

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	宁水多策略私募证券投资基金
基金编码	SCC900
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	2018-01-03
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	7976.966818
投资目标	在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	本基金采取灵活的资产配置体系，通过对宏观经济环境、经济增长前景、通货膨胀水平、各类别资产的风险收益特征水平进行综合分析，并结合市场趋势、投资期限、预期收益目标，灵活动态地配置和调整权益类、固定收益类资产配置比例，并从基金历史业绩、基金经理历史业绩及管理人综合能力等多角度对基金进行评价，优选出适合本基金的公募基金、私募基金、资管计划等基金进行投资。此外，本基金结合场内期货和期权、场外衍生品等衍生工具及融资融券交易，实现本基金的投资目标。
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】级的投资品种，适合具有【C5】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	2.21			
自基金合同生效起至今	209.20			

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	5603157.43

本期利润	4831542.12
期末基金净资产	246648252.47
报告期期末单位净值	3.092

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	2005.01
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	66336684.33
	存出保证金	35537892.65
	股票投资	38918498.45
	债券投资	3637387.65
	其中：银行间市场债券	
	其中：利率债	3637387.65
	其中：信用债	
	资产支持证券	
	基金投资（公募基金）	24817120.07
	其中：货币基金	
	期货及衍生品交易保证金	35537892.65
	买入返售金融资产	77451342.11
	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	应收股利#37243.69 ；场外衍生品#275646.98 ；
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	239449.00	0.10
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	20054911.20	8.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1555324.00	0.63
E	建筑业	459516.00	0.19
F	批发和零售业	1911913.00	0.78
G	交通运输、仓储和邮政业	1253861.00	0.51
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	1320285.80	0.54
J	金融业	1495966.00	0.61
K	房地产业	965263.00	0.39
L	租赁和商务服务业	323000.00	0.13
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	64860.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	856153.00	0.35
S	综合	0.00	0.00
	合计	30500502.00	12.37

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	8417996.45	3.41
合计	8417996.45	3.41

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	3310.843336
报告期期间基金总申购份额	5469.842746
减：报告期期间基金总赎回份额	803.719264
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	7976.966818

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： 本基金经理为程平庚，毕业于厦门大学，金融工程专业，经济学学士。曾在股份制银行、证券公司、私募基金等金融机构任职。有10多年证券、期货研究和投资经验。目前专注行业、产业链和公司基本面研究，擅长期货策略研究。</p> <p>2、基金运作合规守信情况： 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： 截至2024年第二季度，本基金当季净值增长率为2.21%，报告期期末单位净值为3.092。</p> <p>4、对宏观经济、证券市场及其行业走势展望： 无</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： 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） 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： 无</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： 本基金不设置预警线和止损线。</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。