

东源嘉盈三号私募证券投资基金 2016 年年度报告

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	东源嘉盈三号私募证券投资基金
基金编号	SM8216
基金运作方式	受托管理
基金成立日期	2016 年 10 月 25 日
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	不适用
报告期末基金份额总额	11,001,020.83
基金到期日期	2036 年 10 月 25 日

1.2 基金产品说明

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良的投资标的，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）	本基金无业绩比较基准。
风险收益特征	高风险、高收益

1.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	深圳市东源嘉盈资产管理有限公司	
信息披露 负责人	姓名	张银广
	联系电话	18676655968
	电子邮箱	zhangyg@dongyuanjy.com
传真	0755-82785552	
注册地址	广东省深圳市福田区香梅路中投国际商务中心A栋13楼C	
办公地址	广东省深圳市福田区香梅路中投国际商务中心A栋13楼C	
邮政编码	518000	
法定代表人	杨凡	

1.4 信息披露方式

邮寄服务；传真、电子邮件或短信；基金管理人网站；中国基金业协会指定的私募基金信息披露备份平台等

1.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所		
注册登记机构	申万宏源证券有限公司	上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层
外包机构	申万宏源证券有限公司	上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

2.1 主要会计数据和财务指标

期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-180,671.44		
本期利润	-227,156.44		
期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	0.00		
期末可供分配基金份额利润	0.0000		
期末基金资产净值	10,773,864.39		
期末基金份额净值	0.9794		
累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	-2.06%		