

私募基金信息披露季度报表

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	宁水新规一期私募证券投资基金
基金编码	SEL305
基金管理人	厦门宁水私募基金管理有限公司
基金托管人（如有）	广发证券股份有限公司
投资顾问（如有）	
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2018-08-27
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	12950.859685
投资目标	有效控制风险的前提下，追求基金财产的保值增值。
投资策略	1、权益类资产投资策略本基金根据中国经济社会的结构性变化和趋势性规律，采取自上而下方式投资国内依法发行上市的股票等。2、货币市场工具投资策略本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，分析和判断利率走势并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，对基金资产组合进行积极管理。3、其他策略本基金将根据市场变化，参与本基金投资范围内约定的其他金融产品交易。
业绩比较基准（如有）	
风险收益特征	本基金属预期风险等级【R5高风险】级的投资品种，适合具有【C5进取型】级别风险识别、评估、承受能力的合格投资者。

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	2.81			
自基金合同生效起至今	156.30			

说明：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	2024-04-01至2024-06-30
本期已实现收益	8380533.20
本期利润	7985441.17

期末基金净资产	331874688.84
报告期期末单位净值	2.563

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	5736.96
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	74971654.20
	存出保证金	13565576.80
	股票投资	62307326.87
	债券投资	11915568.08
	其中：银行间市场债券	
	其中：利率债	10028282.56
	其中：信用债	1887285.52
	资产支持证券	
	基金投资（公募基金）	23313221.06
	其中：货币基金	
	期货及衍生品交易保证金	13565576.80
	买入返售金融资产	144808448.07
	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	应收申购款#1100000.00 ；
基金负债情况	债券回购总额	
	融资、融券总额	
	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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	484960.00	0.15
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	40113864.29	12.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1040228.00	0.31
E	建筑业	35760.00	0.01
F	批发和零售业	3741115.00	1.13
G	交通运输、仓储和邮政业	2551286.58	0.77
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	4681505.00	1.41
J	金融业	5516345.00	1.66
K	房地产业	1015084.00	0.31
L	租赁和商务服务业	804440.00	0.24
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	178365.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	2144374.00	0.65
S	综合	0.00	0.00
	合计	62307326.87	18.77

注：以上分类采用中证协行业分类。

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	0.00	0.00

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	10099.372275
报告期期间基金总申购份额	4264.574358
减：报告期期间基金总赎回份额	1413.086948
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.000000
期末基金总份额/期末基金实缴总额	12950.859685

6、管理人报告（如有）

<p>1、 报告期内高管、基金经理及其关联基金经验：</p> <p>2、 基金运作合规守信情况： （样例：报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《私募基金投资监督管理办法》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。）</p> <p>3、 基金投资策略和业绩表现： （样例：报告期内，本基金坚持长期投资为主，以成长加价值、“自下而上”精选个股的投资模式，重点投资处于转型期、有长期发展空间的成长个股，积极关注实体经济在转型期各个细分领域的成长机会，主要投资于国企改革、互联网相关领域、“工业4.0”、医药行业、医疗服务和医疗器械、营销、软件等行业的个股，减持了部分前期涨幅过快、估值泡沫化明显的股票。） 截至2024年第一季度，本基金当季净值增长率为7.60%，报告期期末单位净值为2.493。</p> <p>4、 对宏观经济、证券市场及其行业走势展望：</p> <p>5、 内部基金监察稽核工作、基金估值程序（见基金合同“基金的估值”章节）、基金运作情况和运用杠杆情况： （样例：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。）</p> <p>6、 投资收益分配和损失承担情况、（适用基金合同中允许分配条款的产品，如不适用本项空） （样例：本基金本报告期末进行利润分配，无损失承担情况发生，符合相关法规及基金合同的规定。）</p> <p>7、 会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项：（不适用则本项空）</p> <p>8、 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： （样例：基金合同规定的基金终止情形，报告期内是否触发。）</p>
--

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

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。