

东源嘉盈成长2号私募证券投资基金

2021年4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)	429.979570
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	41.32	-	-	-
自基金合同生效起至今	102.80	-	-	-

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

项目	金额单位:元			
	2021-10-01	至	2021-12-31	(元)
本期已实现收益				3,890,413.81
本期利润				3,780,538.42

期末基金资产净值	8,719,371.54
期末基金份额净值	2.028

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

序号	项目	金额单位：元
		人民币
1	银行存款	355.52
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	
7	结算备付金	21,613.30
8	存出保证金	
9	股票投资	6,368,026.00
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	2,400,019.20
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	
37	债券回购总额	应收利息#-270.74;
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	3,360,586.00	38.54
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	366,000.00	4.20
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	2,396,240.00	27.48
J	金融业	245,200.00	2.81
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	6,368,026.00	73.03

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

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

报告期期初基金份额总额	702.757112
报告期期间基金总申购份额	331.708768
减：报告期期间基金总赎回份额	604.486310
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	429.979570

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。

2021年第四季度，疫情的散发冲击和近两年的累积作用持续扰动国内经济，预计四季度GDP增速在4%左右，宏观经济走弱趋势已经显现。分项来看，出口数据仍然较好，但投资和消费的恢复仍需时间。

证券市场，A股方面，第四季度上证综指涨2.01%，深证成指涨3.83%，创业板指涨2.40%，科创50指数涨2.15%。结构上看前期表现不佳的行业在主题投资盛行下表现强劲，周期行业则因为价格上涨趋势被遏制而下跌较多。

新三板市场方面，新三板与北交所一体化发展方向明确。北交所于11月15日正式开市运行，原精选层挂牌公司整体平移至北交所。开市以来，北交所日均成交额较2021年8月精选层增长3.04倍，整体年化换手率为434.26%，流动性明显改善；2021年北交所股票平均上涨98.90%，市场财富效应初步显现；投资者数量超475万，是北交所设立消息宣布前的2.8倍；存量公募基金入市交易，8只新设主题基金全部超募。创新层和基础层获得有效带动，全年成交额同比增长19.76%，10只指数全部上涨。第四季度，北交所股票表现强劲，而三板做市指数下跌7.98%、三板成指下跌1.91%，主要是创新层与基础层热点股票在第三季度大幅上扬后表现较弱，市场焦点转移至北交所上。

本基金加大了北交所优质股票的配置力度，主要投资于信息技术、先进制造业、医药、消费等领域，第四季度获得较好收益。

本基金专注于北交所相关个股的投资并将配置部分新三板优质股票。

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，整体风险依然可控，但在疫情影响下仍面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力，需要决策部门加大跨周期调节力度，并与逆周期调节相结合来进行应对。国际经济方面，疫情之后的大量货币投放导致通胀高企，主要经济体什么时候开始加息并回收流动性是全年最值得关注的的事件。

A股方面，元旦后强势股的调整让投资者对今年的收益预期大为降低，但我们认为今年A股的整体风险不大，疫情未彻底结束前可能仍是结构性行情，领涨的行业会发生变化，有业绩支撑或业绩向好方向的，过去3年未明显上涨的细分行业可能会是主要方向。

新三板迎来与北交所一体发展的历史性机遇期，共同打造服务创新型中小企业主阵地，创新层和基础层是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也明显提升;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:合格投资者数量进一步增加、估值有望继续提升、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。

本基金将继续专注于北交所上股票的投资并将配置部分新三板优质股票。

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 8789743.28 元,净资产为 8719371.54 元,本基金总资产与净资产的比例为 100.81%。

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