

东源嘉盈新三板1号私募证券投资基金2024年2季度信息披露报告



1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	东源嘉盈新三板1号私募证券投资基金
基金编号	SS4659
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)	国信证券股份有限公司
投资顾问(如有)	
基金运作方式	
基金成立日期	2017-05-24
期末基金总份额(万份)/ 期末基金实缴总额(万元)	636.805300
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)	
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

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	-11.51			
自基金合同 生效起至今	-33.70			

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

3、主要财务指标

单位:元

项目	2024-04-01 至 2024-06-30
本期已实现收益	-86,401.62
本期利润	-549,237.48
期末基金净资产	4,221,792.21
报告期期末单位净值	0.6630

4、投资组合情况

4.1 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	3,222.90
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	3,243,255.00
境内证券投资规模	结算备付金	
	存出保证金	1,000.04
	股票投资	975,040.00
	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	

4.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合(注：不包括港股通数据)

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	2,411,246.00	57.11
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	63,900.00	1.51
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	724,896.00	17.17
J	金融业	722,101.00	17.10
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	296,152.00	7.01
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	4,218,295.00	99.92

4.2.2 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 (%)
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



行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
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
合计	0.00	0.00

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》

5、基金份额变动情况

单位：万份

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

6、管理人报告（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）

1. 基金运作合规守信情况：

本报告期内，本基金管理人严格遵守《私募投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、基金合同等规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

2. 基金运作情况和运用杠杆情况：

截止报告期末,本基金资产总值为 4222517.94 元,净资产为 4221792.21 元,本基金总资产与净资产的比例为 100.02%。

报告期内本基金无运用杠杆的情况。

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。

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、新能源、养老等领域。

报告期内,本基金份额净值增长率为-11.51%。净值跌幅大的主要原因是仓位重且流动性差,主要标的走势弱。

4. 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望:

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。也将会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。

5. 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。

本基金第三方综合服务基金为财信证券股份有限公司,外包机构为国信证券股份有限公司。

6. 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。

7. 会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项:

无

8. 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。

9. 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问题,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: 0755-82787773

信息披露报告是否经托管机构复核: 是