

私募基金信息披露季度报表

1、基金基本情况

| 项目 | 信息 |
|--------------------------|---|
| 基金名称 | 巨曦3号私募证券投资基金 |
| 基金编码 | SJV578 |
| 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） | - |
| 基金运作方式 | 开放式 |
| 基金成立日期 | 2020-03-19 |
| 期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元） | 1,953.271996 |
| 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。 |

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 | -1.66 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 自基金合同生效起至今 | 47.53 | 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。

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（%） |
|------------|----------|-------------|--------------|-----------------|
| 当季 | -1.33 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 自基金合同生效起至今 | 54.71 | 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（%） |
|------------|----------|-------------|--------------|-----------------|
| 当季 | -1.70 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 自基金合同生效起至今 | 46.71 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

3、主要财务指标

金额单位：元

| 项目 | 2023-07-01 | 至 | 2023-09-30 | (元) |
|-----------|------------|---|---------------|-----|
| 本期已实现收益 | | | -1,287,406.70 | |
| 本期利润 | | | -485,973.10 | |
| 期末基金净资产 | | | 28,816,158.86 | |
| 报告期期末单位净值 | | | 1.4753 | |

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 级基金主要财务指标

金额单位：元

| 项目 | 2023-07-01 | 至 | 2023-09-30 | (元) |
|-----------|------------|---|--------------|-----|
| 本期已实现收益 | | | -127,679.00 | |
| 本期利润 | | | -41,574.26 | |
| 期末基金净资产 | | | 3,093,979.27 | |
| 报告期期末单位净值 | | | 1.5471 | |

巨曦3号私募证券投资基金B 级基金主要财务指标

金额单位：元

| 项目 | 2023-07-01 | 至 | 2023-09-30 | (元) |
|-----------|------------|---|---------------|-----|
| 本期已实现收益 | | | -1,159,727.70 | |
| 本期利润 | | | -444,398.84 | |
| 期末基金净资产 | | | 25,722,179.59 | |
| 报告期期末单位净值 | | | 1.4671 | |

4、投资组合情况

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 | 129,155.45 |
| 银行存款 | |

| | | |
|-----------------|-------------------|---------------|
| 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 | 上市公司定向增发股票投资 | - |
| 新三板投资 | 新三板挂牌企业投资 | - |
| 境内证券投资规模 | 结算备付金 | 79,280.63 |
| | 存出保证金 | - |
| | 股票投资 | 28,709,236.00 |
| | 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 | 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 | - |

4.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

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 | 14,847,323.51 | 51.52 |
| 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 | 2,806,650.00 | 9.74 |
| 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 | 17,653,973.51 | 61.26 |

备注:

-

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（%） |
|------|---------------|--------------|
| 港股通 | 11,055,262.49 | 38.36 |
| 合计 | 11,055,262.49 | 38.36 |

备注:

-

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 | 1,953.271996 |
| 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 | 1,953.271996 |

备注:

-

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 | 1,753.291992 |
| 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 | 1,753.291992 |

6、管理人报告（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）

-

| | |
|------------------|---|
| 信息披露报告是否经托管机构复核： | 是 |
|------------------|---|