

# 东源嘉盈回馈私募证券投资基金 2020 年第 1 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	18,300,000.00
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	-2.77	-	-	-
自基金合同 生效起至今	-8.86	-	-	-

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	2020-01-01 至 2020-03-31 (元)
本期已实现收益	-616,446.31
本期利润	-2,294,432.44
期末基金资产净值	16,679,086.21
期末基金份额净值	0.9114

## 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	16,627,631.84	99.50
	其中：普通股	16,627,631.84	99.50
	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	84,341.13	0.50
8	理财产品	0.00	0.00
9	其他资产组合	0.00	0.00
	合计	16,711,972.97	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	162,697.40	0.98
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	139,062.00	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	255,680.00	1.53
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	228,261.00	1.37
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	785,700.40	4.71