

宁水精选三期私募证券投资基金 2026 年第 2 季度报告



1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	宁水精选三期私募证券投资基金
基金编码	SX8915
基金管理人	厦门宁水私募基金管理有限公司
基金托管人（如有）	中泰证券股份有限公司
投资顾问（如有）	-
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2017 年 11 月 27 日
期末基金总份额（万份）/ 期末基金实缴总额（万元）	1, 028. 894718
投资目标	通过多品种多周期多策略组合交易，有效缩减风险敞口并实现稳健收益。
投资策略	通过自下而上的方式，选取拥有安全边际的投资标的，在风险可控的情况下获得合理回报。产品将控制风险作为组合管理的第一要务。
业绩比较基准（如有）	-
风险收益特征	本基金属于[R5]风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力[C5]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. 04	-	-	-
自基金合同生效 起至今	485. 66	-	-	-

3、主要财务指标

金额单位：元

项目	2026 年 4 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
本期已实现收益	-595, 825. 40
本期利润	-2, 130, 338. 63
期末基金净资产	60, 257, 833. 91
报告期期末单位净值	5. 8566

4、投资组合情况

4.1 期末基金资产组合情况

项目		金额
现金类资产	银行存款	
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	
	其中：优先股	-
	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	-
新三板投资	新三板挂牌企业投资	-
境内证券投资规模	结算备付金	18,038,839.08
	存出保证金	10,185,058.60
	股票投资	7,539,527.91
	债券投资	5,557,537.75
	其中：银行间市场债券	-
	其中：利率债	5,557,537.75
	其中：信用债	-
	资产支持证券	-
	基金投资（公募基金）	7,821,789.31
	其中：货币基金	-
	期货及衍生品交易保证金	10,185,058.60
	买入返售金融资产	9,462,034.11
	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	-
	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	-
	融资、融券总额	-
	其中：融券总额	-
	银行借款总额	-
	其他融资总额	-

申泰证券股份有限公司
托管估值核算业务专用章

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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	101,965.00	0.17
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,246,264.20	7.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	240,791.00	0.40
E	建筑业	22,840.00	0.04
F	批发和零售业	433,580.00	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	164,983.00	0.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	510,170.00	0.85
J	金融业	389,515.00	0.65
K	房地产业	28,636.00	0.05
L	租赁和商务服务业	90,514.00	0.15
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	10,164.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	201,932.00	0.34
S	综合	-	-
	合计	6,441,354.20	10.69

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（%）
港股通	1,098,173.71	1.82
合计	1,098,173.71	1.82

5、基金份额变动情况

报告期期初基金份额总额	339,814,652
报告期期间基金总申购份额	24,426,759
减：报告期期间基金总赎回份额	33,346,693
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
期末基金总份额/期末基金实缴总额	1,028.894718

单位：万份/万元
 中泰证券股份有限公司
 托管估值核算业务专用章

6、管理人报告

期末基金份额净值：5.8566 元；期末基金资产净值：60,257,833.91 元。

信息披露报告是否经托管机构复核：是

托管人复核说明：本基金托管人按照相关法律法规、基金合同的约定，基于本基金管理人提供的必要估值要素，对本基金在本报告中的财务数据进行了复核，核对一致。