

东源嘉盈成长2号私募证券投资基金2020年年度报告

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、基金产品概况

1.1、基金基本情况

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
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2020-06-30
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）	无
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	919.801980
基金到期日期	2030-06-29

1.2、基金产品说明

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)	无
风险收益特征	R4

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	国泰君安证券股份有限公司
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		tgrxp@tg.gtja.com
注册地址	广东省深圳市福田区福田区香梅路中投国际商务中心 A 栋 13 楼 C	中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号
办公地址	广东省深圳市福田区福田区香梅路中投	上海市静安区新闻路

	国际商务中心 A 栋 13 楼 C	669 号博华广场 19 楼
邮政编码	518000	200041
法定代表人	杨凡	贺青

1.4、信息披露方式

基金管理人有权采用下列一种或多种方式向基金份额持有人提供报告或进行相关通知， 传真、电子邮件或短信；邮寄服务；基金管理人网站；其他中国证监会以及基金业协会规 定的信息披露途径或方式	
--	--

1.5、其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所		
注册登记机构	国泰君安证券股份有限公司	上海市静安区新闻路 669 号博华广场 18 楼
外包机构	国泰君安证券股份有限公司	上海市静安区新闻路 669 号博华广场 18 楼

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	139,586.98	0.00	0.00
本期利润	130,756.44	0.00	0.00
期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	63,886.64	0.00	0.00
期末可供分配基金份额利 润	0.0069	0.0000	0.0000
期末基金净资产	9,261,906.44	0.00	0.00
报告期期末单位净值	1.007	0.000	0.000
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	0.70%	0.00%	0.00%

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	0.70	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.70	-	-	-

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

表中指标均以不带百分号数值形式表示，一般保留至小数点后2位。

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 年	0.00	0.00	0.00	0.00	
2019 年	0.00	0.00	0.00	0.00	
2018 年	0.00	0.00	0.00	0.00	

3、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	1,800.000000
报告期期间基金总申购份额	19.801980
减：报告期期间基金总赎回份额	900.000000
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	919.801980

注：

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。

4、管理人说明的其他情况

4.1 报告期内基金运作合规守信情况

报告期内，本基金投资运作符合基金合同的约定。

4.2 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。

4.3 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 9,263,821.12 元，净资产为 9,261,906.44 元，本基金总资产与净资产的比例为 100.02%。

4.4 报告期内投资收益分配和损失承担情况

详见年报'2.3 过去三年基金的利润分配情况'章节。

5、托管人报告

5.1、报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对本基金的托管过程中，严格遵守法律法规的规定、基金合同和托管协议（如有）的有关约定，履行了托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

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。

本报告期内，本托管人对基金资产净值的计算进行了复核。本报告期内，本基金的利润分配情况详见本年度报告中“2.3 过去三年基金的利润分配情况”中的本年度相关内容。

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

报告期内，托管人对管理人所编制的本年度报告中的财务指标、基金净值表现、基金份额变动情况、财务报表、投资组合报告等内容进行了复核，确认以上内容准确。

6、年度财务报表

6.1、资产负债表

单位：元

资产	本期末 2020-12-31	上年度末 2019-12-31
资产：		
银行存款	83.10	0.00
结算备付金	0.00	0.00
存出保证金	230,558.35	0.00
交易性金融资产	3,933,095.04	0.00
其中：股票投资	3,933,095.04	0.00
基金投资	0.00	0.00
债券投资	0.00	0.00
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	5,100,027.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	57.63	0.00
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	9,263,821.12	0.00

负债和所有者权益	本期末 2020-12-31	上年度末 2019-12-31
负债：		
短期借款	0.00	0.00
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	0.00	0.00
应付托管费	799.65	0.00
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	315.38	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
递延所得税负债	0.00	0.00
其他负债	799.65	0.00
负债合计	1,914.68	0.00
所有者权益：		
实收基金	9,198,019.80	0.00
未分配利润	63,886.64	0.00
所有者权益合计	9,261,906.44	0.00
负债和所有者权益总计	9,263,821.12	0.00

6.2、利润表

单位：元

项目	本期	上年度可比期间
	2020-06-30 至 2020-12-31	2019-01-01 至 2019-12-31
一、收入	142,186.21	0.00
1. 利息收入	161,055.70	0.00
其中：存款利息收入	9,288.94	0.00
债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产收入	151,716.76	0.00
其他利息收入	50.00	0.00
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-5,435.54	0.00
其中：股票投资收益	-11,035.54	0.00
基金投资收益	0.00	0.00

债券投资收益	0.00	0.00
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	5,600.00	0.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-8,830.54	0.00
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
5. 其他收入（损失以“-”填列）	-4,603.41	0.00
减：二、费用	11,429.77	0.00
1. 管理人报酬	0.00	0.00
其中：固定管理费	0.00	0.00
业绩报酬	0.00	0.00
2. 托管费	1,920.93	0.00
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 外包服务费	1,920.93	0.00
5. 交易费用	6,260.51	0.00
6. 利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
7. 其他费用	1,327.40	0.00
三、利润总额	130,756.44	0.00
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润	130,756.44	0.00

6.3、所有者权益变动表

单位：元

项目	本期 2020-06-30 至 2020-12-31		
	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）	18,000,000.00	0.00	18,000,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	130,756.44	130,756.44
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）	-8,801,980.20	-66,869.80	-8,868,850.00
其中：1. 基金申购款	198,019.80	1,980.20	200,000.00
2. 基金赎回款	-9,000,000.00	-68,850.00	-9,068,850.00
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	0.00	0.00	0.00

“-”号填列)			
五、期末所有者权益（基金净值）	9,198,019.80	63,886.64	9,261,906.44
项目	上年度可比期间 2019-01-01 至 2019-12-31		
	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）	0.00	0.00	0.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	0.00	0.00
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）	0.00	0.00	0.00
其中：1. 基金申购款	0.00	0.00	0.00
2. 基金赎回款	0.00	0.00	0.00
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）	0.00	0.00	0.00

7、期末投资组合情况

7.1、期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额(元)
1	银行存款	83.10
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	2,717,289.04
7	结算备付金	230,558.35
8	存出保证金	
9	股票投资	1,215,806.00
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	5,100,027.00
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#57.63;
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。

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	1,013,407.96	10.94
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	449,350.00	4.85
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	1,703,881.08	18.40
J	金融业	766,456.00	8.28
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	3,933,095.04	42.47

7.2.2、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）。

信息披露报告是否经托管机构复核：是