

金数乌石3号私募证券投资基金 2021年3季度报告

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	金数乌石3号私募证券投资基金
基金编码	SLU748
基金管理人	深圳前海金数投资管理有限公司
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	2020-09-22
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	863.918797
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）	无
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	-11.34	0.00	0.00	0.00
自基金合同生效 起至今	18.33	0.00	0.00	0.00

备注：

-

注：1、净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

2、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、如为分级基金，应按级别分别列示。

4、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。

无分级二级基金三级基金

本基金不分级。（此段话不在报告展示中显示）

3、 主要财务指标

金额单位：元

项目	2021-07-01 至 2021-09-30 (元)
本期已实现收益	-99,951.45
本期利润	-1,395,345.40
期末基金净资产	10,222,586.72
报告期期末单位 净值	1.1833

备注：

-

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

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	银行存款	28,455.09
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	131,530.85
	存出保证金	134,248.80
	股票投资	14,813,163.00
	债券投资	560,316.92
	其中：银行间市场债券	
	其中：利率债	
	其中：信用债	560,316.92
	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	134,248.80
	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	应收利息#304.84；
基金负债情况	债券回购总额	
	融资、融券总额	5,327,986.52
	其中：融券总额	
	银行借款总额	
	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	0
B	采矿业	0	0
C	制造业	12,055,794.00	117.93
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	435,456.00	4.26
H	住宿和餐饮业	0	0
I	信息传输、软件和信息技术服务业	0	0
J	金融业	2,321,913.00	22.71
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	14,813,163.00	144.91

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	0.00	0.00
合计		

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	720.683103
报告期期间基金总申购份额	143.235694
减：报告期期间基金总赎回份额	0
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/期末基金实缴总额	863.918797
------------------	------------

备注:

-

注 1: 如为分级基金, 应按级别分别列示。

注 2: 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初基金份额总额。

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)

一、报告期内高管、基金经理及其管理基金经验

基金经理王南, 深圳前海金数投资管理有限公司董事长、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技术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。

二、报告期内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。

三、报告期内基金投资策略和业绩表现

本基金的投资策略为: 根据宏观经济分析及企业价值评估, 优选价值被市场低估且流动性较好的标的, 择时而入并分散配置, 通过主动管理, 在降低风险的同时追求更高收益。截至 2021 年 9 月 30 日本基金期末单位净值为 1.1833 元, 期末累计单位净值 1.1833 元。

四、报告期内对宏观经济、证券市场及其行业走势展望

2021 年三季度, 国内宏观政策维持相对稳定, 主要经济指标增速持续减缓, 资本市场在三季度中期探底后逐步走稳, 传统行业板块估值修复, 各个板块轮动速度加快, 投资操作难度及盈利难度增加, 但依然存在很多结构性的机会, 如能把握好波段, 仍能获得较好收益。

五、报告期内内部基金监察稽核工作

本报告期内，本基金对照中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金管理人及从业人员职业操守和道德规范指南》及深圳私募基金信息服务平台公布的若干违规案例开展了自查，未发现重大问题。

六、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。

七、报告期内基金运作情况和运作杠杆情况

本报告期内，本基金总体运行平稳，后期有所回调，均在预料之中，预期在四季度将有良好走势，年内有很大几率再创新高。本基金维持的杠杠水平约为 0.6，持仓结构中，高成长行业与传统行业的比例约为 6：4，以此保持较好的稳健性与成长性。

八、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利润分配。

九、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，报告期内未曾触及预警线及止损线。

信息披露报告是否经托管机构复核：是