,289,394.40	32.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0	0
E	建筑业	0	0
F	批发和零售业	0	0
G	交通运输、仓储和邮政业	0	0
H	住宿和餐饮业	0	0
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,323,200.00	8.17
J	金融业	0	0
K	房地产业	0	0
L	租赁和商务服务业	0	0
M	科学研究和技术服务业	0	0
N	水利、环境和公共设施管理业	0	0
O	居民服务、修理和其他服务业	0	0
P	教育	0	0
Q	卫生和社会工作	0	0
R	文化、体育和娱乐业	0	0
S	综合	0	0
	合计	11,612,594.40	40.85

备注：

-

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 (%)
港股通	16,770,287.16	58.99
合计	16,770,287.16	58.99

备注：

-

信息披露报告是否经托管机构复核：

是