

东源嘉盈6号私募证券投资基金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6号私募证券投资基金
基金编号	SW9233
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)	招商证券股份有限公司
投资顾问(如有)	-
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2017年10月12日
报告期末基金份额总额	10,000,000.00
投资目标	在控制风险的前提下,实现客户资产长期、持续、稳定的增值
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
业绩比较基准(如有)	-
风险收益特征	R5级(高风险)投资品种
报告是否经托管机构复核	是

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	0.62			
自基金合同 生效起至今	0.62			

3、主要财务指标

单位:元

项目	2017-10-01至2017-12-31
本期已实现收益	52,743.58
本期利润	62,136.00
期末基金资产净值	10,062,136.00
期末基金份额净值	1.0062

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	2,877,000.00	28.58
	其中:普通股	2,877,000.00	28.58
	存托凭证	0.00	0.00

2	基金投资	7,045,941.02	69.99
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	10,303.37	0.10
8	其他各项资产	134,378.03	1.33
	合计	10,067,622.42	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	2,877,000.00	28.59
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	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00
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	0.00	0.00
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	0.00	0.00
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	2,877,000.00	28.59