

东源嘉盈回馈私募证券投资基金 2019 年第 3 季度报告

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	东源嘉盈回馈私募证券投资基金
基金编码	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
投资顾问（如有）	
基金运作方式	契约型开放式
基金成立日期	2016-12-01
报告期末基金份额总额	30,300,000.00
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（%）	业绩比较基准收益率（%）	业绩比较基准收益率标准差（%）
当季	1.06	-	-	-
自基金合同生效起至今	-6.26	-	-	-

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	2019-10-01 至 2019-12-31 (元)
本期已实现收益	-144,029.77
本期利润	296,305.61
期末基金资产净值	28,403,218.65
期末基金份额净值	0.9374

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	7,032,042.65	23.50

	其中：普通股	7,032,042.65	23.50
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	21,350,531.85	71.36
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	1,538,970.22	5.14
8	理财产品	0.00	0.00
9	其他资产组合	0.00	0.00
	合计	29,921,544.72	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	0.00	0.00
C	制造业	372,170.60	1.31
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	155,694.00	0.55
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	179,466.00	0.63
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	707,330.60	2.49

4.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合