

## 清水源-诺亚 2 期证券投资基金 2017 年第 4 季度报告

### 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                                                                                                   |
| 基金成立日期     | 2015-07-01                                                                                            |
| 报告期末基金份额总额 | 11,028,672.01                                                                                         |
| 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<br>(%) | 净值增长率标准<br>差 (%) | 业绩比较基准收益<br>率 (%) | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>(%) |
|----------------|--------------|------------------|-------------------|-------------------------|
| 当季             | 0.6%         |                  |                   |                         |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 1.3%         |                  |                   |                         |
|                |              |                  |                   |                         |

☒ 无分级
 ☐ 二级基金
 ☐ 三级基金

### 3、主要财务指标

单位：元

| 项目 | 2017-10-01 至 2017-12-31 (元) |
|----|-----------------------------|
|----|-----------------------------|

|          |               |
|----------|---------------|
| 本期已实现收益  | 110,681.13    |
| 本期利润     | 78,264.06     |
| 期末基金资产净值 | 11,168,966.38 |
| 期末基金份额净值 | 1.013         |

#### 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<br>(人民币)   | 占基金总资产的<br>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      | 27,235.43     | 0.24%             |
|    | 其他                | 11,225,381.01 | 99.76%            |
|    |                   |               |                   |
|    | 合计                | 11,252,616.44 | 100%              |

##### 4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 4.2.1 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<br>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              |  |  |
|   | <b>合计</b>       |  |  |

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

### 5、基金份额变动情况

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 14,039,308.43 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 0             |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 3,010,636.42  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0             |
| 报告期期末基金份额总额               | 11,028,672.01 |

### 6、管理人报告

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

报告是否经托管机构复核：是