

东源嘉盈皓月 1 号私募证券投资基金 2020 年年度报告



1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	东源嘉盈皓月 1 号私募证券投资基金
基金编码	SGF314
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2019 年 04 月 23 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）	招商证券股份有限公司
投资顾问（如有）	-
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	493.112482
基金到期日期	2029 年 04 月 23 日

1.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，努力实现基金资产的稳健增值。
投资策略	采用稳健但又灵活的多元化投资策略。本基金通过持有沪深交易所上市交易的存托凭证间接投资于境外基础证券。
业绩比较基准（如有）	-
风险收益特征	本基金属于 R4 级（中高风险）投资品种

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	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王亚楠
	联系电话	0755-82787773
	电子邮箱	wangyn@dongyuanjy.com
传真	0755-82785552	tgb@cmschina.com.cn
注册地址	深圳市福田区香梅路中投国际商务中心 A 栋 13 层 C 单元	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
办公地址	深圳市福田区香梅路中投国际商务中心 A 栋 13 层 C 单元	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码	518000	518000
法定代表人	杨凡	霍达

1.4 信息披露方式

-

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	招商证券股份有限公司	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
外包机构	招商证券股份有限公司	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
—	-	-

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

期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	531,339.03	399,408.81	-
本期利润	1,003,213.17	557,832.41	-
期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	851,951.22	393,547.92	-
期末可供分配基金份额利润	0.1728	0.0813	-
期末基金净资产	6,479,743.66	5,527,645.28	-
报告期期末单位净值	1.3140	1.1415	-
累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	31.40%	14.15%	-

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	15.11	-	-	-
自基金合同生效起至今	31.40	-	-	-

注：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当年净值增长率=（本年度末累计净值-上年度末累计净值）/上年度末累计净值

2.3 过去三年基金的利润分配情况

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
----	-----------	----------	-----------	----------	----

2020	0.00	0.00	0.00	0.00	-
2019	0.00	0.00	0.00	0.00	-
2018	0.00	0.00	0.00	0.00	-

3、基金份额变动情况

报告期期初基金份额总额	484.236693
报告期期间基金总申购份额	88.888889
减：报告期期间基金总赎回份额	80.0131
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
期末基金总份额/期末基金实缴总额	493.112482

单位：万份/万元

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30期，均已在中国基金业协会备案。

基金经理概况：张银广先生，深圳市东源嘉盈资产管理有限公司投资经理，学士，11年投资经验。

2、管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

3、报告期内基金投资策略和业绩表现

2020年，同期上证指数上涨13.87%，本基金业绩上涨15.11%，跑赢同期指数。

2020年初突发极端疫情事件，全球陷入恐慌，在如此复杂的背景下，我们坚持乐观，投资策略上，仓位主要配置在了质地优良的低估值板块。但后来市场出现了罕见的分化行情，虽然我们跑赢了指数，但也错失了一些机会。

4、管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着疫情逐步好转，全球经济将会逐步复苏。去年市场出现了极端罕见的分化行情，某些行业出现了明显的高估，我们依然相信常识，不盲目追风，争取在质地优良的低估值板块里面寻找机构性机会。

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控：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为申万宏源证券股份有限公司,托管机构为招商证券股份有限公司。

7、基金运作情况和运用杠杆情况

本基金追求长期稳健运行,报告期内净值增长 15.11%。

报告期内本基金合理运用了适量的杠杆。

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. 《东源嘉盈皓月 1 号私募证券投资基金基金合同》
3. 《深圳市东源嘉盈资产管理有限公司与招商证券股份有限公司之金融运营服务协议》
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管理有限公司。

客户服务电话: 0755-82785505

5、托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人违规守信情况声明

本报告期,本托管人——招商证券股份有限公司在对本基金的托管过程中,严格遵守有关法律法规和基金合同的有关规定,不存在损害份额持有人利益的行为,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

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

本托管人按照基金合同的约定,对本基金报告期的基金资产净值进行了复核;同时依据法律法规和基金合同规定,在托管人履行的投资监督范围内,对本基金报告期的投资情况进行了监督。在本基金合同约定的投资监督范围内,托管人未发现报告期内管理人违反基金合同约定的事项。报告期内,本基金的利润分配情况详见本报告中“2、主要财务指标、基金净值表

现及利润分配情况”部分。

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

基于基金管理人提供的必要的估值要素，本托管人参照《私募投资基金监督管理暂行办法》、《私募投资基金信息披露管理办法》等法律法规和基金合同的约定，对基金管理人报告中的主要财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容的真实性、准确性和完整性进行了复核，未发现异常。

6、年度财务报表

6.1 资产负债表

金额单位：元

资产	2020-12-31	2019-12-31
资产：		
银行存款	573.31	104.07
结算备付金	2,858,528.29	0.00
存出保证金	0.00	15,551.63
交易性金融资产	8,390,447.96	7,077,841.32
其中：股票投资	8,390,447.96	7,073,841.56
基金投资	0.00	0.00
债券投资	0.00	3,999.76
资产支持证券投资	0.00	0.00
贵金属投资	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	0.00	140.64
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
递延所得税资产	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产总计	11,249,549.56	7,093,637.66
负债和所有者权益	2020-12-31	2019-12-31
负债：		
短期借款	4,283,755.57	1,480,813.48
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00

应付管理人报酬	442,636.61	68,365.44
应付托管费	1,703.43	1,236.36
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	0.00	0.00
应交税费	28,869.10	13,273.46
应付利息	11,137.76	1,067.28
应付利润	0.00	0.00
递延所得税负债	0.00	0.00
其他负债	1,703.43	1,236.36
负债合计	4,769,805.90	1,565,992.38
所有者权益：		
实收基金	4,931,124.82	4,842,366.93
未分配利润	1,548,618.84	685,278.35
所有者权益合计	6,479,743.66	5,527,645.28
负债和所有者权益总计	11,249,549.56	7,093,637.66

注：1、其他资产：未被统计进前列分类的资产科目，主要包括其他私募基金、基金公司专户、券商资管计划、有限合伙企业股权、未上市企业股权等。

2、其他负债：未被统计进前列分类的负债科目，主要包括应付外包服务费、应付投资顾问费、应付咨询服务费等。

3、6.1 资产负债表中“股票投资”统计所有股票（含新三板股票）投资市值，7.1 章节中“股票投资”统计除新三板投资和上市公司定向增发股票投资以外的市值，新三板投资和上市公司定向增发股票投资有单独指标统计。

4、6.1 资产负债表中“应收股利”、“应收申购款”、“应收利息”单独列示，“其他资产”是总资产与已列示明细资产项的轧差项，7.1 期末基金资产组合情况中“其他资产”中除总资产与已列示明细资产项的轧差项外，还包含“应收股利”、“应收申购款”、“应收利息”。

6.2 利润表

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入	1,887,950.14	839,305.51
1. 利息收入	319.36	3,754.25
其中：存款利息收入	315.44	3,434.62
债券利息收入	3.92	0.95
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产收入	0.00	318.68
其他利息收入	0.00	0.00
2. 投资收益（损失以“-”填列）	1,452,069.67	693,954.40

金额单位：元

其中：股票投资收益	1,281,613.76	565,835.03
基金投资收益	-37,905.60	11,075.31
债券投资收益	3,039.08	488.93
资产支持证券投资 收益	0.00	0.00
贵金属投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	205,322.43	116,555.13
其他收益	0.00	0.00
3. 公允价值变动收 益（损失以“-”号填 列）	471,874.14	158,423.60
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）	0.00	0.00
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	-36,313.03	-16,826.74
减：二、费用	884,736.97	281,473.10
1. 管理人报酬	462,368.83	189,045.34
其中：固定管理费	91,548.30	49,563.17
业绩报酬	370,820.53	139,482.17
2. 托管费	6,103.08	3,304.15
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 外包服务费	6,103.08	3,304.15
5. 交易费用	129,463.90	50,665.98
6. 利息支出	276,340.51	32,128.27
其中：卖出回购金融 资产支出	0.00	0.00
7. 其他费用	4,357.57	3,025.21
三、利润总额（亏损 总额以“-”号填列）	1,003,213.17	557,832.41
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润（净亏损 以“-”号填列）	1,003,213.17	557,832.41

注：其他收益：未被统计进前列分类的损益类科目，主要包括投资于其他私募基金、基金公司专户、券商资管计划、有限合伙企业股权、未上市企业股权等产生的投资收益。

6.3 所有者权益变动表

金额单位：元

项目	本期 2020年01月01日至2020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）	4,842,366.93	685,278.35	5,527,645.28
二、本期经营活动产	0.00	1,003,213.17	1,003,213.17

生的基金净值变动数（本期利润）			
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）	88,757.89	-139,872.68	-51,114.79
其中：1. 基金申购款	888,888.89	111,111.11	1,000,000.00
2. 基金赎回款	-800,131.00	-250,983.79	-1,051,114.79
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）	4,931,124.82	1,548,618.84	6,479,743.66
项目	上年度可比期间 2019年01月01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）	4,100,000.00	0.00	4,100,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	557,832.41	557,832.41
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）	742,366.93	127,445.94	869,812.87
其中：1. 基金申购款	3,999,297.58	400,702.42	4,400,000.00
2. 基金赎回款	-3,256,930.65	-273,256.48	-3,530,187.13
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）	4,842,366.93	685,278.35	5,527,645.28

7、期末投资组合情况

7.1 期末基金资产组合情况

项目		金额单位：元
		金额
现金类资产	银行存款	573.31
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	0.00
	其中：优先股	0.00
	其他股权类投资	0.00
上市公司定向增发投资	上市公司定向增发股票投资	0.00

新三板投资	新三板挂牌企业投资	0.00
境内证券投资规模	结算备付金	2,858,528.29
	存出保证金	0.00
	股票投资	8,390,447.96
	债券投资	0.00
	其中：银行间市场债券	0.00
	其中：利率债	0.00
	其中：信用债	0.00
	资产支持证券	0.00
	基金投资（公募基金）	0.00
	其中：货币基金	0.00
	期货及衍生品交易保证金	0.00
	买入返售金融资产	0.00
	其他证券类标的	0.00
资管计划投资	商业银行理财产品投资	0.00
	信托计划投资	0.00
	基金公司及其子公司资产管理计划投资	0.00
	保险资产管理计划投资	0.00
	证券公司及其子公司资产管理计划投资	0.00
	期货公司及其子公司资产管理计划投资	0.00
	私募基金产品投资	0.00
	未在协会备案的合伙企业份额	0.00
另类投资	另类投资	0.00
境内债权类投资	银行委托贷款规模	0.00
	信托贷款	0.00
	应收账款投资	0.00
	各类受（收）益权投资	0.00
	票据（承兑汇票等）投资	0.00
	其他债权投资	0.00
境外投资	境外投资	0.00
其他资产	其他资产	
基金负债情况	债券回购总额	0.00
	融资、融券总额	4,283,755.57
	其中：融券总额	0.00
	银行借款总额	0.00
	其他融资总额	0.00

中国银行股份有限公司

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	325,150.00	5.02
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	0.00	0.00
J	金融业	7,297,931.96	112.63
K	房地产业	305,100.00	4.71
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	462,266.00	7.13
S	综合	0.00	0.00
	合计	8,390,447.96	129.49

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 (%)
能源	0.00	0.00
基础材料	0.00	0.00
工业	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
医疗保健	0.00	0.00
金融	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