

留仁鑒金五号私募证券投资基金 2023 年第 3 季度报告

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	留仁鑒金五号私募证券投资基金
基金编码	SJC455
基金管理人	上海留仁资产管理有限公司
基金托管人（如有）	申万宏源证券有限公司
投资顾问（如有）	-
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2019 年 11 月 25 日
期末基金总份额（万份）/ 期末基金实缴总额（万元）	4,149.07709
投资目标	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。自下而上优选成长企业，组合投资，多策略（宏观，创新，重组，金融衍生，PE 等）运用，在保障本金的基础上力争获得良好的投资回报。同时，依据资产管理人多年在科技创新领域积累的投资经验，择机介入引领中国经济结构转型的创新颠覆企业，并通过组合和止损策略，追求绝对回报，力争获取稳定且安全边际高的回报。
投资策略	基金管理人团队有多年证券理论学习及操盘经验的积累及长期跟踪上市公司研究实践，已经形成一套自己的交易模式，根据交易模型制定交易纪律，严格遵守法纪，控制风险，以保住本金安全放在第一位的操作原则，在投资之前先评估，研究公司基本面，通过研究上市公司内在价值做出分析，寻找被市场低估的股票。基金管理人投资团队坚持以中长线投资为主，在市场估值的底部介入，不频繁换股，追涨杀跌市场短线热点，通过对国家政策的解读及宏观研究及国家产业投入方向确定中长期投资机会，并对上市公司进行实地调研考察，精选个股，通过科学，量化，分散组合投资资产，消除非系统性风险及市场风险，认真细致的在同行业公司之中筛选出质地优量的投资标的，同时根据国内外环境及市场估值选择投资标的，并依托技术上分析与数据分析，判断宏观经济形势、货币政策及财政政策，灵活调整产品在股票和债券、基金之间的配置比例，实现产品的长期增值。
业绩比较基准（如有）	本基金无业绩比较基准。
风险收益特征	本基金属于【R4】风险投资品种。

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	-4.26	0.29	-	-
自基金合同生效起至今	42.85	1.3	-	-

备注：

√无分级 □二级基金 □三级基金

3、主要财务指标

金额单位：元

项目	2023年7月1日至2023年9月30日(元)
本期已实现收益	-2,737,791.18
本期利润	-2,717,229.66
期末基金净资产	50,100,687.86
报告期期末单位净值	1.2075

备注：

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	37,327.81	
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	0
	其中：优先股	0
	其他股权类投资	-
上市公司定向增发投资	0	
新三板投资	0	
境内证券投资规模	结算备付金	1,200.77
	存出保证金	0
	股票投资	1,412,232
	债券投资	0
	其中：银行间市场债券	0
	其中：利率债	0
	其中：信用债	0
	资产支持证券	0
	基金投资（公募基金）	13,408,911.11
	其中：货币基金	5,664,949.23
	期货及衍生品交易保证金	0
	买入返售金融资产	19,448,269.31
其他证券类标的	-	
资管计划投资	-	

	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	-
	证券公司及其子公司资产管理计划投资	S00775#16007648.91;
	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	0
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	0
其他资产	其他资产	应收股利#5.28;
基金负债情况	债券回购总额	0
	融资、融券总额	0
	其中：融券总额	0
	银行借款总额	0
	其他融资总额	-

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	0.00	0.00
C	制造业	1,375,832.00	2.75
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	0.00	0.00
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	36,400.00	0.07
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	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	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	1,412,232.00	2.82

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（%）
信息技术	0.00	0.00
公用事业	0.00	0.00
医疗保健	0.00	0.00
地产建筑业	0.00	0.00
基础材料	0.00	0.00
工业	0.00	0.00
消费者常用品	0.00	0.00
消费者非必需品	0.00	0.00
电信服务	0.00	0.00
能源	0.00	0.00
金融	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

备注：

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	4,277.479761
报告期期间基金总申购份额	0
减：报告期期间基金总赎回份额	128.402671
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	4,149.07709

备注：

6、管理人报告

1) 基金运作合规守信情况：

本报告期内，本基金管理人严格遵守《私募投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、基金合同等规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

2) 基金估值程序:

截止到报告期末,本管理人委托申万宏源证券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,并在合同中约定。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。

3) 基金运作情况和运用杠杆情况:

截止报告期末,本基金资产总值为 50315595.19 元,净资产为 50100687.86 元,本基金总资产与净资产的比例为 100.43%

信息披露报告是否经托管机构复核: 是