



# 东源嘉盈成长2号私募证券投资基金

## 2024年2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(%) | 业绩比较基准收益率标准差(%) |
|------------|----------|-------------|--------------|-----------------|
| 当季         | 2.23     | -           | -            | -               |
| 自基金合同生效起至今 | 19.30    | -           | -            | -               |

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      | 2024-04-01 | 至 | 2024-06-30 | (元)          |
|---------|------------|---|------------|--------------|
| 本期已实现收益 |            |   |            | -856,460.96  |
| 本期利润    |            |   |            | 133,983.08   |
| 期末基金净资产 |            |   |            | 6,148,838.19 |

|           |       |
|-----------|-------|
| 报告期期末单位净值 | 1.193 |
|-----------|-------|

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<br>人民币    |
| 1      | 银行存款              | 124.95       |
| 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         | 821,522.00   |
| 7      | 结算备付金             | 492.96       |
| 8      | 存出保证金             | 0.00         |
| 9      | 股票投资              | 5,313,456.00 |
| 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          | 14,000.11    |
| 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<br>(%) |
|----|----------------------|--------------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业             | 0.00         | 0.00             |
| B  | 采矿业                  | 0.00         | 0.00             |
| C  | 制造业                  | 3,753,906.00 | 61.05            |
| D  | 电力、热力、燃气及水<br>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<br>业      | 63,900.00    | 1.04             |
| H  | 住宿和餐饮业               | 0.00         | 0.00             |
| I  | 信息传输、软件和信息<br>技术服务业  | 0.00         | 0.00             |
| J  | 金融业                  | 2,040,280.00 | 33.18            |
| K  | 房地产业                 | 0.00         | 0.00             |
| L  | 租赁和商务服务业             | 276,892.00   | 4.50             |
| M  | 科学研究和技术服务<br>业       | 0.00         | 0.00             |
| N  | 水利、环境和公共设施<br>管理业    | 0.00         | 0.00             |
| O  | 居民服务、修理和其他<br>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 | 6,134,978.00 | 99.77 |

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：

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。

2024年上半年，面对错综复杂的外部环境，中国加大宏观调控力度，加快发展新质生产力，结构不断升级，经济总体上呈现弱复苏的态势，一季度GDP同比增长5.3%，预计二季度GDP同比增长5.1%左右，上半年增长5.2%左右。社会消费低于预期、地产销售相对低迷、人民币汇率承压、新“国九条”规范资本市场高质量发展等因素影响A股走势，市场呈现大小盘分化，大盘股表现相对稳定，小盘股表现较差，分红比例、股息率较高的股票表现较好。上半年上证综指跌0.25%，深证成指跌7.1%，创业板指跌10.99%，科创50指数跌16.42%。其中，第二季度上证综指跌2.43%，深证成指跌5.87%，创业板指跌7.41%，科创50指数跌6.64%。

新三板及北交所市场表现继续弱于A股，A股市场交易逐渐萎缩，流动性差的新三板及北交所交易显得更为清淡，特别是新“国九条”及私募新规等措施的出台，加快一些不规范基金产品的清理，新三板及北交所的股票普遍承受着单边抛售的压力，相关指数延续走弱态势。上半年北证50跌34.52%，三板做市指数跌17.18%、三板成指跌12.2%。其中，第二季度北证50跌17.27%，三板做市指数跌10.44%、三板成指跌7.42%。

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、文创、新能源、养老等领域。

报告期内，本基金份额净值增长率为2.23%。净值略涨的主要原因是顺势进行了品种调整。

### 6.4 报告期内对宏观经济及其行业走势展望

今年以来，国家着力推动高质量发展，加大宏观调控力度，加快发展新质生产力，经济运行总体平稳、结构不断升级。虽然当前仍面临不少困难挑战，但政策效应在持续显现，市场积极因素在集聚增多。即将召开的三中全会有望推进中长期改革；新“国九条”后，货币政策新框架出炉，央行公告国债借入操作，证监会出台科创板8条改革新规，创投17条鼓励“耐心资本”；房地产市场宽松力度有所加码，继“5·17”房地产政策之后，存量商品房收储在县级以上城市推开、多地首套房首付比例下降，自然资源部拟出台政策支持地方收回、收购闲置土地。多重政策发力，有望促进经济健康发展，也有助于A股市场投资者信心回稳。中报业绩即将陆续披露，A股中业绩好于市场预期的板块和个股有望有较好表现。

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。北交所已对照新“国九条”政策文件，就公开发行并上市、重大资产重组、股份减持、分红、退市等制度安排等六个方面修订相应配套业务规则，强化监管规范IPO上市，加大分红、退市力度。这些新规将吸引更多优质企业，加速板块高质量扩容。也将吸引更多类型活跃增量资金，逐步提升板块流动性。北交所作为成长性专精特新小巨人估值洼地，板块中小市值、低估值高成长、高股息持续分红的标的配置性价比将逐步凸显，有望吸引增量配置资金，逐步修复估值差。

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 6,149,596.02 元，净资产为 6,148,838.19 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