

清水源 51 号 D 证券投资基金 2020 年

年报

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	清水源 51 号 D 证券投资基金
基金编码	S37662
基金运作方式	普通基金
基金合同生效日期	2015-06-30
基金管理人	深圳清水源投资管理有限公司
基金托管人（如有）	兴业银行股份有限公司
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）	305.008926
基金到期日期	2025-6-27

1.2 基金产品说明

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（如有）
名称	-	-
信息披露负责人	姓名	洪锦芳
	联系电话	021-62677777-218430
	电子邮箱	hongjf@cib.com.cn
传真	-	021-20505001
注册地址	-	福州市湖东路 154 号
办公地址	-	上海江宁路 168 号兴业大厦
邮政编码	-	200041
法定代表人	-	陶以平（代理行使法定代表人职权）

1.4 信息披露方式

1.5 其他相关资料（如有）

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	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	28,233.4300	-120,163.0400	-97242.72
本期利润	248,383.6600	890,903.6300	-649445.36
期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	0.0000	0.0000	0.0000
期末可供分配基金份额利润	0.0000	0.0000	0.0000
期末基金净资产	3,534,110.6900	4,323,927.0300	2,433,023.4000
报告期期末单位净值	1.1587	1.0676	0.8110
累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	15.87%	6.76%	-18.90%

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差（%）
当年	8.5300	-	-	-
自基金合同生效起至今	15.8700	-	-	-

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	年度利润分配合计	备注
2020 年	-	0.0000	0.0000	0.0000	-
2019 年	-	0.0000	0.0000	0.0000	-
2018 年	-	0.0000	0.0000	0.0000	-

3、基金份额变动情况

报告期期初基金份额总额	405.008926
报告期期间基金总申购份额	0.000000
减：报告期期间基金总赎回份额	100
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	305.008926
------------------	------------

4、管理人说明的其他情况

（如报告期内高管、基金经理及其关联基金经验、基金运作合规守信情况、基金投资策略和业绩表现、对宏观经济、证券市场及其行业走势展望、内部基金监察稽核工作、基金估值程序、基金运作情况和运用杠杆情况、投资收益分配和损失承担情况、会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项、对本基金持有人数或基金资产净值预警情形等）

5、托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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

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

6、年度财务报表

金额单位：元

6.1 资产负债表

资产	本期末 2020/12/31	上年度末 2019/12/31
资产：		
银行存款	5,021.5300	6,896.0200
结算备付金	0.0000	0.0000
存出保证金	0.0000	0.0000
交易性金融资产	3,611,800.4700	4,400,934.9100
其中：股票投资	0.0000	0.0000
基金投资	3,611,800.4700	4,400,934.9100
债券投资	0.0000	0.0000
资产支持证券投资	0.0000	0.0000
贵金属投资	0.0000	0.0000
衍生金融资产	0.0000	0.0000
买入返售金融资产	0.0000	0.0000
应收证券清算款	0.0000	0.0000
应收利息	0.0000	0.0000
应收股利	0.0000	0.0000
应收申购款	0.0000	0.0000
递延所得税资产	0.0000	0.0000

其他资产	0.0000	0.0000
资产总计	3,616,822.0000	4,407,830.9300
负债和所有者权益	本期末 2020/12/31	上年度末 2019/12/31
负债：		
短期借款	0.0000	0.0000
交易性金融负债	0.0000	0.0000
衍生金融负债	0.0000	0.0000
卖出回购金融资产款	0.0000	0.0000
应付证券清算款	0.0000	0.0000
应付赎回款	0.0000	0.0000
应付管理人报酬	80,939.1200	81,842.9300
应付托管费	1,329.1700	1,545.7400
应付销售服务费	0.0000	0.0000
应付交易费用	0.0000	0.0000
应交税费	0.0000	0.0000
应付利息	0.0000	0.0000
应付利润	0.0000	0.0000
递延所得税负债	0.0000	0.0000
其他负债	443.0200	515.23
负债合计	82,711.3100	83903.9
所有者权益：		
实收基金	3,050,089.2600	4,050,089.2600
未分配利润	484,021.4300	273,837.7700
所有者权益合计	3,534,110.6900	4,323,927.0300
负债和所有者权益总计	3,616,822.0000	4407830.93

6.2 利润表

项目	本期	上年度可比期间
	2020-01-01 至 2020-12-31	2019-01-01 至 2019-12-31
一、收入	375,080.6000	1,012,468.2100
1. 利息收入	31.5400	160.3500
其中：存款利息收入	31.5400	160.3500
债券利息收入	0.0000	0.0000
资产支持证券利息收入	0.0000	0.0000
买入返售金融资产收入	0.0000	0.0000
其他利息收入	0.0000	0.0000
2. 投资收益（损失以“-”填列）	154,898.8300	1,241.1900
其中：股票投资收益	0.0000	0.0000
基金投资收益	154,898.8300	1,241.1900
债券投资收益	0.0000	0.0000
资产支持证券投资收益	0.0000	0.0000
贵金属投资收益	0.0000	0.0000

衍生工具收益	0.0000	0.0000
股利收益	0.0000	0.0000
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	220,150.2300	1,011,066.6700
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	0.0000	0.0000
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	0.0000	0.0000
减：二、费用	126696.94	121564.58
1. 管理人报酬	119,059.9400	114,482.2200
其中：固定管理费	49,639.9100	46,035.7100
业绩报酬	69,420.0300	68,446.5100
2. 托管费	5,727.7700	5,311.8000
3. 销售服务费	0.0000	0.0000
4. 外包服务费	1,909.2300	1,770.5600
5. 交易费用	0.0000	0.0000
6. 利息支出	0.0000	0.0000
其中：卖出回购金融资产支出	0.0000	0.0000
7. 其他费用	0.00	0.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	248383.66	890903.63
减：所得税费用	0.0000	0.0000
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	248383.66	890903.63

6.3 所有者权益变动表

项目	本期 2020-01-01 至 2020-12-31		
	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）	4,050,089.2600	273,837.7700	4,323,927.0300
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.0000	248,383.6600	248,383.6600
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）	-1,000,000.0000	-38,200.0000	-1,038,200.0000
其中：1. 基金申购款	0.0000	0.0000	0.0000
2. 基金赎回款	-1,000,000.0000	-38,200.0000	-1,038,200.0000
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）	0.0000	0.0000	0.0000
五、期末所有者权益（基金净值）	3,050,089.2600	484,021.4300	3,534,110.6900

项目	上年度可比期间 2019-01-01 至 2019-12-31		
	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）	3,000,000.0000	-566976.6	2433023.4
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.0000	890,903.6300	890,903.6300
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）	1,050,089.2600	-50,089.2600	1,000,000.0000
其中：1. 基金申购款	1,050,089.2600	-50,089.2600	1,000,000.0000
2. 基金赎回款	0.0000	0.0000	0.0000
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）	0.0000	0.0000	0.0000
五、期末所有者权益（基金净值）	4,050,089.2600	273837.77	4323927.03

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	银行存款	5,021.53
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	0.00
	其中：优先股	0.00
	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	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	结算备付金	0.00
	存出保证金	0.00
	股票投资	0.00
	债券投资	0.00
	其中：银行间市场债券	0.00
	其中：利率债	0.00
	其中：信用债	0.00
	资产支持证券	0.00
	基金投资（公募基金）	0.00
	其中：货币基金	0.00

	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	-
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	S37441#3611800.47;
	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	0.00
	融资、融券总额	0.00
	其中：融券总额	0.00
	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

7.2.1 报告期末含行业分类的境内股票投资组合

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	0.0000	0.00

B	采矿业	0.0000	0.00
C	制造业	0.0000	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.0000	0.00
E	建筑业	0.0000	0.00
F	批发和零售业	0.0000	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	0.0000	0.00
H	住宿和餐饮业	0.0000	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	0.0000	0.00
J	金融业	0.0000	0.00
K	房地产业	0.0000	0.00
L	租赁和商务服务业	0.0000	0.00
M	科学研究和技术服务业	0.0000	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	0.0000	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	0.0000	0.00
P	教育	0.0000	0.00
Q	卫生和社会工作	0.0000	0.00
R	文化、体育和娱乐业	0.0000	0.00
S	综合	0.0000	0.00
	合计	0.0000	0.00

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	-	-
合计	0.0000	0.0000

信息披露报告是否经托管机构复核：