东源嘉盈新三板1号私募证券投资基金2021年第3季度报告

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	东源嘉盈新三板1号私募证券投资基金
基金编号	SS4659
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）	无
投资顾问（如有）	
基金运作方式	定期开放
基金成立日期	2017-05-24
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额(万元)	636.805300
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	采用聚焦创新型、成长型等类型股票的投资策略
业绩比较基准（如有）	无
风险收益特征	本基金属于高风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力为成长型、进取型的合格投资者

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	46.17			
自基金合同生效起至今	31.92			

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

3、主要财务指标

单位：元

项目	2021-07-01 至 2021-09-30
本期已实现收益	-127,520.84
本期利润	2,653,925.5
期末基金净资产	8,400,975.89
报告期期末单位净值	1.3192

4、投资组合情况

4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

项目		金额
现金类资产	银行存款	90.49 元
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	
	其中：优先股	
	其他股权类投资	
上市公司定向增发投资	上市公司定向增发股票投资	
新三板投资	新三板挂牌企业投资	8,098,477.00 元
境内证券投资规模	结算备付金	
	存出保证金	188,389.57 元
	股票投资	701,300.00 元
	债券投资	
	其中：银行间市场债券	
	其中：利率债	
	其中：信用债	
	资产支持证券	
	基金投资（公募基金）	
	其中：货币基金	
	期货及衍生品交易保证金	
	买入返售金融资产	
	其他证券类标的	
资管计划投资	商业银行理财产品投资	
	信托计划投资	
	基金公司及其子公司资产管理计划投资	
	保险资产管理计划投资	
	证券公司及其子公司资产管理计划投资	
	期货公司及其子公司资产管理计划投资	
	私募基金产品投资	
	未在协会备案的合伙企业份额	
另类投资	另类投资	
境内债权类投资	银行委托贷款规模	
	信托贷款	
	应收账款投资	
	各类受（收）益权投资	
	票据（承兑汇票等）投资	
	其他债权投资	
境外投资	境外投资	
其他资产	其他资产	应收利息#16.33；

基金负债情况	债券回购总额	
	融资、融券总额	
	其中：融券总额	
	银行借款总额	
	其他融资总额	

4.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合(注：不包括港股通数据)

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	4,985,355.00	59.34
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	701,300.00	8.35
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	2,857,122.00	34.01
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	256,000.00	3.05
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	8,799,777.00	104.75

4.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
农、林、牧、渔业	0.00	0.00
采矿业	0.00	0.00
制造业	0.00	0.00
电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
建筑业	0.00	0.00
批发和零售业	0.00	0.00
交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
住宿和餐饮业	0.00	0.00
信息传输、软件和信息技术服务业	0.00	0.00
金融业	0.00	0.00
房地产业	0.00	0.00
租赁和商务服务业	0.00	0.00
科学研究和技术服务业	0.00	0.00
水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
教育	0.00	0.00
卫生和社会工作	0.00	0.00
文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
综合	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上分类采用中国证券监督管理委员会制定的《上市公司行业分类指引》

5、基金份额变动情况

单位：万份

报告期期初基金份额总额	636.81
报告期期间基金总申购份额	0.00
减：报告期期间基金总赎回份额	0.00
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	636.81

6、管理人报告（如报告期内高管、基金经理及其关联基金经验、基金运作遵规守信情况、基金投资策略和业绩表现、对宏观经济、证券市场及其行业走势展望、内部基金监察稽核工作、基金估值程序、基金运作情况和运用杠杆情况、投资收益分配和损失承担情况、会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项、对本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）

截止本季度末，本产品持有以下退市或摘牌股票：[834496][赛乐奇(退市)]

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32期，均已在中国证券投资基金业协会备案。

基金经理概况：

刘惟进先生，深圳市东源嘉盈资产管理有限公司副总经理、基金经理，华中科技大学硕士，25年证券投资经历，曾任国信证券投资研究中心综合行业研究室主任、高级研究员；华西证券投资研究总部执行副总经理、股票投资部董事总经理兼投资经理。

杨凡先生，深圳市东源嘉盈资产管理有限公司董事长兼总经理、投资委员会主席、首席投资官，华中科技大学博士，29年证券投资经历，曾任银泰证券公司研究部总经理、资产管理部总经理、公司总裁助理。

2、 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

聚焦创新型、成长型等类型股票,专注于新三板创新层做市类及精选层标的，投资于流动性相对好、估值相对合理的细分行业领先企业。

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年第三季度，宏观经济表现不尽理想，GDP单季增速4.9%，两年复合增长率4.9%，较第二季度下滑0.6个百分点。投资和消费受地产调控持续及疫情反复影响,增速大幅回落；出口则韧性依旧；产业链价值传导不畅问题仍在，缺电致整个第二产业步履维艰，增速较第二季度下滑1.3个百分点。

证券市场,A股方面,第三季度上证综指跌0.64%,深证成指跌5.62%,创业板指跌6.69%。结构上看，受资源品价格持续上涨影响，周期性行业表现较好，采掘、有色金属涨幅超过20%，缺电影响下，公用事业涨幅同样居前。与此相对应的则是消费、医疗等行业的持续下跌。

新三板市场方面，首批精选层挂牌公司在7月满一周年，转板上市通道开启，陆续有公司披露转板预案，相关个股表现较好；9月2日习近平在中国国际服务贸易交易会上宣布深化新三板改革，设立北京证券交易所。该改革预示精选层将平移至北交所，未来新三板公司可直接通过创新层转至北交所上市，使得新三板公司有了更宽的上市通道。受北交所设立以及投资者门槛降低等消息影响，精选层股票普遍表现活跃，估值整体提升，并带动创新层与基础层一些优质企业股价飙升、估值提升。第三季度，三板做市指数大幅上涨38.81%，三板成指涨16.43%。

本基金坚持在新三板中配置较高比重仓位，主要投资在创新层及精选层的信息技术、先进制造业、医药、消费等领域。

报告期内，本基金份额净值增长率为46.17%。

4、 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济方面，整体风险可控，但面临的困难仍然不小，地产投资端的低迷对经济的影响可能在未来两个季度内持续显现。而类滞胀问题的出现则使政策的推出面临两难，最终还要看决策层的取舍以及对更长期问题的态度。国际方面,疫情对发达国家的影响已大大减轻，生活也越来越正常化，但通胀问题和能源问题则是困扰经济的因素。在现在的环保至上政策下，短期内可能也难有很好的解决办法。此外高通胀下，各国央行是否会提前收紧流动性也是值得我们持续关注的事情。

A股方面，进入四季度后，投资者对未来经济的预期的一致性越来越强。类滞胀现象下，必须消费和科技创新可能会重新成为市场的主流逻辑。尽管最近这段时间市场风格轮动速度较快，但这个变化已初见端倪。

新三板将迎来大发展的历史性机遇期。新三板的深化改革，使得北交所将成为打造服务

创新型中小企业主阵地，创新层和基础层成为培育小特精专企业的加速器和孵化器。由于新三板的包容性更强，且北交所为更多中小企业打开方便上市之门，新三板将吸引更多的中小企业（包括已摘牌的企业）前来挂牌；投资者门槛降低使得困扰新三板发展多年的流动性难题得到一定的修复，机构的参与度特别是做市商的参与度明显提升；北交所、创业板、科创板竞争将良性展开，北交所服务创新型中小企业及重点发展“专精特新”中小企业、创业板集中服务于成长型创新创业企业、科创板集中服务于科技创新企业，它们之间会有交集竞争，更多将是错位良性竞争。新三板可以预期的变化是：合格投资者数量猛增、估值进一步提升、做市商强势回归、挂牌企业数量增多等等，北交所的优质企业与创新层和基础层中具备转层或上市潜力的个股将成市场热点。

本基金将保持在创新型、成长型类股票中的配置。

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测：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，确保公司各产品合规运作、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国信证券股份有限公司。

7、 基金运作情况和运用杠杆情况

本基金本报告期初基金累计单位净值 0.9025 元，本报告期末基金累计单位净值 1.3192 元，本报告期内基金单位净值增长率为 46.17%。

报告期内本基金无运用杠杆的情况。

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）《东源嘉盈新三板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国信证券股份有限公司之运营外包服务总协议》

（4）基金管理人业务资格批件和营业执照

存放地点：

基金管理人处

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：0755-82788022

信息披露报告是否经托管机构复核：