

## 金数乌石 3 号私募证券投资基金 2021 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:二零二二年一月六日

## 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09月22日          |
| 期末基金总份额(万份)/期末基金实缴总额(万元) | 938.178429           |
| 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(%) | 业绩比较基准收益标准差(%) |
|------------|----------|-------------|--------------|----------------|
| 当季         | 88.76    | -           | -            | -              |
| 自基金合同生效起至今 | 123.36   | -           | -            | -              |

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        | 2021年10月01日至2021年12月31日 |
|-----------|-------------------------|
| 本期已实现收益   | 2,219,684.49            |
| 本期利润      | 9,240,383.36            |
| 期末基金净资产   | 18,140,768.78           |
| 报告期期末单位净值 | 1.9336                  |

#### 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         | 109,094.99    |
| 境内未上市、未挂牌公司<br>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        | 301,900.78    |
|                     | 存出保证金        | -             |
|                     | 股票投资         | 26,937,193.00 |
|                     | 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        | -                      |
|         | 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#95.80;            |
| 基金负债情况  | 债券回购总额            | -                      |
|         | 融资、融券总额           | 8,945,594.41           |
|         | 其中：融券总额           | -                      |
|         | 银行借款总额            | -                      |
|         | 其他融资总额            | 其他融资总额<br>#109,189.30; |

## 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<br>(%) |
|----|----------------------|---------------|-------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业             | -             | -                 |
| B  | 采矿业                  | -             | -                 |
| C  | 制造业                  | 25,223,769.00 | 139.04            |
| D  | 电力、热力、燃气及水<br>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<br>业      | -             | -                 |
| H  | 住宿和餐饮业               | -             | -                 |
| I  | 信息传输、软件和信息<br>技术服务业  | -             | -                 |
| J  | 金融业                  | 1,713,424.00  | 9.45              |
| 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<br>管理业    | -             | -                 |
| O  | 居民服务、修理和其他<br>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                   | 26,937,193.00 | 148.49            |

## 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               | 863.918797 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 145.949359 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 71.689727  |
| 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          | 938.178429 |

## 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两百余篇，其中多篇所作出的宏观研判、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 2021 年 12 月 31 日本基金期末基金单位净值为 1.9336 元，期末基金累计单位净值 2.2336 元。

### 6.4、报告期内对宏观经济、证券市场及其行业走势展望

2022 年，市场环境预期友好：流动性宽松、供给侧改革政策助力国内经济循环发展，国内消费有望逐步恢复，传统银行、保险板块估值修复，带来更多投资机会。在双碳政策持续加码、硬科技国产替代进口的背景下，新能源和硬科技板块在长周期里有十足的成长空间。国际局势动荡，有望带动军工板块景气上行。如能提前布局，有望抓住下一波行情。

### 6.5、报告期内内部基金监察稽核工作

本报告期内，本基金对照深圳私募基金信息服务平台发布的通知公告及公布的违规案例开展了自查，未发现重大问题。

### 6.6、报告期内基金估值程序

本报告期内，本基金管理人严格按照新准则、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，本基金获得了良好的规模与净值双增长，期间净值创造了新高，并维持良好的成长趋势。本基金维持的杠杠水平约为 0.6，持仓结构中，高成长行业与周期性行业的比例约为 6:4，我们在维持高成长行业持仓的同时寻找景气周期的投资机会。

### 6.8、报告期内投资收益分配和损失承担情况

本基金本报告期内进行收益分配 1 次，权益登记日为 2021 年 11 月 24 日，单位分红金额 0.30 元/份额，分红总金额 2376687.21 元。

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

本报告期内，本基金设置了预警线及止损线，且在报告期间内，本基金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