

# 东源嘉盈成长2号私募证券投资基金

## 2021年2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



人  
托  
理  
人

## 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)	861.895619
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	R4

## 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	14.27	-	-	-
自基金合同生效起至今	18.50	-	-	-

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	2021-04-01	至	2021-06-30	(元)
本期已实现收益				271,245.13
本期利润				1,343,681.31
期末基金资产净值				10,217,082.04

期末基金份额净值	1.185
----------	-------

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	115.05
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	8,030,694.00
7	结算备付金	19,333.68
8	存出保证金	
9	股票投资	1,272,750.00
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	900,004.50
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#8.98；
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	3,678,060.00	36.00
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	582,750.00	5.70
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	4,352,634.00	42.60
J	金融业	690,000.00	6.75
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	9,303,444.00	91.06

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	928.734038
报告期期间基金总申购份额	38.572806
减：报告期期间基金总赎回份额	105.411225
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	861.895619

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。

在第一季度 GDP 同比高速增长 18.3% 的基础上，2021 年第二季度起，中国经济增长逐步恢复常态，全年经济增速将前高后低，结构上依然呈现生产强、消费弱的特征。由于消费复苏的乏力，整个价值链条传导不畅，上游资源品的涨价对中游制造业的影响已经开始显现。经过国家开始出手干预，6 月 PPI 较 5 月回落 0.2 个百分点，但仍处于高位，其对国内经济和后续相关政策的推出依然会产生影响。

A 股市场方面，财报季后上市公司盈利能力修复被进一步证实，大宗商品价格波动下市场通胀焦虑不断经历修正，二季度市场进入震荡上行区间，科创领跑市场。整个第二季度上证综指涨 4.34%，深证成指涨 10.04%，创业板指涨 26.05%。

新三板市场方面，精选层发行继续稳步推进，转板上市逐步临近，转板概念股持续活跃，并带动创新层一些转层概念股票走强。目前机构投资者在精选层的参与度逐步增多，新三板的赚钱效应有所显现，伴随精选层扩容与转板以及创新层与基础层一些个股直接拟 A 股 IPO，预计相关个股将持续表现。第二季度，三板做市指数上涨 3.14%，三板成指微涨 0.08%。

本基金专注于精选层的新股申购及相关个股的投资。

### 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，经济增速可能放缓，总需求将重回内生增长轨道，输入型通胀和消费复苏乏力是困扰经济增长的最重要问题。央行 7 月上旬全面降准可能正是决策层对宏观经济在下半年可能面临的困难情况提前布局。国际方面，尽管疫情出现了一定的反复，但随着发达国家疫苗的逐步普及，其复苏的态势可能会加快。这时，各国央行是否会收紧流动性以应对可能过高的通胀数据是值得我们持续关注的事情。

A 股方面，从上市公司盈利周期来看，随着疫情影响逐渐减弱，盈利端加速修复，下半年业绩将是行情的主要驱动力，高增长的成长板块有望带动市场上行。

下半年，新三板将迎来转板的历史时刻，新三板与 A 股市场的互联互通将使中国多层次资本市场的功能更趋完善，新三板将真正实现“精选层为小特精专企业聚集地，创新层和基础层为小特精专企业的加速器和孵化器”的目标。未来伴随更多的企业在精选层挂牌，以及精选层混合交易和融资融券制度落地及精选层指数推出，精选层流动性将得到改善。精选层中转板类个股与创新层和基础层中具备转层或直接 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 10,222,906.21 元，净资产为 10,217,082.04 元，本基金总资产与净资产的比例为 100.06%。

## 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

