

东源嘉盈混合型 1 号私募证券投资基金 2018 年年度报告



1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	东源嘉盈混合型 1 号私募证券投资基金
基金编号	SS8643
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2017 年 05 月 02 日
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	招商证券股份有限公司
投资顾问（如有）	-
报告期末基金份额总额	10,000,000.00
基金到期日期	2037 年 05 月 01 日

1.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，努力实现基金资产的稳健增值
投资策略	采用 CPPI、TIPP 和 OBPI 等策略，通过债券正回购、转债、股票、基金等多品种投资，以及期货和期权等多空对冲等手段的灵活使用，在控制投资风险的情况下，追求相对稳定收益
业绩比较基准	无
风险收益特征	本基金属于中高风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力为成长型、进取型的合格投资者

1.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	深圳市东源嘉盈资产管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张银广
	联系电话	0755-82785559
	电子邮箱	zhangyg@dongyuanjy.com
传真	0755-82785552	0755-82960794
注册地址	广东省深圳市福田区香梅路中投国际商务中心 A 栋 13 楼 C	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
办公地址	广东省深圳市福田区香梅路中投国际商务中心 A 栋 13 楼 C	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码	518034	518000



法定代表人	杨凡	霍达
-------	----	----

1.4 信息披露方式

基金管理人有权采用下列一种或多种方式向基金份额持有人提供报告或进行相关通知，传真、电子邮件或短信；邮寄服务；基金管理人网站；其他中国证监会以及基金业协会规定的信息披露途径或方式

1.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	-	-
注册登记机构	招商证券股份有限公司	深圳市福田区福田街道福华一路111号
外包机构	招商证券股份有限公司	深圳市福田区福田街道福华一路111号
--	-	-

2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

2.1 主要会计数据和财务指标

期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	186,957.90	342,250.69	-
本期利润	-338,114.41	234,427.02	-
期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配利润	-205,687.39	132,427.02	-
期末可供分配基金份额利润	-0.0206	0.0132	-
期末基金资产净值总额	9,794,312.61	10,132,427.02	-
期末基金份额净值	0.9794	1.0132	-
累计期末指标	2018年末	2017年末	2016年末
基金份额累计净值增长率	-2.06%	1.32%	-

2.2 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(%)
当年	-3.34	-	-	-
自基金合同生效起至今	-2.06	-	-	-

注：净值增长率等于（期末净值-期初净值）/期初净值

当年净值增长率等于（本年度末净值-上年度末净值）/上年度末净值