

# 私募基金信息披露年度报表

## 1、基金产品概况

### 1.1 基金基本情况

基金名称	宁水多策略私募证券投资基金
基金编码	SCC900
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2018-01-03
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）	
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	2100.511734
基金到期日期	2033-01-02

### 1.2 基金产品说明

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	本基金将根据宏观经济分析和整体市场估值水平的变化，采用自上而下与自下而上相结合的方式，从公司所属行业、核心竞争力、发展趋势、财务状况、管理层等因素入手，全面系统分析公司盈利的持续性及增长情况，选择盈利稳定增长或具有高速增长潜力，同时价格被低估的公司，构建资产组合，在降低市场风险的同时追求更高收益。
业绩比较基准（如有）	
风险收益特征	本基金风险等级为【R5】，风险收益特征为较高风险较高预期收益特征

### 1.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		厦门宁水私募基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭腾帅	邹婷
	联系电话	18659275923	020-66336504
	电子邮箱	243226012@qq.com	zouting@gf.com.cn
传真		0592-5280755	020-87553363-6504
注册地址		厦门市思明区环岛东路1801号1804单元	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址		厦门市思明区环岛东路1801号1804单元	广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼

邮政编码	361000	510627
法定代表人	陈昭斌	林传辉

#### 1.4 信息披露方式

合同约定
------

#### 1.5 其他相关资料（如有）

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）厦门分所	厦门市思明区前埔中二路843号
注册登记机构	广发证券股份有限公司	广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼
外包机构	广发证券股份有限公司	广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼
其他		

## 2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 2.1 主要会计数据和财务指标

期间数据和指标	2023年	2022年	2021年
本期已实现收益	2449103.88	-43795.43	-768520.38
本期利润	3827510.66	1302712.80	-6718511.02
期末数据和指标	2023年末	2022年末	2021年末
期末可供分配利润	32310384.86	26387207.61	38078436.69
期末可供分配基金份额利润	1.5382	1.2976	1.2771
期末基金净资产	57316991.25	49352289.54	70017132.65
报告期期末单位净值	2.729	2.427	2.348
累计期末指标	2023年末	2022年末	2021年末
基金份额累计净值增长率	172.90	142.70	134.80

### 2.2 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率（%）
当年	12.44			
自基金合同生效起至今	172.90			

## 2.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	每份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配 情况	备注
2023	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2022	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2021	0.0000	0.00	0.00	0.00	

## 3、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	2033.569626
报告期期间基金总申购份额	2484.176772
减：报告期期间基金总赎回份额	2417.234664
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	2100.511734

## 4、管理人说明的其他情况

1、报告期内高管、基金经理及其关联基金经验：

2、基金运作遵规守信情况：

（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》、《私募证券投资基金监督管理办法》、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。）

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2023年，本基金份额累计净值增长率为172.90%，当年净值增长率12.44%，报告期期末单位净值为 2.729。

4、对宏观经济、证券市场及其行业走势展望：

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。）

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。）

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）

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。)

## 5、托管人报告（如有）

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本基金托管人在托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》和相关法律法规的规定，以及基金合同和托管协议（如有）的约定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本基金托管人根据法律法规的规定以及基金合同和托管协议（如有）的约定对基金管理人的投资运作进行了监督，管理人在本基金投资运作过程中遵规守信情况良好。托管人对本基金报告期内的净值计算、利润分配情况进行了复核，未发现基金管理人在上述事项中存在违反基金合同和托管协议（如有）相关约定的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人依法对年度报告中托管履职期间的财务指标、净值表现、投资组合情况、利润分配情况（如有）、财务会计报告（如有）等财务信息进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## 6、年度财务报表

金额单位：元

### 6.1 资产负债表

资产	2023-12-31	2022-12-31
资产：		
银行存款	31447.89	6361.03
结算备付金	16597033.85	12377323.06
存出保证金	13032065.38	12060348.55
交易性金融资产	22977154.80	21806258.47
其中：股票投资	14608364.85	14383061.17
基金投资	8368789.95	7423197.30
债券投资	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
贵金属投资	0.00	0.00
衍生金融资产	991549.00	258230.00
买入返售金融资产	3994745.12	3437074.43
应收证券清算款	162533.91	0.00
应收利息	0.00	0.00
应收股利	4990.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
递延所得税资产	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产总计	57791519.95	49945595.54

负债和所有者权益	2023-12-31	2022-12-31
负债：		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	251365.00	448365.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	157368.56	128005.01
应付托管费	1573.72	1279.97
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	0.00	0.00
应交税费	62647.70	14376.05
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
递延所得税负债	0.00	0.00
其他负债	1573.72	1279.97
负债合计	474528.70	593306.00
所有者权益：		
实收基金	21005117.34	20335696.26
未分配利润	36311873.91	29016593.28
所有者权益合计	57316991.25	49352289.54
负债和所有者权益总计	57791519.95	49945595.54

## 6.2 利润表

项目	本期	上年度可比期间
	2023-01-01 至 2023-12-31	2022-01-01至 2022-12-31
一、收入	5330951.65	2102462.65
1、利息收入	190389.66	109732.06
其中：存款利息收入	84250.24	5018.16
债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产收入	106139.42	104713.90
其他利息收入	0.00	0.00
2、投资收益（损失以“-”填列）	3878514.58	749234.88
其中：股票投资收益	-977809.96	-1093487.33
基金投资收益	-70287.23	-30308.39
债券投资收益	0.00	171.37
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
贵金属投资收益	0.00	0.00

衍生工具收益	4691978.90	1509469.29
股利收益	234632.87	363389.94
3、公允价值变动收益 (损失以“-”填列)	1379006.74	1346508.23
4、汇兑收益(损失以“-”填列)	0.00	0.00
5、其他收入(损失以“-”填列)	-116959.33	-103012.52
减：二、费用	1503440.99	799749.85
1. 管理人报酬	1206952.06	584972.74
其中：固定管理费	532404.55	562388.42
业绩报酬	674547.51	22584.32
2、托管费	5324.17	8735.13
3、销售服务费	0.00	0.00
4、外包服务费	5324.17	7006.60
5、交易费用	269456.12	186463.87
6、利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
7、其他费用	16384.47	12571.51
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	3827510.66	1302712.80
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	3827510.66	1302712.80

备注：

报告截止日：2023年12月31日；暂估业绩报酬：489907.41元；暂估管理人报酬是按照期末时点暂估计算，与投资者实际承担的管理人报酬可能存在差异。

### 6.3 所有者权益变动表

项目	本期 2023-01-01 至 2023-12-31		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	20335696.26	29016593.28	49352289.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	0.00	3827510.66	3827510.66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	669421.08	3467769.97	4137191.05
其中：1、基金申购款	24841767.72	42688232.28	67530000.00
2、基金赎回款	-24172346.64	-39220462.31	-63392808.95

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	21005117.34	36311873.91	57316991.25
项目	2022-01-01 至 2022-12-31		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	29817494.09	40199638.56	70017132.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	1302712.80	1302712.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-9481797.83	-12485758.08	-21967555.91
其中：1、基金申购款	2412944.15	3137055.85	5550000.00
2、基金赎回款	-11894741.98	-15622813.93	-27517555.91
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	0	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	20335696.26	29016593.28	49352289.54

## 7、期末投资组合情况

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

项目	金额	
现金类资产	31447.89	
境内未上市、未挂牌公司股权投资	银行存款	
	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	
	结算备付金	16597033.85
	存出保证金	13032065.38
	股票投资	14608364.85
	债券投资	
	其中：银行间市场债券	
	其中：利率债	

境内证券投资规模	其中：信用债	
	资产支持证券	
	基金投资（公募基金）	8368789.95
	其中：货币基金	
	期货及衍生品交易保证金	13032065.38
	买入返售金融资产	3994745.12
	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#4990.00 ； 证券清算款#162533.91 ； 场外衍生品#477718.95 ；
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	

## 7.2 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	0.00	0.00



B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	5804989.09	10.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	367758.00	0.64
E	建筑业	0.00	0.00
F	批发和零售业	341890.00	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	228615.00	0.40
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	100620.00	0.18
J	金融业	1321576.00	2.31
K	房地产业	362642.00	0.63
L	租赁和商务服务业	134871.00	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	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	165354.00	0.29
S	综合	0.00	0.00
	合计	8828315.09	15.42

注：以上分类采用中证协行业分类。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合（如有）

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
港股通	5780049.76	10.08
合计	5780049.76	10.08

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。