

东源嘉盈回报私募证券投资基金 2018 年第 2 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 |
| 基金编号 | 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 (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 | -2.93 | | | |
| 自基金合同生效起至今 | -6.67 | | | |

3、主要财务指标

单位：元

| 项目 | 2018-04-01 至 2018-06-30 |
|----------|-------------------------|
| 本期已实现收益 | -111,573.37 |
| 本期利润 | -114,540.47 |
| 期末基金资产净值 | 3,798,732.61 |
| 期末基金份额净值 | 0.9333 |

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 | 0.00 | 0.00 |
| | 其中：普通股 | 0.00 | 0.00 |
| | 存托凭证 | 0.00 | 0.00 |

| | | | |
|---|-------------------|--------------|--------|
| 2 | 基金投资 | 2,083,963.97 | 54.84 |
| | 其中：货币基金 | 1,906.40 | 0.05 |
| 3 | 固定收益投资 | 1,906.40 | 0.05 |
| | 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 | 1,700,008.50 | 44.73 |
| 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 | 13,285.68 | 0.35 |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 0.00 | 0.00 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,018.68 | 0.03 |
| | 合计 | 3,800,183.23 | 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 | 0.00 | 0.00 |
| 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 | 0.00 | 0.00 |