

金数乌石 3 号私募证券投资基金 2023 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:国投证券股份有限公司

送出日期:二零二四年一月三日

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）	国投证券股份有限公司
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）	1,524.347661
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	-19.97	-	-	-
自基金合同生效起至今	-26.53	-	-	-

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10月01日至2023年12月31日
本期已实现收益	-137,548.29
本期利润	-2,805,032.69
期末基金净资产	6,626,849.30
报告期期末单位净值	0.4347

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	171,181.46
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	10,474.54
	存出保证金	-
	股票投资	13,653,398.80
	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	-
	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	6,940,539.63
	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	13,653,398.80	206.03
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	13,653,398.80	206.03

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	1,528.979813
报告期期间基金总申购份额	95.367848
减：报告期期间基金总赎回份额	100.000000
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	1,524.347661

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12月31日本基金单位净值为0.4347元，累计净值为0.7347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，全球的预期在美联储连续释放偏鸽派言论，并停止了加息之后有明显的改观，但国内各主要要素市场依然回升乏力，民间投资及个人消费信心低落，虽然整体GDP增长指标能够完成预期目标，但CPI和PPI持续低位徘徊，中央宏观调控的着力点在于防范风险并为来年奠定基础。资本市场信心较之上一季度有修复迹象，但仍不及预期。沪市再次回到年内低点在意料之外，但也是预期之中，打击了市场信心。全年A股表现低迷，在全球市场中排名倒数。但俗语有言“大暑之后必有大寒”，反之亦然，目前A股整体估值跌落到开市以来底部2.5%区间范围之内，红利指数创

造历史新高。这些均为长期资金入市提供良好机会。同时，国内储蓄存款资金总量也创历史新高，在存款利息持续走低的强烈预期下，如果进入权益类市场的趋势确立，将为市场带来难以预期的天量资金，并为一波强烈的行情奠定基础。行业方面，由于大部分行业估值均在底部区域，如果行情确立，走势启动的顺序将有可能为：红利板块—周期板块—超低估值反弹板块—高科技板块，反弹幅度为以上顺序的倒序。

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，本基金净值波动幅度加大，整体维持持续向好的趋势。产品杠杆依然维持在偏高水平，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

本报告期内，本基金未进行收益分配。

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

本报告期内，本基金未设置预警线或止损线。

信息披露报告是否经托管机构复核：	是
------------------	---