

东源嘉盈三号私募证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

1、基金基本情况

| 项目 | 信息 |
|------------|--|
| 基金名称 | 东源嘉盈三号私募证券投资基金 |
| 基金编号 | SM8216 |
| 基金管理人 | 深圳市东源嘉盈资产管理有限公司 |
| 基金托管人（如有） | 无 |
| 基金运作方式 | 开放式 |
| 基金合同生效日期 | 2016 年 10 月 25 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 11,001,020.83 |
| 投资目标 | 在深入研究的基础上构建投资组合，在严格控制投资风险的前提下，力求获得长期稳定的投资回报 |
| 投资策略 | 管理人团队有多年证券理论学习及操盘经验的积累及长期跟踪上市公司研究实践，已经形成一套自己的交易模式，根据交易模型制定交易纪律，严格遵守法纪，控制风险，以保住本金安全放在第一位的操作原则，在投资之前先评估为主，研究公司基本面，通过研究上市公司内在价值做出分析，寻找被市场低估的股票，管理人投资团队坚持以中长线投资为主，在市场估值的底部介入，不频繁换股，追涨杀跌市场短线热点，通过对国家政策的解读及宏观研究及国家产业投入方向确定中长期投资机会，并对上市公司进行实地调研考察，精选个股，通过科学，量化，分散组合投资资产，消除非系统性风险及市场风险，认真细致的在同行业公司之中筛选出质地优量的投资标的，同时根据国内外环境及市场估值选择投资标地，并依托技术上分析与数据分析，判断宏观经济形势、货币政策及财政政策，灵活调整产品在股票和债券、基金之间的配置比例，实现产品的长期增值。 |
| 业绩比较基准（如有） | 无 |
| 风险收益特征 | 高收益、高风险 |

2、基金净值表现

| 阶段 | 净值增长率 | 净值增长率标准差（选填） | 业绩比较基准收益率（选填） | 业绩比较基准收益率标准差（选填） |
|------------|-------|--------------|---------------|------------------|
| 当季 | -2.06 | 0.89 | | |
| 自基金合同生效起至今 | -2.06 | 0.89 | | |



3、主要财务指标

单位：元

| 项目 | 2016-10-25 至 2016-12-31 |
|----------|-------------------------|
| 本期已实现收益 | -180,671.44 |
| 本期利润 | -227,156.44 |
| 期末基金资产净值 | 10,773,864.39 |
| 期末基金份额净值 | 0.9794 |

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 | 2,803,368.00 | 25.93 |
| | 其中：普通股 | 2,803,368.00 | 25.93 |
| | 存托凭证 | 0.00 | 0.00 |
| 2 | 基金投资 | 7,985,150.92 | 73.85 |
| | 其中：货币基金 | 7,985,150.92 | 73.85 |
| 3 | 固定收益投资 | 0.00 | 0.00 |
| | 其中：债券 | 0.00 | 0.00 |
| | 资产支持证券 | 0.00 | 0.00 |
| 4 | 金融衍生品投资 | 0.00 | 0.00 |
| | 其中：远期 | 0.00 | 0.00 |
| | 期货 | 0.00 | 0.00 |
| | 期权 | 0.00 | 0.00 |
| | 权证 | 0.00 | 0.00 |
| 5 | 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 |
| 6 | 货币市场工具 | 0.00 | 0.00 |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 24,639.61 | 0.23 |
| 8 | 其他各项资产 | 6.35 | 0.00 |
| | 合计 | 10,813,164.88 | 100.00 |

4.2 报告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 | 1,154,688.00 | 10.72 |
| B | 采矿业 | 0.00 | 0.00 |
| C | 制造业 | 395,040.00 | 3.67 |
| 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 |