

东源嘉盈回馈私募证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	东源嘉盈回馈私募证券投资基金
基金编号	SN3432
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）	广发证券股份有限公司
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2016 年 12 月 1 日
报告期末基金份额总额	51,000,000.00
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	采用多层次的投资策略，包括：资产类别配置策略、行业配置策略、个股配置策略等
业绩比较基准（如有）	无
风险收益特征	高风险、高收益

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	0.80			
自基金合同生效起至今	0.80			

3、主要财务指标

单位：元

项目	2016-12-01 至 2016-12-31
本期已实现收益	-36,153.91
本期利润	406,008.36
期末基金资产净值	51,406,008.36
期末基金份额净值	1.008

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	20,826,888.59	36.52
	其中：普通股	20,826,888.59	36.52
	存托凭证	0.00	0.00



序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的 比例 (%)
2	基金投资	5,450,290.41	9.56
	其中：货币基金	5,450,290.41	9.56
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	25,000,375.00	43.84
	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	5,737,470.06	10.06
8	理财产品	0.00	0.00
9	其他资产组合	15,063.48	0.03
	合计	57,030,087.54	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	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	1,729,700.00	3.36
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	240,450.00	0.47
G	交通运输、仓储和邮政业	495,600.00	0.96
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	496,020.00	0.96
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	243,250.00	0.47
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	3,205,020.00	6.23