

东源嘉盈成长2号私募证券投资基金

2020年3季度报告

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：国泰君安证券股份有限公司



1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	东源嘉盈成长2号私募证券投资基金
基金编码	SLF757
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)	国泰君安证券股份有限公司
投资顾问(如有)	
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2020-06-30
报告期末基金份额总额(份)	14,975,000.00
投资目标	本基金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	本基金通过量化方法寻找强指数,根据指数购买ETFs、ETFs期权、股指期权、强股票组合,在控制风险的前提下力争取得较高的收益。以上内容为私募基金管理人对于本基金全部或部分投资品种相应投资策略的阐述,不构成对于本基金投资范围、投资比例及限制或其他投资风控指标的补充。
业绩比较基准(如有)	无
风险收益特征	本基金属于[R4]级投资品种

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	0.50	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.50	-	-	-

注: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)/上季度末净值

如为分级基金,应按级别分别列示。

表中指标均以不带百分号数值形式填写,请保留至小数点后2位。

3、主要财务指标

金额单位:元

项目	2020-07-01	至	2020-09-30	(元)
本期已实现收益				95,469.84
本期利润				90,413.84
期末基金资产净值				15,054,113.84
期末基金份额净值				1.005

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

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	占基金总资产
		人民币	的比例(%)
1	权益投资	17,920.00	0.12
	其中：普通股	17,920.00	0.12
	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	15,000,750.00	99.62
	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	38,274.10	0.25
8	其他	586.82	0.00
	合计	15,057,530.92	100.00

注：

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

本报“其他”项中列示的主要包括期货交易保证金、各类应收款等，具体情况见《其他资产构成报表》。

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	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	17,920.00	0.12
J	金融业	0.00	0.00
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	17,920.00	0.12

注：

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

4.2.2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：元

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	0.00	0.00
消费者非必需品	0.00	0.00
消费者常用品	0.00	0.00
能源	0.00	0.00
金融	0.00	0.00
医疗保健	0.00	0.00
工业	0.00	0.00
信息技术	0.00	0.00
电信服务	0.00	0.00
公用事业	0.00	0.00
房地产	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：

以上分类采用全球行业标准（GICS）。

5、基金份额变动情况

单位：份	
报告期期初基金份额总额	18,000,000.00
报告期间基金总申购份额	0.00
减：报告期间基金总赎回份额	3,025,000.00
报告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	14,975,000.00

注：

如为分级基金，应按级别分别列示。

如基金成立日晚于报告期期初，则以基金成立日的基金份额总额作为报告期期初基金份额总额。

6、管理人报告

6.1 报告期内基金运作遵规守信情况

报告期内，本基金投资运作符合基金合同的约定。

6.2 报告期内基金估值程序

截止到报告期末，本管理人委托国泰君安证券股份有限公司为本基金提供估值核算服务。对于与基金资产有关的估值与会计核算问题，经相关当事人在平等基础上充分讨论后，达成一致意见。

- 1、本基金成立前，本管理人协调本基金其他当事人商定本基金的估值与会计核算方法。
- 2、在本基金的存续期内，本基金管理人定期评估基金估值与会计核算方法的合理性。
- 3、在本基金的运作过程中，经济环境发生重大变化且对基金资产的估值产生重大影响的，由本管理人协调本基金其他当事人采取必要措施，调整估值方法。

6.3 报告期内基金投资策略和业绩表现

聚焦新三板精选层标的，投资于流动性相对好、估值相对合理的细分行业领先企业。

2020年第3季度国内GDP同比增长4.9%，前三季度同比增长0.7%，中国率先在全球疫情反复情况下实现经济正增长，国内经济已基本恢复至正常状态，但海外疫情仍未受控，全球经济复苏仍然缓慢。

A股市场经历从7月中上旬的情绪高涨到之后的缩量调整过程，第三季度，上证综指涨7.82%，深证成指涨7.63%，中小板指涨8.19%，创业板指涨5.60%。

新三板市场方面，新三板精选层在7月27日正式挂牌开市，首批32家公司股价基本高开低走，之后交易日的股价走势也是缩量下移，大多公司长期处于破发状态、成交低迷，精选层市场表现远远低于市场预期。短期看，精选层的推出改善了融资便利性，但并未对流动性难题有任何实质性改变和影响，期待的新三板优质企业绽放的时代并未来临。由于精选层表现不佳，导致转层类概念股票普遍下挫调整，第三季度，三板做市指数下跌4.01%，三板成指微涨1.46%。

本基金主要专注精选层的新股申购及相关个股的投资，单季净值表现强于三板做市指数但略弱于三板成指。

报告期内，本基金份额净值增长率为0.5%。

6.4 报告期内对宏观经济及其行业走势展望

第四季度，国内经济将继续保持恢复增长的态势，即便国际经济与政治局势面临不确定性，但中国已逐步构建以国内大循环为主体、国内国际双循环相互促进的新发展格局，我国超大规模市场和内需潜力将稳定中国经济的基本盘。

A股市场方面，注册制改革有望加快推进，转板制度也将在创业板、科创板落地，市场将迎来大扩容和鼓励科技创新的时代，上市公司质量将进一步提升，配套制度也将更加完备。在“坚持市场化、法治化方向，建设规范、透明、开放、有活力、有韧性的资本市场”目标下，来市场参与主体责任将更加清晰、监管将趋严、处罚将加重，市场也有望更趋理性。

新三板市场改革将继续推进，改善流动性的措施还将陆续推出。精选层混合交易制度即将落地；存量公募基金投资新三板将更加便利；QFII与RQFII自11月1日起可以投资新三板等等；精选层的流动性将实质性改善。交易所正在加紧制定转板制度，精选层转板有望在2021年实现。转板制度将带动新三板相关股票活跃，精选层中转板类个股将焕发出全新的活力！

本基金将保持在精选层上股票的配置。

6.5 报告期内基金运作情况和运用杠杆情况

截至报告期末，本基金资产总值为15,057,530.92元，净资产为15,054,113.84元，本基金总资产与净资产的比例为100.02%。

本基金本报告期初基金单位净值1.000元，期末基金单位净值1.005元，期初累计单位净值1.000元，期末累计单位净值1.005元，本报告期内累计单位净值增长率为0.50%。

6.6 报告期内投资收益分配和损失承担情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.7 托管人意见

本报告期内，托管人根据《私募投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定和基金合同的约定，对本基金管理人编制的定期报告进行如下复核确认：

报告期内，托管人对管理人所编制的本报告中的财务数据进行了复核，确认所复核内容准确。

报告期内，托管人依据基金合同约定对本基金投资运作情况进行了监督，未发现不符合基金合同约定的情况。

信息披露报告是否经托管机构复核：是

附：其他资产构成报表

金额单位：元

序号	名称	金额
1	交易保证金	0.00
1.1	其中：期货交易保证金	0.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收基金红利	0.00
5	应收利息	586.82
6	应收申购款	0.00
7	其他应收款	0.00
8	待摊费用	0.00
9	其他	0.00
10	合计	586.82

