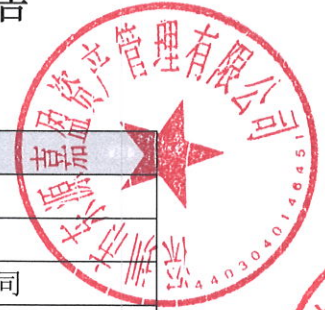


# 东源嘉盈回报私募证券投资基金 2017 年第 4 季度报告



## 1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	东源嘉盈回报私募证券投资基金
基金编码	SM3784
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
投资顾问（如有）	
基金运作方式	契约型开放式
基金成立日期	2016-09-20
报告期末基金份额总额	4,070,000.00
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）	
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 (%)	业绩比较基准收益率 (%)	业绩比较基准收益率标准差 (%)
当季	-0.74	-	-	-
自基金合同生效起至今	8.95	-	-	-

说明：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当季净值增长率=（本季度末累计净值-上季度末累计净值）/上季度末累计净值

### A 级基金净值表现

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	-0.74	-	-	-
自基金合同生效起至今	8.95	-	-	-

### B 级基金净值表现

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	-0.74	-	-	-
自基金合同生效起至今	8.95	-	-	-

### 3、主要财务指标

单位：人民币元

项目	2017-10-01 至 2017-12-31 (元)
本期已实现收益	-12,658.00
本期利润	-74,596.80
期末基金资产净值	4,434,441.30
期末基金份额净值	1.0895

#### A 级基金主要财务指标

单位：人民币元

项目	2017-10-01 至 2017-12-31 (元)
本期已实现收益	0.00
本期利润	
期末基金资产净值	4,140,264.60
期末基金份额净值	1.0895

#### B 级基金主要财务指标

单位：人民币元

项目	2017-10-01 至 2017-12-31 (元)
本期已实现收益	0.00
本期利润	0.00
期末基金资产净值	294,176.70
期末基金份额净值	1.0895

### 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	4,442,377.26	99.82
	其中：普通股	4,442,377.26	99.82
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	0.00	0.00
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