

# 金数真心1号私募证券投资基金

## 2023年第4季度报告



### 1. 基金基本情况

项目	信息
基金名称	金数真心1号私募证券投资基金
基金编码	SVS456
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)	招商证券股份有限公司
投资顾问(如有)	-
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2022年07月26日
期末基金总份额(万份)/期末基金实缴总额(万元)	1,294.007197
投资目标	在控制风险的前提下,实现客户资产长期、持续、稳定的增值。
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)
信息披露报告是否经托管机构复核	是

### 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	-4.69	-	-	-
自基金合同生效起至今	-6.83	-	-	-

注:净值增长率等于(期末累计净值-期初累计净值)/期初累计净值

当季净值增长率等于(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	2023-10-01至2023-12-31
本期已实现收益	-612,956.51
本期利润	-592,886.89
期末基金净资产	12,055,673.42
报告期末单位净值	0.9317

### 4. 投资组合报告

#### 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	16,197.85	
境内未上市、未挂牌公司股权投资	银行存款	16,197.85
	股权投资	0.00
	其中：优先股	0.00
	其他股权类投资	0.00
上市公司定向增发投资	上市公司定向增发股票投资	0.00
新三板投资	新三板挂牌企业投资	0.00
境内证券投资规模	202.81	
境内证券投资规模	结算备付金	202.81
	存出保证金	0.00
	股票投资	12,087,586.52
	债券投资	2,000.17
	其中：银行间市场债券	0.00
	其中：利率债	0.00
	其中：信用债	2,000.17
	资产支持证券	0.00
	基金投资（公募基金）	182.82
	其中：货币基金	182.82
	期货及衍生品交易保证金	0.00
	买入返售金融资产	0.00
其他证券类标的	0.00	
资管计划投资	商业银行理财产品投资	0.00
	信托计划投资	0.00
	基金公司及其子公司资产管理计划投资	0.00
	保险资产管理计划投资	0.00
	证券公司及其子公司资产管理计划投资	0.00
	期货公司及其子公司资产管理计划投资	0.00
	私募基金产品投资	0.00
	未在协会备案的合伙企业份额	0.00
另类投资	0.00	
境内债权类投资	另类投资	0.00
	银行委托贷款规模	0.00
	信托贷款	0.00
	应收账款投资	0.00
	各类受（收）益权投资	0.00
	票据（承兑汇票等）投资	0.00
其他债权投资	0.00	
境外投资	0.00	
其他资产	0.00	
基金负债情况	债券回购总额	0.00
	融资、融券总额	0.00
	其中：融券总额	0.00
	银行借款总额	0.00
	其他融资总额	0.00

#### 4.2 期末按行业分类的股票投资组合(不含港股通)

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	0.00	0.00
B	采矿业	394,219.00	3.27
C	制造业	3,170,950.00	26.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	0.00	0.00
F	批发和零售业	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,391,400.00	11.54
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	0.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
S	综合	0.00	0.00
	合计	4,956,569.00	41.11

#### 4.3 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 (%)
原材料	0.00	0.00
非日常生活消费品	4,290,232.32	35.59
日常消费品	0.00	0.00
能源	0.00	0.00
金融	0.00	0.00
医疗保健	843,400.80	7.00
工业	0.00	0.00
信息技术	964,537.20	8.00
通讯业务	819,720.00	6.80
公用事业	0.00	0.00
房地产	213,127.20	1.77
合计	7,131,017.52	59.15

#### 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	1,294.007197
报告期期间基金总申购份额	0.00

减：报告期期间基金总赎回份额	0.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
期末基金总份额/期末基金实缴总额	1,294.007197

## 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

曾兴波，武汉大学金融学硕士，2009年参加工作，历任招商证券国际业务部华南区负责人、华盛证券市场部总经理、中金公司高级私人财富顾问。现任深圳金数私募证券基金管理有限公司投资经理。

### 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0.9317元，累计净值为0.9317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，美联储加息暂缓，停止加息和降息的预期增加，市场也为此出现一定的反弹，但持续性很差。中国市场信心仍然缺乏，外资仍在流出，市场避险情绪在增加。港股市场由于受到内外夹击，尽管估值很低，但向上的动力偏弱。

本报告期内，A股市场和港股市场都持续下跌，上证跌破3000，恒生指数跌破17000，反复震荡成了常态。做空的势能逐步在释放，我们需要挺过这一段难受的时期。

### 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，市场持续下滑，本基金也出现了一定的回撤。配置上相对分散，并对仓位进行了调整，将部分弹性小、跌幅小的仓位调整为弹性大的仓位，但市场下跌的幅度和持续的时间，超出我们的预期，基金业绩也受到较大的影响。截至2023年12月31日，今年收益率为2.22%，跑赢沪深300指数13.6%。

展望下个季度，当下估值已经处于底部区域，但市场悲观情绪仍在蔓延，我们需要的是时间和耐心，继续做好风险和收益的平衡，向市场要绝对收益。

### 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及止损线。

托管人复核说明：本基金托管人按照相关法律法规、基金合同的规定，对本基金在本报告中的财务数据进行了复核。对按照规定应由托管人复核的数据，托管人无异议。

