

金数乌石 1 号私募证券投资基金 2023 年第三季度报告

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:二零二三年十月十日

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)	567.361939
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	-8.57	-	-	-
自基金合同生效起至今	22.50	-	-	-

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	2023年07月01日至2023年09月30日
本期已实现收益	-697,161.61
本期利润	-651,532.84
期末基金净资产	6,950,166.51
报告期期末单位净值	1.2250

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	61,213.83	
境内未上市、未挂牌公司股权投资	银行存款	-
	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	10,499.21
	存出保证金	1,472,185.60
	股票投资	11,957,199.64
	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	1,472,043.30
	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	6,260,883.20
	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,957,199.64	172.04
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	11,957,199.64	172.04

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	0	0
合计	0	0

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	567.361939
报告期期间基金总申购份额	-
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	567.361939

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微观研判、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 2023 年 09 月 30 日本基金单位净值为 1.2250 元，累计净值为 1.2250 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，资本市场在中央加强宏观调控，活跃资本市场的持续努力下有了明显的改观。虽然消费复苏和民间投资增长依然低于预期，但市场信心较之上一季度有修复迹象。此外，资金仍然偏谨慎，市场风格特点不突出，大部分行业的股票标的在结束寻底的过程后，由于增量资金和信心不足，反弹的力度偏弱，市场观望情绪依然强烈。四季度是完成全年任务计划的关键期，以往正常年份一般有所保留，或为来年储备，但今年可能会较为特殊，在政策密集释放后将有效扭转市场预期，并伴随关键政策的后续推动下迎来“吃饭行情”。

6.5、报告期内内部基金监察稽核工作

本报告期内，本基金管理人对照证监会、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，本基金净值获得较为明显的反弹。产品杠杆维持在平均水平，在可预期的反弹行情中拟将获得更为良好的收益。

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，本报告期内曾于 2023 年 8 月 23 日、8 月 28 日两次触及预警线，管理人已根据基金合同约定及时进行了信息披露及投资调整，基金单位净值自 8 月 29 日起已恢复至预警线以上并企稳回升。

信息披露报告是否经托管机构复核：

是
