

## 东源嘉盈回馈私募证券投资基金 2018 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	-4.92			
自基金合同 生效起至今	-4.00			

### 3、主要财务指标

单位:元

项目	2018-10-01 至 2018-12-31
本期已实现收益	87,401.51
本期利润	-2,253,717.83
期末基金资产净值	43,487,780.89
期末基金份额净值	0.9600

### 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	19,047,816.24	43.78
	其中:普通股	19,047,816.24	43.78
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	23,961,443.00	55.09

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的 比例 (%)
3	固定收益投资	1,938.20	0.00
	其中：债券	1,938.20	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	493,430.59	1.13
8	理财产品	0.00	0.00
9	其他资产组合	4.42	0.00
	合计	43,504,632.45	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	269,811.30	0.62
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	120,170.00	0.28
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	280,500.00	0.65
K	房地产业	1,021,080.00	2.34
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	1,691,561.30	3.89

#### 4.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合