

# 东源嘉盈成长2号私募证券投资基金

## 2022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) | 493.985489   |
| 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                   | 适合风险承受能力R4及以上投资者   |

## 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         | -9.95    | -           | -            | -               |
| 自基金合同生效起至今 | 47.60    | -           | -            | -               |

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       | 2022-07-01 | 至 | 2022-09-30 | (元)          |
|----------|------------|---|------------|--------------|
| 本期已实现收益  |            |   |            | -999.91      |
| 本期利润     |            |   |            | -807,669.07  |
| 期末基金资产净值 |            |   |            | 7,290,053.39 |

|          |       |
|----------|-------|
| 期末基金份额净值 | 1.476 |
|----------|-------|

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              | 72.74        |
| 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      |              |
| 6  | 新三板挂牌企业投资         | 907,500.00   |
| 7  | 结算备付金             | 542.92       |
| 8  | 存出保证金             |              |
| 9  | 股票投资              | 6,334,939.44 |
| 10 | 债券投资              | 0.00         |
| 11 | 其中：银行间市场债券        | 0.00         |
| 12 | 其中：利率债            | 0.00         |
| 13 | 其中：信用债            | 0.00         |
| 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          | 47,962.26    |
| 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      |  |
| 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<br>(%) |
|----|------------------|--------------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 0.00         | 0.00             |
| B  | 采矿业              | 0.00         | 0.00             |
| C  | 制造业              | 6,074,657.44 | 83.33            |
| 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      | 134,400.00   | 1.84             |
| 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  | 533,700.00   | 7.32             |
| J  | 金融业              | 499,682.00   | 6.85             |
| 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        | 7,242,439.44 | 99.35 |

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               | 493.985489 |
| 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            | 0.000000   |
| 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          | 493.985489 |

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。

三季度国内经济呈现出逐月修复的特点，主要体现为工业生产不断改善，但服务业和消费仍然受到疫情的压制，预计三季度GDP增速为3.5%左右。

三季度A股整体呈下挫调整态势，全球流动性收紧和“逆全球化”的加剧，以及国内经济的弱改善，使市场风格偏好持续从“成长”向安全边际较高的低估值板块转移。第三季度，上证综指下跌11.01%，深证成指下跌16.42%，创业板指数下跌18.56%，科创50指数下跌15.04%。

三季度北交所与新三板市场延续调整格局，主要受流动性不足及A股成长与科创类股票下挫调整的影响，第三季度，三板做市指数下跌2.54%、三板成指下跌2.82%。

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-9.95%

### 6.3 报告期内对宏观经济及其行业走势展望

四季度，中共二十大召开，科学谋划未来五年乃至更长时期发展，“中国式现代化”与“高质量发展”是关键，坚持把发展经济的着力点放在实体经济上。全面建成社会主义现代化强国是未来发展的中心任务。展望未来，国家将继续通过适时推出宏观经济支持政策，为经济高质量增长、促进平衡和可持续发展增添动力。

A股方面，“高质量发展”与“支持实体经济”基调预计将引导市场风格转变。目前经济复苏进程仍然缓慢，但从经济和金融数据来看，向好趋势基本确定，市场整体有望重回震荡上行趋势。

北交所与新三板将在“高质量发展”与“支持实体经济”基调中发挥重要作用，因为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，新三板为培育“专精特新”中小企业的基地。北证50指数预计在第四季度将正式登场，必将吸引更多的资金关注北交所及新三板中的优质企业。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有望持续成市场热点。

本基金将保持在创新型、成长型类股票中的配置。

### 6.4 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。

### 6.5 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 7,291,017.36 元，净资产为 7,290,053.39 元，本基金总资产与净资产的比例为 100.01%。

### 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

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。

