

清水源 51 号 D 证券投资基金 2024 年第 2 季度报告

1、基金基本情况

| 项目                       | 信息                |
|--------------------------|-------------------|
| 基金名称                     | 清水源 51 号 D 证券投资基金 |
| 基金编码                     | S37662            |
| 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）                 |                   |
| 基金运作方式                   | 开放式               |
| 基金成立日期                   | 2015-06-30        |
| 期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元） | 105.008926        |
| 投资目标                     | -                 |
| 投资策略                     | -                 |
| 业绩比较基准（如有）               | -                 |
| 风险收益特征                   | -                 |

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         | -5.30    | -           | -            | -               |
| 自基金合同生效起至今 | -6.87    | -           | -            | -               |

备注：

注：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  
如为分级基金，应按级别分别列示。  
表中指标均以不带百分号数值形式填写，请保留至小数点后 2 位。

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   | -664.03                 |
| 本期利润      | -54,680.73              |
| 期末基金净资产   | 977,934.57              |
| 报告期期末单位净值 | 0.9313                  |

备注：

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

#### 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           | 银行存款              | 2,882.22 |
| 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           | 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        | 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）        | -        |
|                 | 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 | 0.00     |
|                 | 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 | 0.00     |
|                 | 期货公司及其子公司         | 0.00     |

|         |               |                     |
|---------|---------------|---------------------|
|         | 资产管理计划投资      |                     |
|         | 私募基金产品投资      | S37441#978, 875. 13 |
|         | 未在协会备案的合伙企业份额 | 0.00                |
| 另类投资    | 另类投资          | 0.00                |
| 境内债权类投资 | 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    | 境外投资          | 0.00                |
| 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        | 0.00                |
|         | 其他融资总额        |                     |

备注： -

#### 4.2.1 期末按行业分类的股票投资组合(不含沪港通)

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              | 0.00 | 0.00         |
| C  | 制造业              | 0.00 | 0.00         |
| 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  | 0.00 | 0.00         |
| 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        | 0.00 | 0.00 |

备注： -

#### 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 | 占基金资产净值比例（%） |
|------|------|--------------|
|      | 0.00 | 0.00         |
| 合计   | 0.00 | 0.00         |

备注： -

### 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               | 105.008926 |
| 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            | 0.000000   |
| 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          | 105.008926 |

备注：

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

如基金成立日晚于报告期期初，则以基金成立日的基金份额总额作为报告期期初基金份额总额。

### 6、管理人报告

（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、可能存在的利益冲突等）

信息披露报告是否经托管机构复核：是