

# 东源嘉盈回报私募证券投资基金 2019 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                              |
| 基金编码       | 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 (%) | 业绩比较基准收益率 (%) | 业绩比较基准收益率标准差 (%) |
|------------|-----------|--------------|---------------|------------------|
| 当季         | -3.62     | -            | -             | -                |
| 自基金合同生效起至今 | -7.44     | -            | -             | -                |

说明: 净值增长率 = (期末累计净值 - 期初累计净值) / 期初累计净值

当季净值增长率 = (本季度末累计净值 - 上季度末累计净值) / 上季度末累计净值

## 3、主要财务指标

单位: 人民币元

| 项目       | 2019-04-01 至 2019-06-30 (元) |
|----------|-----------------------------|
| 本期已实现收益  | 14,602.37                   |
| 本期利润     | -141,354.31                 |
| 期末基金资产净值 | 3,767,290.44                |
| 期末基金份额净值 | 0.9256                      |

## 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 | 3,270,781.20 | 83.47         |

|   |                   |              |        |
|---|-------------------|--------------|--------|
|   | 其中：普通股            | 3,270,781.20 | 83.47  |
|   | 存托凭证              | 0.00         | 0.00   |
| 2 | 基金投资              | 453,593.35   | 11.57  |
| 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      | 160,848.12   | 4.10   |
| 8 | 理财产品              | 0.00         | 0.00   |
| 9 | 其他资产组合            | 33,737.60    | 0.86   |
|   | 合计                | 3,918,960.27 | 100.00 |

#### 4.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

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              | 3,550.00   | 0.09          |
| C  | 制造业              | 251,152.00 | 6.67          |
| 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           | 43,316.00  | 1.15          |
| 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               | 298,018.00 | 7.91          |