

# 私募证券投资基金信息披露年度报告

(2022-01-01 至 2022-12-31)

## 1、基金产品概况

### 1.1 基金基本情况

基金名称	东源嘉盈新三板1号私募证券投资基金
基金编码	SS4659
基金运作方式	
基金成立日期	2017-05-24
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	无
投资顾问(如有)	
期末基金总份额(万份)/期末基金实缴总额(万元)	636.805300
基金到期日期	2037年05月22日

### 1.2 基金产品说明

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

### 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	
信息披露 负责人	姓名	伍晓敏	
	联系电话	18820041696	
	电子邮箱	wuxm@dongyuanjy.com	
传真		0755-82785552	
注册地址		广东省深圳市福田区香梅路中投国际商务中心A栋13楼C	
办公地址		广东省深圳市福田区香梅路中投国际商务中心A栋13楼C	
邮政编码		518034	
法定代表人		杨凡	

### 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	国信证券股份有限公司	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 19 楼
外包机构	国信证券股份有限公司	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 19 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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-32,900.72	-84,821.42	940,599.28
本期利润	-2,566,158.90	2,358,012.53	-50,349.25
期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	-1,177,458.57	-361,288.06	-969,312.20
期末可供分配基金份额利润	-0.1849	-0.0567	-0.1522
期末基金净资产	5,190,594.43	7,756,753.33	5,398,740.80
报告期期末单位净值	0.8151	1.2181	0.8478
累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	-18.49	21.81	-15.22

### 2.2 基金净值表现

阶段	净值增长率	净值增长率标准差 (选填)	业绩比较基准收 益率(选填)	业绩比较基准收 益率标准差(选填)
当年	-33.08			
自基金合同 生效起至今	-18.49			

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

### 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

2022	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2021	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2020	0.0000	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	636.805300
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	636.805300

**4、管理人说明的其他情况**（如报告期内高管、基金经理及其关联基金经验、基金运作合规守信情况、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）

截止本年度末，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，26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，31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合规守信情况的说明

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。

2022年国内在疫情影响下面临需求收缩、供给冲击、预期转弱等多重压力,国际环境亦复杂严峻,国家加大宏观调控力度,应对超预期因素冲击,全年实现GDP增长3%。

经济走弱在股票市场引发市场信心不足,A股方面,全年上证综指跌15.13%,深证成指跌25.85%,创业板指跌29.37%,科创50指数跌31.35%。

新三板市场还叠加有流动性明显萎缩的状况,成交普遍低迷,北交所的成交亦明显减少,全年三板做市指数跌16.03%、三板成指跌15.66%,北证50指数在第四季度正式发布实时行情,北证50全年跌5.79%。

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-33.08%。净值跌幅大主要原因是仓位重且流动性弱、主要标的资本运作失利等。

### 4、 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二十大已胜利召开,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。党的二十大后首次中央经济工作会议全面部署今后经济工作,提出要“加快建设现代化产业体系”。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”、“支持实体经济”与“加快建设现代化产业体系”基调预计将引导市场风格转变,防疫政策优化调整也将使生产生活逐步正常化,消费信心有望提振,市场整体有望有更好表现。

北交所与新三板将在“高质量发展”、“支持实体经济”与“加快建设现代化产业体系”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50ETF相关产品已发行,北交所做市制度已于2023年2月正式启动,北交所融资融券业务也在2023年2月开展,可为北交所市场引入更多投资长期资金,提高市场流动性,营造有利于科技型中小微企业成长的良好环境,也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。

### 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守信、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

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

## 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

--

### 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

--

### 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

--

## 6、年度财务报表

### 6.1 资产负债表

单位：元

资产	本期末 2022-12-31	上年度末 2021-12-31
资产：		
银行存款	73.80	69.42
结算备付金	0.00	0.00
存出保证金	158,686.66	8,651.93
交易性金融资产	5,054,650.40	7,835,052.00
其中：股票投资	5,054,650.40	7,835,052.00
基金投资	0.00	0.00
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	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.77
应收股利	0.00	0.00
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	5,213,410.86	7,843,774.12

负债和所有者权益	本期末 2022-12-31	上年度末 2021-12-31
负债：		
短期借款	0.00	0.00
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	20,132.21	30,241.43
应付托管费	1,342.11	2,016.07
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	0.00	0.00
应交税费	0.00	52,747.22
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
递延所得税负债	0.00	0.00
其他负债	1,342.11	2,016.07
负债合计	22,816.43	87,020.79
所有者权益：		
实收基金	6,368,053.00	6,368,053.00
未分配利润	-1,177,458.57	1,388,700.33
所有者权益合计	5,190,594.43	7,756,753.33
负债和所有者权益合计	5,213,410.86	7,843,774.12

## 6.2 利润表

单位：元

项目	本期	上年度可比期间
	2022-01-01 至 2022-12-31	2021-01-01 至 2021-12-31
一、收入	-2,462,694.63	2,989,497.45
1. 利息收入	71.05	217.01
其中：存款利息收入	71.05	217.01
债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产利息收入	0.00	0.00
其他利息收入	0.00	0.00
2. 投资收益（损失以“-”填列）	80,286.46	561,957.23
其中：股票投资收益	27,558.36	542,341.83
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	52,728.10	19,615.40
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-2,538,909.66	2,448,485.43
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
5. 其他收入（损失以“-”填列）	-4,142.48	-21,162.22
<b>减：二、费用</b>	103,464.27	631,484.92
1. 管理人报酬	93,933.38	598,682.78
其中：固定管理费	93,933.38	96,625.49
业绩报酬	0.00	502,057.29
2. 托管费	6,262.12	6,441.64
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 外包服务费	6,262.12	6,441.64
5. 交易费用	2,238.95	11,603.89
6. 利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产款支出	0.00	0.00
7. 其他费用	-5,232.30	8,314.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-2,566,158.90	2,358,012.53
减：所得税费用	0.00	0.00
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-2,566,158.90	2,358,012.53

备注：2022年12月30日，该产品的暂估业绩报酬金额为0.00元。

### 6.3 所有者权益变动表

单位：元

项目	本期 (2022-01-01至2022-12-31)		
	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）	6,368,053.00	1,388,700.33	7,756,753.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	-2,566,158.90	-2,566,158.90
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）	0.00	0.00	0.00



其中：1. 基金申购款	0.00	0.00	0.00
2. 基金赎回款	0.00	0.00	0.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	6,368,053.00	-1,177,458.57	5,190,594.43
项目	上年度可比期间 (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）	6,368,053.00	-969,312.20	5,398,740.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	2,358,012.53	2,358,012.53
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）	0.00	0.00	0.00
其中：1. 基金申购款	0.00	0.00	0.00
2. 基金赎回款	0.00	0.00	0.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	6,368,053.00	1,388,700.33	7,756,753.33

## 7、期末投资组合情况

### 7.1 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	73.80 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	4,148,916.40 元
境内证券投资规模	结算备付金	
	存出保证金	158,686.66 元
	股票投资	905,734.00 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	
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	

## 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	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	3,011,952.00	58.03
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	78,600.00	1.51
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,015,992.00	19.57
J	金融业	95,590.00	1.84
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	852,516.40	16.42
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
	<b>合计</b>	<b>5,054,650.40</b>	<b>97.38</b>

备注：以上股票投资不含港股通。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合（如有）

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
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
<b>合计</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>

备注：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》

信息披露报告是否经托管机构复核：否

