东源嘉盈10号私募证券投资基金2019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10号私募证券投资基金
基金编号	SCV231
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）	中国银河证券股份有限公司
投资顾问（如有）	-
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2018年4月25日
报告期末基金份额总额（份）	5,001,001.00
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	本基金不承诺保本及最低收益，属预期风险【中高】、预期收益【中高】的投资品种，适合具有相应风险识别、评估、承受能力的合格投资者

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	-1.39	-	-	-
自基金合同生效起至今	-7.50	-	-	-

√无分级 □二级基金 □三级基金

3、 主要财务指标

金额单位：元

项目	2019年7月1日 至 2019年9月30日（元）
本期已实现收益	7,567.89
本期利润	-63,507.11
期末基金资产净值	4,626,242.45
期末基金份额净值	0.9250

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（人民币）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	4,563,262.00	98.16
	其中：普通股	4,563,262.00	98.16
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	0.00	0.00
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	80,064.88	1.72
8	其他各项资产	5,399.12	0.12
-	-	-	-
	合计	4,648,726.00	100.00

4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

4.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	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	75,978.00	1.64
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	425,724.00	9.20
K	房地产业	87,875.00	1.90
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	589,577.00	12.74

4.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-
-	-	-
合计	3,973,685.00	85.89

5、 基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	5,001,001.00
报告期期间基金总申购份额	0.00
减：报告期期间基金总赎回份额	0.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
报告期期末基金份额总额	5,001,001.00

6、 管理人报告

1、基金管理人及其基金经理概况：

基金管理人概况：深圳市东源嘉盈资产管理有限公司成立于2011年6月，注册资本3200万，实收资本3200万。东源嘉盈的管理团队均有逾20年丰富的行业从业经验，并且同中有异，优势互补。东源嘉盈自成立之初，就确立了“为客户带来长期稳定的绝对回报，致力于成为国内一流资产管理公司”的目标。经过多年的发展，公司与多家业内一流合作伙伴建立了良好的合作关系，管理产品数量和资产规模不断扩大，累计发行基金产品共26期，均已在中国基金业协会备案。

基金经理概况：杨凡先生，深圳市东源嘉盈资产管理有限公司董事长兼总经理、投资委员会主席、首席投资官，华中科技大学博士，27年证券投资经历，曾任银泰证券公司研究部总经理、资产管理部总经理、公司总裁助理。

2、管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

3、报告期内基金投资策略和业绩表现

2019年第三季度，国内经济总体运行平稳，增长动力正在加快转换，尽管下行压力仍在，但已呈现出趋稳的态势。9月制造业PMI数据有所回升，金融数据也明显好转，中国经济的韧性依然较强。国际方面，经历了10月中旬的谈判，中美之间已达成初步协议，但在最终协议签订之前中美贸易关系仍存在较大的不确定性。

证券市场方面，随着投资者对中美贸易关系的反应逐渐钝化，国内宏观经济走势及政策预期成为了影响A股的重要因素。整个第三季度，市场维持低位震荡的态势，上证综指微跌2.47%，但市场内部的结构分化日益显著。港股方面，不稳定的局势是导致市场表现不佳的最主要原因，恒生指数单季度下跌8.58%，年初至今，港股市场成为了全球主要股

市中表现较为落后的市场。

本基金的投资方向为投资业绩稳定向好、契合国内经济发展大方向的 A 股及港股通标的。具体操作上，本基金根据市场变化决定投资标的的配置方向及比例。

报告期内，本基金份额净值增长率为-1.39%。

4、管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望第四季度，国内经济韧性仍强，我们的宏观政策还有很大的调整余地，政策工具手段充足。如果能做到货币政策、财政政策、产业政策和监管政策多措并举，更好发挥协同作用，中国经济一定可以实现平稳健康可持续发展。

内外部不确定性是导致A股呈现低位震荡且高度分化的最主要原因。第四季度，这种局面完全扭转的可能性不大，但随着中美贸易关系出现缓和及国内逆周期政策的实施，市场有望逐步反弹，前期表现不佳的低估值板块有望跑赢市场。港股方面，随着局势的稳定，作为全球市场的估值洼地，港股的吸引力会重新增大，部分业绩稳定向好且估值较低的标的走势也将随之回暖。

5、管理人内部有关基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人从合法经营、规范运作、勤勉尽责、保障基金持有人利益出发，严守合规底线、完善内部控制，主要从如下几个方面落实风险控制、强化监察稽核职能：

（1）梳理完善公司内控制度及业务流程：报告期内组织各部门对公司制度体系进行全面梳理、整合，规范公司业务运作和经营管理，全面建立内部控制标准与要求。

（2）加强业务合规审核控制：通过对各类新产品的实现方案、相关协议、法律文件、流程、投资限制等进行审核评估并提供合规咨询等业务支持，确保业务创新的合规实施。

（3）全面实施投资监督和风险监测：通过事前、事中、事后三个阶段进行投资风险监控，事前编制投资股票池，设置内控标准；事中结合系统与人工控制方式，每日监控投资交易过程并及时提示投资异常情况；事后定期对产品的合规运作、投资业绩等进行评估、分析，确保公司各产品合规运作、风险可控。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续本着诚实信用、勤勉尽责的原则，坚持风险控制为核心，确保管理基金的合规、安全运作。

6、管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金日常估值由基金管理人进行，根据相关法律法规，基金管理人可以委托第三方外包机构办理基金的估值。基金管理人或其委托的第三方完成估值后，将估值结果以书面形式、发送电子对账数据等双方认可的其他形式送至基金托管人，基金托管人按法律法规、本合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人发送的书面估值结果上加盖业务章或者发送电子对账结果等双方认可的其他形式返回给基金管理人或其委托的第三方；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

在法律法规和中国证监会允许的情况下，基金管理人与基金托管人可以各自委托第三方机构进行基金资产估值，但不改变基金管理人与基金托管人对基金资产估值各自承担的责任。

本基金第三方外包机构和托管方为中国银河证券股份有限公司。

7、基金运作情况和运用杠杆情况

本基金运行平稳，重点投资于业绩稳定向好、契合国内经济发展大方向的A股及港股通标的，季度份额净值增长率为-1.39%。本基金将继续采用多层次的投资策略，注重跨市场配置，在控制回撤的基础上，争取做到客户利益的最大化。

报告期内本基金无运用杠杆的情况。

8、投资收益分配和损失承担情况

本基金报告期内未进行投资收益分配，但符合基金合同规定。本基金报告期内无损失承担情况。

9、会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项

无

10、基金持有人数或基金资产净值预警情形、可能存在的利益冲突等

报告期内，本基金不存在基金持有人数或资产净值预警情形，也不存在可能的利益冲突等情况。

11、备查文件目录

1. 中国证券投资基金业协会私募投资基金备案证明

2.《东源嘉盈 10 号私募证券投资基金基金合同》

3.《私募投资基金基金服务及募集监督协议》

4. 基金管理人业务资格批件和营业执照

5. 基金托管人业务资格批件和营业执照

存放地点：

基金管理人处、基金托管人处

查阅方式：

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：http：//www.dongyuanjy.com

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人深圳市东源嘉盈资产管理有限公司。

客户服务电话：0755-82785505

信息披露报告是否经托管机构复核：是