

东源嘉盈回报私募证券投资基金 2020 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	3,800,000.00
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	6.52	-	-	-
自基金合同生效起至今	-1.27	-	-	-

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	2020-04-01 至 2020-06-30 (元)
本期已实现收益	73,467.75
本期利润	229,694.13
期末基金资产净值	3,751,760.27
期末基金份额净值	0.9873

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	3,650,738.20	97.02
	其中：普通股	3,650,738.20	97.02
	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	34,625.49	0.92
8	理财产品	0.00	0.00
9	其他资产组合	77,657.61	2.06
	合计	3,763,021.30	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	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	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	31,680.00	0.84
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	35,148.00	0.94
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	66,828.00	1.78