

东源嘉盈成长2号私募证券投资基金

2021年1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
期末基金总份额(万份)/期末基金实缴总额(万元)	928.734038
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、股指期货、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)	
风险收益特征	适合风险承受能力R4及以上投资者

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	2.98	-	-	-
自基金合同生效起至今	3.70	-	-	-

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)/上季度末累计净值

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	2021-01-01	至	2021-03-31	(元)
本期已实现收益				301,457.64
本期利润				280,208.69
期末基金资产净值				9,629,515.13

期末基金份额净值	1.037
----------	-------

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
		人民币
1	银行存款	49.27
2	股权投资	
3	其中：优先股	
4	其他股权类投资	
5	上市公司定向增发股票投资	0.00
6	新三板挂牌企业投资	6,380,046.00
7	结算备付金	84,992.35
8	存出保证金	
9	股票投资	1,971,900.00
10	债券投资	
11	其中：银行间市场债券	
12	其中：利率债	
13	其中：信用债	
14	资产支持证券	
15	基金投资（公募基金）	
16	其中：货币基金	
17	期货及衍生品交易保证金	
18	买入返售金融资产	1,200,006.00
19	其他证券类标的	
20	商业银行理财产品投资	
21	信托计划投资	
22	基金公司及其子公司资产管理计划投资	
23	保险资产管理计划投资	
24	证券公司及其子公司资产管理计划投资	
25	期货公司及其子公司资产管理计划投资	
26	私募基金产品投资	
27	未在协会备案的合伙企业份额	
28	另类投资	
29	银行委托贷款规模	
30	信托贷款	

31	应收账款投资	
32	各类受（收）益权投资	
33	票据（承兑汇票等）投资	
34	其他债权投资	
35	境外投资	
36	其他资产	应收利息#8.84;
37	债券回购总额	
38	融资、融券总额	
39	其中：融券总额	
40	银行借款总额	
41	其他融资总额	

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、报告期末按行业分类的股票投资组合

4.2.1、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	1,773,744.00	18.42
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	532,800.00	5.53
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	4,606,302.00	47.84
J	金融业	1,439,100.00	14.94
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	8,351,946.00	86.73

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：万份/万元

报告期期初基金份额总额	919.801980
报告期期间基金总申购份额	10.183299
减：报告期期间基金总赎回份额	1.251241
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.000000
期末基金总份额/期末基金实缴总额	928.734038

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。

2021年第一季度，在低基数的作用下，国内主要经济数据均出现大幅反弹，但结构上依然呈现生产强、消费弱的特征。在此影响下，CPI和PPI数据出现了分化，CPI维持低位震荡，而PPI数据则在一月同比转正后持续上升，3月更是达到了4.7%的涨幅，由生产资料价格上涨引发的输入型通胀可能会成为决策层制定经济政策的掣肘。

A股市场方面，呈现前高后低的态势。春节前抱团股冲刺带领各主要指数一路向上，而春节后的大幅调整则使市场量价齐跌。整个第一季度上证综指跌0.90%，深证成指跌4.78%，创业板指跌7.00%，科创50跌10.39%。尽管抱团股有了一定幅度的调整，但近两年的涨幅造成的高估值单纯靠业绩消化仍然较为困难，因此这类股票面临的调整压力依然很大。

新三板市场方面，精选层发行稳步推进，转板制度已于2月底正式披露并实施，部分转板概念股转趋活跃。目前机构投资者在精选层的参与度还较低，随着机构投资者更多参与，精选层板块的活跃度还有望增强。基础层与创新层整体成交相对清淡。第一季度，三板做市指数上涨2.96%，三板成指下跌1.48%。

本基金专注于精选层的新股申购及相关个股的投资，单季净值表现与三板做市指数基本持平。

6.4 报告期内对宏观经济及其行业走势展望

国内经济方面，今年是十四五开年，宏观经济的总体平稳应该是主旋律，各项经济政策也大概率围绕此目标制定。二季度开始低基数的影响逐步消除，经济数据将正常化，而这样也会更有利于我们对国内经济的真实情况作出进一步的判断。国际方面，随着发达国家疫苗接种的逐步开展，世界经济的全面复苏正在路上。但由于国内经济恢复领先全球，生产资料价格的上涨可能会对已经正常化的中国经济带来一定的影响。

A股方面，全面注册制改革有望推进，市场将继续迎来大扩容和鼓励科技创新的时代；常态化退市机制基本形成，市场分化的结构性行情仍将展开，符合中国经济转型方向的新经济类的投资机会可能更大。

新三板市场改革将持续推进，力争把精选层打造为小特精专企业聚集地，着力把创新层和基础层打造为小特精专企业的加速器和孵化器。精选层混合交易和融资融券制度有望加快落地，整个板块流动性将得到改善。2021年下半年精选层转板将真正实现突破。伴随精选层扩容与转板以及一些个股直接拟A股IPO，预计创新层、基础层相对低迷状况将长期维持，精选层中转板类个股与创新层和基础层中具备直接IPO潜力的个股将成市场热点。

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 9,637,002.46 元，净资产为 9,629,515.13 元，本基金总资产与净资产的比例为 100.08%。

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

