

金数乌石 1 号私募证券投资基金 2022 年第四季度报告

基金管理人:深圳金数私募证券投资基金管理有限公司

基金托管人:安信证券股份有限公司

送出日期:二零二三年一月五日

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	金数乌石1号私募证券投资基金
基金编码	SJY482
基金管理人	深圳金数私募证券投资基金管理有限公司
基金托管人（如有）	安信证券股份有限公司
投资顾问（如有）	-
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2020年06月15日
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	497.457940
投资目标	在控制风险的前提下，追求本基金财产的增值
投资策略	股票策略
业绩比较基准（如有）	-
风险收益特征	R4级（中高风险）

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	-43.23	-	-	-
自基金合同生效起至今	58.81	-	-	-

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)/上季度末累计净值

3、主要财务指标

金额单位：元

项目	2022年10月01日至2022年12月31日
本期已实现收益	-749,290.69
本期利润	-4,054,644.79
期末基金净资产	7,900,038.69
报告期期末单位净值	1.5881

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	1,059,051.73	
境内未上市、未挂牌公司股权投资	银行存款	1,059,051.73
	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	226,774.54
	存出保证金	1,624,372.40
	股票投资	12,309,251.80
	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	1,624,372.40
	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	-
	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	7,288,391.39
	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	占基金资产净值的比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,900,625.00	36.72
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,408,626.80	119.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,309,251.80	155.81

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）	占基金资产净值的比例 (%)
港股通	-	-
合计	-	-

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	302.210814
报告期期间基金总申购份额	195.247126
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
期末基金总份额/期末基金实缴总额	497.457940

6、管理人报告

6.1、报告期内高管、基金经理及其管理基金经验

王南，深圳金数私募证券投资基金管理有限公司实控人、投资总监，武汉大学经济学博士，公司与武汉大学“世界经济金融形势及中国高新科技发展联合研究委员会”主任委员、香港中文大学（深圳）校外导师，拥有二十余年金融业头部公司管理、市场及研究工作经验，尤其对资本市场、上市公司有独到而深入的研究与分析。历任招商银行深圳分行支行行长、华融证券深圳业务总部资产管理部副总经理兼资管三部总经理、东兴证券深圳分公司副总经理。所创办的“华紫研究”公众号已发布行业研究及上市公司研究原创文章两百余篇，其中多篇文章所作出的宏观研判、关键数据预测、上市公司估值等，均在事后得到准确验证。

6.2、基金运作合规守信情况

本报告期内，本基金严格遵守私募投资基金相关法律法规要求，合法从事私募基金业务，不存在公开宣传推介、向非合格投资者募集资金、承诺本金或收益、损害基金财产合法权益、违反或规避备案要求、从事非法集资及诈骗活动等违法违规行为。

6.3、报告期内基金投资策略和业绩表现

截至 2022 年 12 月 31 日本基金单位净值为 1.5881 元，累计净值为 1.5881 元。

6.4、报告期内对宏观经济、证券市场及其行业走势展望

本报告期内，市场环境出现了颠覆性的变化：国际方面，美联储的强力加息由于美国经济的失速开始缓和，市场开始判断本轮加息的平衡区间和结束周期；俄乌战争造成的全球供应链问题随着时间的推移得到了一定的修复，主要能源、粮食及生产原材料的价格波幅趋向稳定；整体上对 2023 年全球经济的增长判断较为消极；国内方面，疫情管控政策出现的颠覆性的变化，这将带来中长期的积极利好，但短期冲击明显；国内第一轮染疫周期比预期更快开始及结束；对冲短期的利好政策趋势明显，随着时间推移必将更为强化；在不断叠加的积极政策推动下，我们对 2023 年的国内资本市

场相对积极正面态度，预期主要趋势出现在本年度的二三季度之间。

6.5、报告期内内部基金监察稽核工作

本报告期内，本基金管理人对照中基协、深私协发布的通知公告及公布的违规案例开展了相关自查，未发现重大问题。

6.6、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。

6.7、报告期内基金运作情况和运作杠杆情况

本报告期内，本基金在资本市场承压的大环境下，有较为显著的回撤。我们持续深入观察与研究经济政策、宏观实际及所主投行业、标的，得到明确与清晰的判断，因此在本报告期内没有对仓位、杠杆率进行太大的调整。12月初，宏观面出现了颠覆性的积极变化，这个变化是一个中长期的积极因素，但短期内对市场有冲击。在无法确定短期冲击的时间跨度和力度的情况下，我们判断我们原有的投资逻辑没有变化，为避免摩擦损耗，我们采取了相对保守的操作策略，因此在12月内产品承担了较大的回撤压力，我们与客户一起承担了较大的心理、操作、产品的共同压力。在12月的最后2个交易日，我们终于迎来了市场和所投主要行业趋势性的反转，这个反转重新回归了我们的研究判断和投资逻辑，并在2023年的1月份得到了初步印证，我们持续加大对政策和宏观、行业的研究和分析，对这轮的颠覆性的积极变化对2023年资本市场的积极影响有信心，更为积极地进行针对性的操作，相信能在新的投资年度为投资者带来更为良好的投资体验。

6.8、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收益分配。

6.9、报告期内对本基金持有人数或基金资产净值预警情形

本基金设置了预警线及止损线，本报告期内本基金未曾触及预警线或止损线。

信息披露报告是否经托管机构复核：

是
