

# 东源嘉盈成长2号私募证券投资基金2021年年度报告

2021年12月31日

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） | 429.979570         |
| 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<br>限公司           |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 伍晓敏                                   | 帅芳                         |
|             | 联系电话 | 18820041696                           | 021-38917599-5             |
|             | 电子邮箱 | wuxm@dongyuanjy.com                   | tgrxp@tg.gtja.com          |
| 传真          |      |                                       |                            |
| 注册地址        |      | 广东省深圳市福田区福田香梅路中投<br>国际商务中心 A 栋 13 楼 C | 中国(上海)自由贸易<br>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国际商务中心 A 栋 13 楼 C | 上海市静安区新闻路 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      | 2021 年       | 2020 年       | 2019 年      |
|--------------|--------------|--------------|-------------|
| 本期已实现收益      | 6,027,874.64 | 139,586.98   | 0.00        |
| 本期利润         | 7,280,397.18 | 130,756.44   | 0.00        |
| 期末数据和指标      | 2021 年末      | 2020 年末      | 2019 年末     |
| 期末可供分配利润     | 3,794,121.83 | 63,886.64    | 0.00        |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.8824       | 0.0069       | 0.0000      |
| 期末基金净资产      | 8,719,371.54 | 9,261,906.44 | 0.00        |
| 报告期末单位净值     | 2.028        | 1.007        | 0.000       |
| 累计期末指标       | 2021 年末 (%)  | 2020 年末 (%)  | 2019 年末 (%) |
| 基金份额累计净值增长率  | 102.80%      | 0.70%        | 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         | 101.39   | -           | -            | -               |
| 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 |
|--------|-----------|----------|-----------|----------|----|
| 2021 年 | 0.00      | 0.00     | 0.00      | 0.00     |    |
| 2020 年 | 0.00      | 0.00     | 0.00      | 0.00     |    |
| 2019 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               | 919.801980 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 380.464873 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 870.287283 |
| 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 报告期内高管、基金经理及其管理基金经验

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，30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。

### 4.2 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。

### 4.3 报告期内基金投资策略和业绩表现

聚焦新三板精选层（北交所）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年面对复杂严峻的国内外形势和疫情防控等诸多风险挑战，我国GDP增长8.1%，“十四五”实现良好开局。但消费和投资恢复迟缓，稳出口难度逐渐增大。

A股方面，全年上证综指涨4.8%，深证成指涨2.67%，创业板指涨12.02%，科创50指数涨0.37%。结构上行业分化严重，电力设备、有色、煤炭、基础化工等板块涨幅居前，食品饮料、房地产、非银金融、家用电器等板块跌幅较大。

新三板市场方面，新三板全面深化改革持续推进，北交所设立并于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，新三板与北交所一体化发展方向明确。北交所开市以来，北交所整体成交活跃，个股涨幅明显，2021年北交所股票平均上涨98.90%；投资者数量增多至475万，是北交所设立前的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。北交所设立、投资者门槛降低等一系列改革举措，带动创新层和基础层估值普遍提升，交易额增加，具北交所或A股IPO概念的相关个股表现突出。全年三板做市指数上涨35.64%、三板成指上涨12.61%。



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，全年净值增长率为101.39%。

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。

#### 4.4 报告期内对宏观经济、证券市场及其行业走势展望

2022年，国内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，国际上俄乌冲突、美联储加息缩表、全球疫情仍在持续扩散等因素，导致世界经济复苏动力不足，大宗商品价格高位波动，外部环境更趋复杂严峻和不确定。全年经济稳增长任务突出，稳增长的力度或进一步加强。

A股方面，在稳增长预期下，全年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，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、估值有望修复、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。

#### 4.5 报告期内内部基金监察稽核工作

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控：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。



#### 4.6 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。

#### 4.7 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 8,789,743.28 元，净资产为 8,719,371.54 元，本基金总资产与净资产的比例为 100.81%。

#### 4.8 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。

#### 4.9 报告期内会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项

无

#### 4.10 报告期内对本基金持有人数或基金资产净值预警情形

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。

#### 4.11 报告期内可能存在的利益冲突

不存在可能的利益冲突等情况。

#### 4.12 报告期内其他说明情况

无

## 5、托管人报告

### 5.1、报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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遵规守信、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

| 资产      | 本期末 2021-12-31 | 上年度末 2020-12-31 |
|---------|----------------|-----------------|
| 资产：     |                |                 |
| 银行存款    | 355.52         | 83.10           |
| 结算备付金   | 21,613.30      | 0.00            |
| 存出保证金   | 0.00           | 230,558.35      |
| 交易性金融资产 | 6,368,026.00   | 3,933,095.04    |
| 其中：股票投资 | 6,368,026.00   | 3,933,095.04    |
| 基金投资    | 0.00           | 0.00            |

单位：元



东源嘉盈成长2号私募证券投资基金 2021 年年度报告

|            |                |                 |
|------------|----------------|-----------------|
| 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   | 0.00           | 0.00            |
| 应收证券清算款    | 2,400,019.20   | 5,100,027.00    |
| 应收利息       | 0.00           | 0.00            |
| 应收股利       | -270.74        | 57.63           |
| 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       | 0.00           | 0.00            |
| 负债和所有者权益   | 8,789,743.28   | 9,263,821.12    |
| 负债:        | 本期末 2021-12-31 | 上年度末 2020-12-31 |
| 短期借款       |                |                 |
| 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      | 0.00           | 0.00            |
| 应付销售服务费    | 685.79         | 799.65          |
| 应付交易费用     | 0.00           | 0.00            |
| 应交税费       | 0.00           | 0.00            |
| 应付利息       | 69,000.16      | 315.38          |
| 应付利润       | 0.00           | 0.00            |
| 递延所得税负债    | 0.00           | 0.00            |
| 其他负债       | 0.00           | 0.00            |
| 负债合计       | 685.79         | 799.65          |
| 所有者权益:     | 70,371.74      | 1,914.68        |
| 实收基金       |                |                 |
| 未分配利润      | 4,299,795.70   | 9,198,019.80    |
| 所有者权益合计    | 4,419,575.84   | 63,886.64       |
| 负债和所有者权益总计 | 8,719,371.54   | 9,261,906.44    |
|            | 8,789,743.28   | 9,263,821.12    |

## 6.2、利润表

| 项目   | 单位: 元                   |                         |
|------|-------------------------|-------------------------|
|      | 本期                      | 上年度可比期间                 |
|      | 2021-01-01 至 2021-12-31 | 2020-06-30 至 2020-12-31 |
| 一、收入 | 7,462,301.43            | 142,186.21              |



|                      |              |            |
|----------------------|--------------|------------|
| 1.利息收入               | 22,301.18    | 161,055.70 |
| 其中：存款利息收入            | 1,168.81     | 9,288.94   |
| 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           | 21,132.37    | 151,716.76 |
| 其他利息收入               | 0.00         | 50.00      |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）     | 6,370,211.89 | -5,435.54  |
| 其中：股票投资收益            | 6,252,739.07 | -11,035.54 |
| 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                 | 117,472.82   | 5,600.00   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”填列） | 1,252,522.54 | -8,830.54  |
| 4.汇兑收益（损失以“-”填列）     | 0.00         | 0.00       |
| 5.其他收入（损失以“-”填列）     | -182,734.18  | -4,603.41  |
| 减：二、费用               | 181,904.25   | 11,429.77  |
| 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                | 2,516.01     | 1,920.93   |
| 3.销售服务费              | 0.00         | 0.00       |
| 4. 外包服务费             | 2,516.01     | 1,920.93   |
| 5.交易费用               | 154,475.02   | 6,260.51   |
| 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               | 22,397.21    | 1,327.40   |
| 三、利润总额               | 7,280,397.18 | 130,756.44 |
| 减：所得税费用              | 0.00         | 0.00       |
| 四、净利润                | 7,280,397.18 | 130,756.44 |

### 6.3、所有者权益变动表

单位：元

| 项目                | 本期<br>2021-01-01 至 2021-12-31 |              |              |
|-------------------|-------------------------------|--------------|--------------|
|                   | 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）   | 9,198,019.80                  | 63,886.64    | 9,261,906.44 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动 | 0.00                          | 7,280,397.18 | 7,280,397.18 |



|                                        |                                    |               |                |
|----------------------------------------|------------------------------------|---------------|----------------|
| 数（本期利润）                                |                                    |               |                |
| 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）      | -4,898,224.10                      | -2,924,707.98 | -7,822,932.08  |
| 其中：1.基金申购款                             | 3,804,648.73                       | 1,495,351.27  | 5,300,000.00   |
| 2.基金赎回款                                | -8,702,872.83                      | -4,420,059.25 | -13,122,932.08 |
| 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）                        | 4,299,795.70                       | 4,419,575.84  | 8,719,371.54   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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“-”号填列） | 0.00                               | 0.00          | 0.00           |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 9,198,019.80                       | 63,886.64     | 9,261,906.44   |

## 7、期末投资组合情况

### 7.1、期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目           | 金额单位：元       |
|----|--------------|--------------|
|    |              | 金额(元)        |
| 1  | 银行存款         |              |
| 2  | 股权投资         | 355.52       |
| 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 |              |
| 6  | 新三板挂牌企业投资    | 0.00         |
| 7  | 结算备付金        |              |
| 8  | 存出保证金        | 21,613.30    |
| 9  | 股票投资         |              |
| 10 | 债券投资         | 6,368,026.00 |



|    |                   |               |
|----|-------------------|---------------|
| 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           | 2,400,019.20  |
| 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。

## 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         |              |       |
| B | 采矿业              | 0.00         | 0.00  |
| C | 制造业              | 0.00         | 0.00  |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,360,586.00 | 38.54 |
| 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      | 0.00         | 0.00  |
| H | 住宿和餐饮业           | 366,000.00   | 4.20  |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 0.00         | 0.00  |
| J | 金融业              | 2,396,240.00 | 27.48 |
| K | 房地产业             | 245,200.00   | 2.81  |
| 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 |

### 7.2.2、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         |

金额单位：元



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

托管人复核说明：本基金托管人按照相关法律法规、基金合同的规定，对本基金在本报告中的财务数据进行了复核。对按照规定应由托管人复核的数据，托管人无异议。

