

东源嘉盈成长2号私募证券投资基金

2021年3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)	702.757112
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	21.10	-	-	-
自基金合同生效起至今	43.50	-	-	-

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	2021-07-01	至	2021-09-30	(元)
本期已实现收益				1,564,758.06
本期利润				1,875,968.76
期末基金资产净值				10,087,011.68

期末基金份额净值	1.435
----------	-------

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	289.31
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	8,805,562.20
7	结算备付金	151,612.65
8	存出保证金	
9	股票投资	1,169,050.00
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	
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#-54.19;
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	3,131,162.20	31.04
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	926,250.00	9.18
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	5,674,400.00	56.25
J	金融业	242,800.00	2.41
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	9,974,612.20	98.89

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	861.895619
报告期期间基金总申购份额	0.000000
减：报告期期间基金总赎回份额	159.138507
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	702.757112

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。

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，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。

本基金将保持在精选层上股票的配置。

6.5 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。

6.6 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 10,126,459.97 元，净资产为 10,087,011.68 元，本基金总资产与净资产的比例为 100.39%。

6.7 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。

6.8 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