

东源嘉盈回报私募证券投资基金 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 | 东源嘉盈回报私募证券投资基金 |
| 基金编号 | SM3784 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金成立日期 | 2016 年 09 月 20 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 | 广发证券股份有限公司 |
| 投资顾问（如有） | 无 |
| 报告期末基金份额总额 | 5,570,000.00 |
| 基金到期日期 | 2021 年 9 月 20 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 | 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 | 高收益、高风险 |

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 | 广发证券股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 李鹏 |
| | 联系电话 | 0755-82787773 |
| | 电子邮箱 | lip@dongyuanjy.com |
| 传真 | 0755-82785552 | 020-87555129 |
| 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 | 广州市天河北路 183 号 |
| 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 | 广州市天河北路 183 号 |
| 邮政编码 | 518034 | 510075 |
| 法定代表人 | 杨凡 | 孙树明 |

1.4 信息披露方式

基金管理人有权采用下列一种或多种方式向基金份额持有人提供报告或进行相关通知，传真、电子邮件或短信；邮寄服务；基金管理人网站；其他中国证监会以及基金业协会规定的信息披露途径或方式

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 | 国金道富投资服务有限公司 | 上海市浦东新区芳甸路 1088 号 18F |
| 外包机构 | 国金道富投资服务有限公司 | 上海市浦东新区芳甸路 1088 号 18F |
| | | |

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 | 16,209.03 | - | - |
| 本期利润 | 31,818.90 | - | - |
| 期末数据和指标 | 2016 年末 | 2015 年末 | 2014 年末 |
| 期末可供分配利润 | 16,209.03 | - | - |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0029 | - | - |
| 期末基金资产净值总额 | 5,601,818.90 | - | - |
| 期末基金份额净值 | 1.0057 | - | - |
| 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 | 0.57% | - | - |

2.2 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 |
|----------------|-------|----------|---------------|------------------|
| 当年 | 0.57 | - | - | - |
| 自基金合同 生效起至今 | 0.57 | - | - | - |

注：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当年净值增长率=（本年度末累计净值-上年度末累计净值）/上年度末累计净值

2.3 过去三年基金的利润分配情况

| 年度 | 每份基金份额分 红数 | 现金形式发 放总额 | 再投资形式发 放总额 | 年度利润分 配合计 | 备注 |
|--------|---------------|--------------|---------------|--------------|----|
| 2016 年 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| 2015 年 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| 2014 年 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |