

东源嘉盈成长2号私募证券投资基金

2023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）	515.365032
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(%)	业绩比较基准收益标准差(%)
当季	22.16	-	-	-
自基金合同生效起至今	32.30	-	-	-

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	2023-10-01	至	2023-12-31	(元)
本期已实现收益				-733,475.28
本期利润				1,239,913.30

期末基金资产净值	6,820,067.16
期末基金份额净值	1.323

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	153.25
2	股权投资	0.00
3	其中：优先股	0.00
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	942,339.00
7	结算备付金	693.51
8	存出保证金	0.00
9	股票投资	5,241,753.81
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	0.00
15	基金投资（公募基金）	0.00
16	其中：货币基金	0.00
17	期货及衍生品交易保证金	0.00
18	买入返售金融资产	635,934.47
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	0.00

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	0.00
36	其他资产	
37	债券回购总额	0.00
38	融资、融券总额	0.00
39	其中：融券总额	0.00
40	银行借款总额	0.00
41	其他融资总额	

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	5,177,453.81	75.91
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	64,300.00	0.94
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	0.00	0.00
J	金融业	575,170.00	8.43
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	367,169.00	5.38
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	6,184,092.81	90.67

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）。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。

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	515.365032
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	515.365032

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

聚焦创新型、成长型等类型股票，专注于北交所及新三板创新层做市类标的，投资于流动性相对好、估值相对合理的细分行业领先企业。

2023 第四季度，国内经济预期不断分化，PMI、消费、工业企业等数据不及预期，经济整体呈弱复苏态势。美债利率持续高位，外资大幅流出压制 A 股流动性。虽有中央会议的召开与相关政策出台，以及中美元首会晤带来中美关系有所缓和，引发了市场预期一定的改善，但增量资金不足，市场整体呈震荡下行走势。第四季度上证综指跌 4.36%，深证成指跌 5.79%，创业板指跌 5.62%，科创 50 指数跌 4.03%。

经济预期转弱且 A 股低迷也影响着新三板及北交所市场表现，但因证监会在 2023 年 9 月推出“深改 19 条”，以及 11 月 15 日北交所成立两周年窗口期，“920”代码号段启用、北交所证券逐步纳入中证跨市场指数体系等一系列政策出台点燃北交所赚钱效应，各类增量资金积极入场。10 月下旬，北证 50 触底反弹，自 2023 年 11 月 16 日起北交所板块日均成交额超百亿，北交所迎来流动性+估值的双重修复。第四季度北证 50 涨幅高达 33.46%，带动新三板跟随有一波小反弹，第四季度三板做市指数涨 2.7%、三板成指涨 2.32%。

本基金坚持在北交所及新三板中配置较高比重仓位，主要投资在信息技术、先进制造业、养老等领域。

报告期内，本基金份额净值增长率为 22.16%。

6.4 报告期内对宏观经济及其行业走势展望

中央金融工作会议与经济工作会议强调，围绕高质量发展目标，加快建设金融强国，把更多金融资源用于促进科技创新、先进制造、绿色发展和中小微企业，做好科技金融、绿色金融、普惠金融、养老金融、数字金融五篇大文章。2024 年要加大宏观调控力度，稳中求进、以进促稳、先立后破，多出有利于稳预期、稳增长、稳就业的政策，推动 2024 年经济恢复。

2024 年国内经济或曲折式修复。国内消费需求表现偏弱，背后为长周期性问题的。外需源于全球经济弱复苏也难明显改善。内需疲弱又抑制制造业企业生产意愿，2024 年整体修复弹性有限。地产问题化解需要比较长时间，其投资将逐步回归至合理水平。美联储加息周期或已终止，中美合作逐步走向改善，海外环境边际回暖。A 股市场结构性机会将增多。

深化新三板改革，高质量发展北京证券交易所，打造服务创新型中小企业主阵地，是建设中国特色现代资本市场的重要任务。北交所承担促进科技创新、支持中小企业发展、贯彻普惠金融等方面的重要使命和责任，下一步，北交所将加强对专精特新企业，新科技、新赛道等领域企业的支持；积极推进公募、私募以及各类中长期资金入市，推动更多地方设立专项基金参与市场建设，不断壮大投资者群体、优化投资者结构、丰富市场资金来源，加快推进北交所做市商扩容，更好发挥改善估值定价、提升流动性的功能。

北交所改革的持续推进，必将提升北交所整体估值水平，并带动新三板的良性发展，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。

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 6,820,874.04 元，净资产为 6,820,067.16 元，本基金总资产与净资产的比例为 100.01%。

报告期内本基金无运用杠杆的情况。

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

