

# 清水源 26 号 C 基金 2024 年年度报告

## 1、基金产品概况

### 1.1 基金基本情况

|                          |                  |
|--------------------------|------------------|
| 基金名称                     | 清水源 26 号 C 基金    |
| 基金编码                     | S36963           |
| 基金运作方式                   | 开放式              |
| 基金成立日期                   | 2015 年 05 月 07 日 |
| 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）                | 招商证券股份有限公司       |
| 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） | 1,293.15159      |
| 基金到期日期                   | 9999 年 12 月 31 日 |

### 1.2 基金产品说明

|            |                                                                                                                                                                                                                                                    |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标       | (1) 本基金的投资目标为“清水源 26 号基金”；<br>(2) “清水源 26 号基金”的投资目标为：本基金以绝对收益为目标，在风险有效控制的基础上，主动投资于具有良好流动性的金融工具，力争投资资产的稳健增值。                                                                                                                                        |
| 投资策略       | 本基金的投资策略为将基金资产定向投资于“清水源 26 号基金”。“清水源 26 号基金”的投资策略为：本基金投资组合将采取动态优化的投资策略，根据宏观经济的基本情况、证券市场走势、主流研究机构的眼光及市场热点等情况及时优化组合配置。股票配置关注各板块或行业的历史估值、现在估值及基本面的发展趋势。个股选择主要考虑公司发展和盈利的稳定性、成长性和目前估值的合理性。在遵守基金合同约定和坚持公司投资理念的大方向基本上，坚持稳健进取的原则，坚持定性分析和定量分析，追求本计划资产的稳定增值。 |
| 业绩比较基准（如有） | -                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 风险收益特征     | 本基金具有较高收益、较高风险的特征。                                                                                                                                                                                                                                 |

### 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      | 深圳清水源投资管理有限公司 | 招商证券股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 陈罗辉        | 韩鑫普        |



|       |      |                                      |                      |
|-------|------|--------------------------------------|----------------------|
|       | 联系电话 | 13713985080                          | 0755-82943666        |
|       | 电子邮箱 | chenluohui@qsyfunds.com              | tgb@cmschina.com.cn  |
| 传真    |      | 0755-83135996                        | 0755-82960794        |
| 注册地址  |      | 深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 6009 号新世界商务中心 1903 | 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 |
| 办公地址  |      | 深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 6009 号新世界商务中心 1903 | 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 |
| 邮政编码  |      | 518000                               | 518000               |
| 法定代表人 |      | 冯文光                                  | 霍达                   |

#### 1.4 信息披露方式

|   |
|---|
| - |
|---|

#### 1.5 其他相关资料（如有）

| 项目     | 名称         | 办公地址                 |
|--------|------------|----------------------|
| 会计师事务所 | -          | -                    |
| 注册登记机构 | 招商证券股份有限公司 | 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 |
| 外包机构   | 招商证券股份有限公司 | 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 |
| —      | -          | -                    |

### 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      | 2024 年        | 2023 年        | 2022 年        |
|--------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期已实现收益      | -7,083.29     | 19,125.75     | -6,560.86     |
| 本期利润         | 825,044.27    | -1,053,162.09 | -560,083.87   |
| 期末数据和指标      | 2024 年末       | 2023 年末       | 2022 年末       |
| 期末可供分配利润     | -6,964,352.56 | -4,480,585.61 | -5,040,199.49 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.5386       | -0.5378       | -0.5402       |
| 期末基金净资产      | 9,037,973.67  | 5,612,929.40  | 7,406,991.49  |
| 报告期末单位净值     | 0.6989        | 0.6738        | 0.7938        |
| 累计期末指标       | 2024 年末       | 2023 年末       | 2022 年末       |
| 基金份额累计净值增长率  | -30.11%       | -32.62%       | -20.62%       |



## 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         | 3.73     | -           | -            | -               |
| 自基金合同生效起至今 | -30.11   | -           | -            | -               |

注：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当年净值增长率=（本年度末累计净值-上年度末累计净值）/上年度末累计净值

## 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 |
|------|-----------|----------|-----------|----------|----|
| 2024 | 0.00      | 0.00     | 0.00      | 0.00     | -  |
| 2023 | 0.00      | 0.00     | 0.00      | 0.00     | -  |
| 2022 | 0.00      | 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              | 833.056032  |
| 报告期间基金总申购份额              | 460.095558  |
| 减：报告期间基金总赎回份额            | 0.00        |
| 报告期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.00        |
| 期末基金总份额/期末基金实缴总额         | 1,293.15159 |

## 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

现投资经理为冯文光。

董事长冯文光，中山大学金融学硕士，17年基金从业经验，曾在诺安基金、金鹰基金、大成基金任职，多年担任基金经理。拥有丰富的基金管理经验，经历市场牛熊历练，业绩优异，排名靠前。

### 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。

### 3、基金投资策略和业绩表现：

本基金定向投资于“清水源26号基金”，“清水源26号基金”的股票配置中，在板块和行业选择中主要看各板块或行业的历史估值、现在估值及基本面的发展趋势。并对历史估值和现在估值进行纵向对比分析、对各行业间的估值进行横向比较分析，对基本面发展变化进行敏感性分析后再做出最终的配置选择；个股选择时主要考虑公司发展和盈利的稳定性与否、成长性高低和目前估值的合理性与否等问题。在遵守产品合同规定和坚持公司投资理念的大方向基础上，考虑上市公司的素质以及市场所依存的环境、现阶段市场特征、市场的投资者结构，坚持稳健进取原则，



坚持定性分析和定量分析，追求管理资产的稳定增值。季度业绩表现参见本报告前述净值数据。

#### 4、对宏观经济、证券市场及其行业走势展望：

2025 年，我们认为中国 A 股市场将呈现震荡反弹的走势。预计高股息的价值股全年将取得绝对收益；以科技龙头为代表的恒生科技指数长期看将取得超额收益。

主要投资逻辑如下：（1）中国 AI 公司 DeepSeek 发布的开源模型引起全球广泛关注，该模型以其高性价比和出色的性能表现，与美国的模型相媲美；（2）中国在其他科技领域也取得重大进展，中长期重点看好以科技龙头公司为代表的恒生科技指数，A 股科技行业则由于公司数量太多容易出现暴涨暴跌的超高波动特征；（3）由于全球贸易争端风险急剧上升，政府或将加大政策支持力度，更多支持经济发展及民生改善的刺激政策值得期待；（4）由于财政、货币、资本市场等经济刺激政策强有力，短期经济数据有所改善；（5）中美关于关税方面的博弈逐步加剧，而中美科技竞争博弈更加值得期待，中国科技资产存在重估的过程，中国企业展现出强劲后劲，有望带领中国股市克服外部因素的负面影响。

操作策略上，清水源投资团队倾向于围绕人工智能、数字经济等科技产业及高股息、低价值的价值股进行配置。

#### 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：

2024 年 1 月份的 A 股市场，沪深 300 和上证指数的跌幅相对较小，但也有-6.29%、-6.27%。代表小盘股的中证 2000 跌幅-20.97%，创业板指跌幅-16.81%，科创 50 跌幅-19.62%，除了高股息的红利板块仍残留一丝暖意外，整个市场寒冷彻骨。

2 月份的 A 股的走势颇感波折，2 月 1 日到 2 月 5 日期间，市场延续了一月份的弱势，A 股出现了无差别的恐慌性下跌。小市值的股票更是出现严重的无量暴跌的踩踏现象。2 月 7 日，中共中央决定，任命吴清同志为中国证券监督管理委员会党委书记，国务院决定，任命吴清为中国证券监督管理委员会主席。节前最后一个交易日，微盘股指数大幅上涨，节后股市继续上涨反弹，截至 2 月底，沪深 300 指数与上证指数已经完全收复了开年以来的失地。沪深 300 指数和上证综指 2 月份分别上涨 9.35%和 8.13%。

3 月份的 A 股市场，继 1 月份暴跌，2 月 8 日启动暴力反弹后，出现了整固的走势，全月市场整体波动降低，全月沪深 300 指数微涨了 0.61%，上证指数上涨 0.86%，创业板指上涨 0.62%。

4 月份的 A 股市场，沪深 300 指数继续上涨了 1.89%，上证指数上涨 2.09%。中国资产中，表现更为突出的是港股市场，恒生指数和恒生科技指数 4 月份的涨幅分别为 7.39%、6.42%。与此同时，全球投资者心中青睐的美国股市和日本股市，4 月份出现在下跌榜前列，纳指和日经 225 指数 4 月份跌幅分别为-4.41%、-4.86%。叠加日元汇率到 4 月底对美元贬值了-11.66%。

5 月份的 A 股市场，万得全 A 全月涨跌幅为-1.2%，沪深 300 指数全月下跌了 0.68%，国证 2000、最小市值指数、北证 50 的涨跌幅分别为-2.48%、-3.83%、-5.24%。代表大蓝筹的沪深 300 指数今年上涨了 4.34%，大盘权重股占主导的上证指数上涨了 3.76%。全市场下跌的股票占比全 A 股票的 78.97%。全市场中位数股票的涨跌幅为-16.51%。低估值高股息、高景气上游资源、贵金属、筹码出清的优质公司板块，正在走持续上涨的行情。

6 月份的 A 股市场，万得全 A 继续下跌，涨跌幅为-5.13%，沪深 300 涨跌幅为-3.69%；国证 2000、最小市值指数、北证 50 的涨跌幅分别为-8.42%、-5.70%、-8.12%；上证指数下跌了-4.02%，再次失守 3000 点，全月日均成交量不足 7000 亿元，市场情绪较为低迷，机构普遍认为整荡筑底是主基调。

7 月份的 A 股市场，万得全 A 指数全月微涨 0.27%，沪深 300 指数微跌 0.57%，多数宽基指数延续调整。

8 月份的 A 股市场继续延续此前的弱势，虽在神秘增量资金的推动下各国有大行股价创出了新高，但是其他多数公司的股价依然继续下行探底。万得全 A 指数全月下跌 3.97%，沪深 300 下



跌 3.51%，两市成交额缩量至 0.6 万亿，本月亏钱效应进一步加重。

9 月份的中国股市先抑后扬。23 日以前，市场依然延续低迷态势，一路缩量下跌。9 月 24 日上午央行、金监总局、证监会召开的“金融支持高质量发展”的新闻发布会，在重大经济及股市政策刺激下，股市开始加速上涨。当天万得全 A 指数上涨了 4.03%，罕见收出一根大阳线。在随后的四个交易日，包括港股、中概股、A 股在内的中国资产受到疯狂追捧。几个交易日有罕见的大幅跳空高开现象发生。由于交易太过火爆，9 月 27 日甚至出现了上交所交易系统疑似异常的现象，一些投资者反映上交所的一些买单和卖单长时间处于“已报未成交”状态。国庆长假前最后一个交易日，中国股市交易额更是刷新了历史记录，9 月份万得全 A 和沪深 300 指数月度涨幅分别为 22.21%、20.97%。截止 9 月底，所有 A 股主要的宽基指数年度涨幅均已转正，万得全 A 和沪深 300 的涨幅分别为 8.2% 和 17.1%。

10 月初，A 股市场在国庆假期后开盘，受多项政策利好影响，节后开盘当日市场情绪高涨高开但尾盘回落，振幅巨大。截至 10 月末，上证指数收于 3279.8 点，环比下降 1.7%；深证成指收于 10591.2 点，环比上涨了 0.6%。10 月份，沪深两市日均交易量环比和同比均增长超过 130%，显示市场活跃度显著提升。

11 月，A 股市场延续反弹趋势，主要指数持续走高。其中，创业板指数表现突出，月内涨幅超过 2%。11 月中旬，监管层发布多项政策，鼓励并购重组，提升市场信心。

12 月，A 股市场震荡上行，成交额仍居高不下。截至 12 月 31 日，上证指数全年累计上涨 12.67%，深证成指上涨 9.34%，创业板指上涨 13.23%，可见 A 股市场在 2024 年实现了较好的年度表现。

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、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。本基金无杠杆操作。

#### 6、投资收益分配和损失承担情况

本基金本报告期未进行利润分配，无损失承担情况发生，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 7、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：

本基金合同未约定预警线和止损线，也不存在利益冲突。

## 5、托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人违规守信情况声明

本报告期，本托管人——招商证券股份有限公司在对本基金的托管过程中，严格遵守有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

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

本托管人按照基金合同的约定，对本基金报告期的基金资产净值进行了复核；同时依据法律法规和基金合同规定，在托管人履行的投资监督范围内，对本基金报告期的投资情况进行了监督。在本基金合同约定的投资监督范围内，托管人未发现报告期内管理人违反基金合同约定的事项。报告期内，本基金的利润分配情况详见本报告中“2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况”部分。



### 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

基于基金管理人提供的必要的估值要素，本托管人参照《私募投资基金监督管理暂行办法》、《私募投资基金信息披露管理办法》等法律法规和基金合同的约定，对基金管理人报告中的主要财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容的真实性、准确性和完整性进行了复核，未发现异常。

## 6、年度财务报表

### 6.1 资产负债表

金额单位：元

| 资产              | 2024-12-31        | 2023-12-31        |
|-----------------|-------------------|-------------------|
| <b>资产：</b>      |                   |                   |
| 银行存款            | 1,113.06          | 587.61            |
| 结算备付金           | 0.00              | 0.00              |
| 存出保证金           | 0.00              | 0.00              |
| 交易性金融资产         | 0.00              | 0.00              |
| 其中：股票投资         | 0.00              | 0.00              |
| 基金投资            | 0.00              | 0.00              |
| 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          | 0.00              | 0.00              |
| 买入返售金融资产        | 0.00              | 0.00              |
| 应收证券清算款         | 0.00              | 0.00              |
| 应收利息            | 0.00              | 0.00              |
| 应收股利            | 0.00              | 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            | 9,039,155.67      | 5,613,831.71      |
| 资产总计            | 9,040,268.73      | 5,614,419.32      |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>2024-12-31</b> | <b>2023-12-31</b> |
| <b>负债：</b>      |                   |                   |
| 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          | 0.00              | 0.00              |
| 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         | 2,295.06          | 1,489.92          |
| 应付托管费           | 0.00              | 0.00              |



|               |               |               |
|---------------|---------------|---------------|
| 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          | 0.00          | 0.00          |
| 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          | 0.00          | 0.00          |
| 负债合计          | 2,295.06      | 1,489.92      |
| <b>所有者权益：</b> |               |               |
| 实收基金          | 12,931,515.90 | 8,330,560.32  |
| 未分配利润         | -3,893,542.23 | -2,717,630.92 |
| 所有者权益合计       | 9,037,973.67  | 5,612,929.40  |
| 负债和所有者权益总计    | 9,040,268.73  | 5,614,419.32  |

注：1、其他资产：未被统计进前列分类的资产科目，主要包括其他私募基金、基金公司专户、券商资管计划、有限合伙企业股权、未上市企业股权等。

2、其他负债：未被统计进前列分类的负债科目，主要包括应付外包服务费、应付投资顾问费、应付咨询服务费等。

3、6.1 资产负债表中“股票投资”统计所有股票（含新三板股票）投资市值，7.1 章节中“股票投资”统计除新三板投资和上市公司定向增发股票投资以外的市值，新三板投资和上市公司定向增发股票投资有单独指标统计。

4、6.1 资产负债表中“应收股利”、“应收申购款”、“应收利息”单独列示，“其他资产”是总资产与已列明细资产项的轧差项，7.1 期末基金资产组合情况中“其他资产”中除总资产与已列明细资产项的轧差项外，还包含“应收股利”、“应收申购款”、“应收利息”。

## 6.2 利润表

| 项目                | 本期                                 | 上年度可比期间                            |
|-------------------|------------------------------------|------------------------------------|
|                   | 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 | 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日 |
| <b>一、收入</b>       | 831,526.01                         | -1,046,446.03                      |
| 1. 利息收入           | 2.02                               | 1.53                               |
| 其中：存款利息收入         | 2.02                               | 1.53                               |
| 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        | 0.00                               | 0.00                               |
| 其他利息收入            | 0.00                               | 0.00                               |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | -603.57                            | 25,840.28                          |
| 其中：股票投资收益         | 0.00                               | 0.00                               |
| 基金投资收益            | 0.00                               | 0.00                               |



|                            |                   |                      |
|----------------------------|-------------------|----------------------|
| 债券投资收益                     | 0.00              | 0.00                 |
| 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                     | 0.00              | 0.00                 |
| 股利收益                       | 0.00              | 0.00                 |
| 其他收益                       | -603.57           | 25,840.28            |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 832,127.56        | -1,072,287.84        |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         | 0.00              | 0.00                 |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 0.00              | 0.00                 |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>6,481.74</b>   | <b>6,716.06</b>      |
| 1. 管理人报酬                   | 6,407.74          | 6,716.06             |
| 其中：固定管理费                   | 6,407.74          | 6,716.06             |
| 业绩报酬                       | 0.00              | 0.00                 |
| 2. 托管费                     | 0.00              | 0.00                 |
| 3. 销售服务费                   | 0.00              | 0.00                 |
| 4. 外包服务费                   | 0.00              | 0.00                 |
| 5. 交易费用                    | 0.00              | 0.00                 |
| 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                    | 74.00             | 0.00                 |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>825,044.27</b> | <b>-1,053,162.09</b> |
| <b>减：所得税费用</b>             | <b>0.00</b>       | <b>0.00</b>          |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>825,044.27</b> | <b>-1,053,162.09</b> |

注：其他收益：未被统计进前列分类的损益类科目，主要包括投资于其他私募基金、基金公司专户、券商资管计划、有限合伙企业股权、未上市企业股权等产生的投资收益。

### 6.3 所有者权益变动表

金额单位：元

| 项目                       | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 |               |              |
|--------------------------|-------------------------------|---------------|--------------|
|                          | 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）          | 8,330,560.32                  | -2,717,630.92 | 5,612,929.40 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | 0.00                          | 825,044.27    | 825,044.27   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值        | 4,600,955.58                  | -2,000,955.58 | 2,600,000.00 |



|                                        |                                    |               |               |
|----------------------------------------|------------------------------------|---------------|---------------|
| 变动数（净值减少以“-”号填列）                       |                                    |               |               |
| 其中：1. 基金申购款                            | 4,600,955.58                       | -2,000,955.58 | 2,600,000.00  |
| 2. 基金赎回款                               | 0.00                               | 0.00          | 0.00          |
| 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）                        | 12,931,515.90                      | -3,893,542.23 | 9,037,973.67  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |               |               |
|                                        | 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）                        | 9,330,560.32                       | -1,923,568.83 | 7,406,991.49  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | 0.00                               | -1,053,162.09 | -1,053,162.09 |
| 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）      | -1,000,000.00                      | 259,100.00    | -740,900.00   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 0.00                               | 0.00          | 0.00          |
| 2. 基金赎回款                               | -1,000,000.00                      | 259,100.00    | -740,900.00   |
| 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）                        | 8,330,560.32                       | -2,717,630.92 | 5,612,929.40  |

## 7、期末投资组合情况

### 7.1 期末基金资产组合情况

| 项目              |              | 金额单位：元   |
|-----------------|--------------|----------|
| 项目              |              | 金额       |
| 现金类资产           | 银行存款         | 1,113.06 |
| 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）        | 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           | 0.00                   |
| 资管计划投资  | 商业银行理财产品投资        | 0.00                   |
|         | 信托计划投资            | 0.00                   |
|         | 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        | 0.00                   |
|         | 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资产管理计划投资 | 0.00                   |
|         | 私募基金产品投资          | S29071#9, 039, 155.67; |
|         | 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              | 0.00                   |
| 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            | 0.00                   |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：元

| 序号 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|------|------|------------------|
|----|------|------|------------------|



|   |                  |      |      |
|---|------------------|------|------|
| 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 |

#### 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(%) |
|----------|-----------|--------------|
| 能源       | 0.00      | 0.00         |
| 原材料      | 0.00      | 0.00         |
| 工业       | 0.00      | 0.00         |
| 非日常生活消费品 | 0.00      | 0.00         |
| 日常消费品    | 0.00      | 0.00         |
| 医疗保健     | 0.00      | 0.00         |
| 金融       | 0.00      | 0.00         |
| 信息技术     | 0.00      | 0.00         |
| 通讯业务     | 0.00      | 0.00         |
| 公用事业     | 0.00      | 0.00         |
| 房地产      | 0.00      | 0.00         |
| 合计       | 0.00      | 0.00         |



信息披露报告是否经托管机构复核：是

