东源嘉盈10号私募证券投资基金2019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10号私募证券投资基金
基金编号	SCV231
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2018年4月25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（如有）	中国银河证券股份有限公司
投资顾问（如有）	-
报告期末基金份额总额（份）	5,001,001.00
基金到期日期	9998年12月31日

1.2 基金产品说明

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

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	中国银河证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王亚楠	刘平
	联系电话	0755-82787773	010-66568280
	电子邮箱	wangyn@dongyuanjy.com	yhzq_tggz@chinastock.com.cn
传真		0755-82785552	010-66568532
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	中国北京西城区金融大街35号2-6层
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	中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座
邮政编码		518034	100033
法定代表人		杨凡	陈共炎

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（如有）

项目	名称	办公地址
会计师事务所	-	-
注册登记机构	-	-
外包机构	中国银河证券股份有限公司	-
-	-	-
-	-	-

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

金额单位：元

期间数据和指标	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	106,046.67	-41,976.23	0
本期利润	1,496,684.52	-1,071,766.63	0
期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	61,803.48	-1,072,767.63	-
期末可供分配基金份额利润	0.0124	-0.18	0
期末基金资产净值	5,425,917.89	4,928,233.37	0
期末基金份额净值	1.0850	0.821	0
累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率（%）	8.50	-17.9	0

√无分级□二级 □三级

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	32.16	-	-	-
自基金合同生效起至今	8.50	-	-	-

2.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：元

年度	每份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2019	0.00	0.00	0.00	0.00	-

2018	0.00	0.00	0.00	0.00	-
2017	0.00	0.00	0.00	0.00	-

3、 基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	6,001,001
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	1,000,000.00
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

4、 管理人说明的其他情况

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28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，28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

2019年国内经济走势总体平稳，全年GDP增速6.1%，固定资产投资同比增长5.1%，经济增长新旧动能转换正在进行，但距离创新驱动发展仍有很长的距离。猪肉价格推升的通胀成为全年一直存在的问题，在生猪供应恢复正常之前，可能仍然会是货币政策的掣肘。中美贸易谈判尽管取得了一定的进展，但两个主要经济体在竞争和合作的过程中，摩擦可能会一直持续，其对国内产业链的影响必定是广泛且深远的。

A股方面，2018年的极度悲观情绪发生逆转，市场的走势明显的分为两个阶段。上半年价值股明显占据上风，而到了下半年，半导体和消费电子等科技股带领创业板指走势遥遥领先于主板。全年，上证综指涨22.30%，中小板指涨41.03%，创业板指涨43.79%。港股方面，也分为两个阶段，一季度市场情绪好转带动指数向上而后震荡调整，但从下半年开始，局势的动荡成为了左右市场走势的关键因素。全年来看，恒生指数涨9.07%，跑输除韩国和新加坡以外的全球主要市场。

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32.16%。

4、 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020年，突如其来的新冠疫情按下了中国经济的暂停键，而后其在全球的扩散则让世界的节奏都发生了变化。本次疫情对世界经济的影响可能是深远的，而并不仅仅是下降的统计数字所能描绘。回到国内，生产和生活秩序正在逐步恢复常态，但需求端特别是外需何时能恢复正常可能是我们最需要重点关注的方向。我国的货币政策和财政政策仍有

实施空间，何时推出更强的刺激可能仍需等待决策层后续对疫情影响经济程度的判断。

证券市场，被强烈预期的强刺激政策迟迟未能推出，A 股市场的关注点应该会放在面向内需的基本面稳定的行业和面向进口替代或未来代表未来发展方向的科技行业，前者带有一定的避险属性，而后者可能更多的是用时间换空间，在相对低点布局中国的未来 5 年。港股方面，外围市场可能是疫情这段时间影响其走势的最重要因素。当欧美投资者的恐慌情绪逐渐缓解，就会重新对世界经济的走势进行分析，决定其配置方向，而港股以其较低的估值水平，仍然是世界投资中国，分享中国经济增长的重要途径。所以我们较为看好港股通标的在 2020 年的走势。

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及托管人均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 32.16%。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.《东源嘉盈 10 号私募证券投资基金基金服务及募集监督操作备忘录》、《私募投资基金基金服务及募集监督协议》、《东源嘉盈 10 号私募证券投资基金之运营操作备忘录》

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有限公司。

客户服务电话：0755-82788022

5、 托管人报告（如有）

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银河证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人按照《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法复核基金管理人深圳市东源嘉盈资产管理有限公司编制和披露的东源嘉盈 10 号私募证券投资基金 2019 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告、投资组合报告等内容，以上内容真实、准确和完整。

6、 年度财务报表

金额单位：元

6.1 资产负债表

资产	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		

银行存款	41,903.02	38,447.11
结算备付金	0.00	0
存出保证金	0.00	0
交易性金融资产	5,516,445.00	4,914,711
其中：股票投资	5,516,445.00	4,914,711
基金投资	0.00	0
债券投资	0.00	0
资产支持证券投资	0.00	0
贵金属投资	0.00	0
衍生金融资产	0.00	0
买入返售金融资产	0.00	0
应收证券清算款	0.00	0
应收利息	5.06	4.29
应收股利	0.00	0
应收申购款	0.00	0
递延所得税资产	0.00	0
其他资产	0.00	0
资产总计	5,558,353.08	4,953,162.4
负债和所有者权益	**本期末 2019 年 12 月 31 日**	**上年度末 2018 年 12 月 31 日**
负债：		
短期借款	0.00	0
交易性金融负债	0.00	0
衍生金融负债	0.00	0
卖出回购金融资产款	0.00	0
应付证券清算款	0.00	0
应付赎回款	0.00	0
应付管理人报酬	124,707.19	19,777.03
应付托管费	2,576.00	2,576
应付销售服务费	0.00	0
应付交易费用	0.00	0
应交税费	0.00	0
应付利息	0.00	0
应付利润	0.00	0
递延所得税负债	0.00	0
其他负债	5,152.00	2,576
负债合计	132,435.19	24,929.03
所有者权益：		
实收基金	5,001,001.00	6,001,001
未分配利润	424,916.89	-1,072,767.63
所有者权益合计	5,425,917.89	4,928,233.37
负债和所有者权益总计	5,558,353.08	4,953,162.4

6.2 利润表

项目	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日
一、收入	1,705,467.39	-992,837.62
1.利息收入	248.40	4,480.55
其中：存款利息收入	248.03	4,480.55
债券利息收入	0.37	0
资产支持证券利息收入	0.00	0
买入返售金融资产收入	0.00	0
其他利息收入	0.00	0
2.投资收益（损失以“-”填列）	314,581.14	32,472.23
其中：股票投资收益	237,553.59	-8,952.28
基金投资收益	0.00	231.32
债券投资收益	144.98	0
资产支持证券投资收益	0.00	0
贵金属投资收益	0.00	0
衍生工具收益	0.00	0
股利收益	76,882.57	41,193.19
3.公允价值变动收益（损失以“-”填列）	1,390,637.85	-1,029,790.4
4.汇兑收益（损失以“-”填列）	0.00	0
5.其他收入（损失以“-”填列）	0.00	0
减：二、费用	208,782.87	78,929.01
1．管理人报酬	181,891.27	54,965.03
其中：固定管理费	75,870.05	54,965.03
业绩报酬	106,021.22	0
2．托管费	10,220.00	7,000
3．销售服务费	0.00	0
4．外包服务费	10,220.00	7,000
5．交易费用	5,595.87	9,563.98
6．利息支出	0.00	0
其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0
7．其他费用	855.73	400
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,496,684.52	-1,071,766.63
减：所得税费用	0.00	0
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,496,684.52	-1,071,766.63

6.3 所有者权益变动表

项目	本期

	2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	6,001,001.00	-1,072,767.63	4,928,233.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	1,496,684.52	1,496,684.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,000,000.00	1,000.00	-999,000.00
其中：1.基金申购款	0.00	0.00	0.00
2.基金赎回款	-1,000,000.00	1,000.00	-999,000.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	5,001,001.00	424,916.89	5,425,917.89
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	0	0	0
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0	-1,071,766.63	-1,071,766.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	6,001,001	-1,001	6,000,000
其中：1.基金申购款	6,001,001	-1,001	6,000,000
2.基金赎回款	0	0	0
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	0	0	0
五、期末所有者权益（基金净值）	6,001,001	-1,072,767.63	4,928,233.37

7、 期末投资组合情况

7.1 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	5,516,445.00	99.25
	其中：普通股	5,516,445.00	99.25

	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	41,903.02	0.75
8	其他各项资产	5.06	0.00
-	-	-	-
	合计	5,558,353.08	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	77,112.00	1.42
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	429,426.00	7.91
K	房地产业	97,375.00	1.79
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	603,913.00	11.12

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合（如有）

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-
-	-	-
合计	4,912,532.00	90.54

8、 信息披露报告

信息披露报告是否经托管机构复核：是