

东源嘉盈回馈私募证券投资基金 2018 年第 3 季度报告



1、基金基本情况

| 项目         | 信息   |
|------------|--|
| 基金名称       | 东源嘉盈回馈私募证券投资基金                               |
| 基金编号       | SN3432                                       |
| 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                                   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                       |
| 基金成立日期     | 2016 年 12 月 01 日                             |
| 报告期末基金份额总额 | 45,300,000.00                                |
| 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) | 无  |
| 风险收益特征     | 高风险、高收益                                      |

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         | -3.53     |               |                |                   |
| 自基金合同生效起至今 | 0.97      |               |                |                   |

3、主要财务指标

单位:元

| 项目       | 2018-07-01 至 2018-09-30 |
|----------|-------------------------|
| 本期已实现收益  | -2,808,997.99           |
| 本期利润     | -1,672,193.70           |
| 期末基金资产净值 | 45,741,498.72           |
| 期末基金份额净值 | 1.0097                  |

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   | 16,890,362.58 | 36.91         |
|    | 其中:普通股 | 16,890,362.58 | 36.91         |
|    | 存托凭证   | 0.00          | 0.00          |
| 2  | 基金投资   | 28,771,742.18 | 62.88         |

| 序号 | 项目                | 金额<br>(元)     | 占基金总资产的<br>比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|-------------------|
| 3  | 固定收益投资            | 1,963.80      | 0.00              |
|    | 其中：债券             | 1,963.80      | 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      | 86,101.77     | 0.19              |
| 8  | 理财产品              | 0.00          | 0.00              |
| 9  | 其他资产组合            | 8,958.28      | 0.02              |
|    | 合计                | 45,759,128.61 | 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              | 1,002,549.00 | 2.19          |
| 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           | 164,456.00   | 0.36          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,162,076.00 | 2.55          |
| 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              | 342,500.00   | 0.75          |
| K  | 房地产业             | 1,013,040.00 | 2.21          |
| 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               | 3,684,621.00 | 8.06          |

#### 4.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合