

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 | 清水源-诺亚 2 期证券投资基金 |
| 基金编号 | S61666 |
| 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） | 中信证券股份有限公司 |
| 投资顾问（如有） | |
| 基金运作方式 | 开放式 |
| 基金合同生效日期 | 2015-07-01 |
| 报告期末基金份额总额 | 37,700,887.72 |
| 投资目标 | 通过投资于由专业化投资团队管理、投资业绩良好的私募证券投资基金，获得持续、稳定的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金的资产主要用于购买并持有“诺亚清水源 36 号证券投资基金”（下称“标的基金”，在中国基金业协会备案代码：S34046）的基金份额，剩余资金可以投资于银行存款、货币市场基金和现金类银行理财产品等。 |
| 业绩比较基准（如有） | 无 |
| 风险收益特征 | 基于本基金投资的“诺亚清水源 36 号证券投资基金”标的基金的投资范围及投资策略，本基金不承诺保本及最低收益，本基金具有中高收益、中高风险的特征。适合具有风险识别、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 | 3.93 | | | |
| 自基金合同生效起至今 | -2.10 | | | |

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）/上季度末净值

3、主要财务指标

单位：元

| 项目 | 2017-01-01 至 2017-03-31 |
|----------|-------------------------|
| 本期已实现收益 | -206,109.87 |
| 本期利润 | 1,418,243.24 |
| 期末基金资产净值 | 36,900,928.25 |
| 期末基金份额净值 | 0.979 |

4、投资组合情况

4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

| 序号 | 项目 | 金额 (××元) | 占基金总资产的 比例(%) |
|----|-------------------|---------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | | |
| | 其中：普通股 | | |
| | 存托凭证 | | |
| 2 | 基金投资 | | |
| 3 | 固定收益投资 | | |
| | 其中：债券 | | |
| | 资产支持证券 | | |
| 4 | 金融衍生品投资 | | |
| | 其中：远期 | | |
| | 期货 | | |
| | 期权 | | |
| | 权证 | | |
| 5 | 买入返售金融资产 | | |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | | |
| 6 | 货币市场工具 | | |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 2,991.87 | 0.01 |
| | 其他 | 37,072,918.79 | 99.99 |
| | 合计 | 37,075,910.66 | 100.00 |

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

| | | | |
|---|-----------|--|--|
| Q | 卫生和社会工作 | | |
| R | 文化、体育和娱乐业 | | |
| S | 综合 | | |
| | 合计 | | |
| | | | |

4.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

金额单位：元

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

5、基金份额变动情况

单位：份

| | |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 40,300,936.82 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 0.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,600,049.10 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.00 |
| 报告期期末基金份额总额 | 37,700,887.72 |

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）