

东源嘉盈 2 号证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

1、基金基本情况

| 项目 | 信息 |
|------------|--|
| 基金名称 | 东源嘉盈 2 号证券投资基金 |
| 基金编号 | SK7225 |
| 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） | 无 |
| 基金运作方式 | 契约型私募基金 |
| 基金合同生效日期 | 2016 年 8 月 3 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 11,000,000.00 |
| 投资目标 | 在控制风险的前提下，努力实现基金资产的稳定增值。 |
| 投资策略 | 采用多层次的投资策略，包括：资产类别配置策略、行业配置策略、个股配置策略等。 |
| 业绩比较基准（如有） | 无 |
| 风险收益特征 | 高风险高收益 |

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） |
|------------|--------|--------------|---------------|------------------|
| 当季 | -1.17% | | | |
| 自基金合同生效起至今 | -1.44% | | | |

3、主要财务指标

单位：元

| 项目 | 2016-10-01 至 2016-12-31 |
|----------|-------------------------|
| 本期已实现收益 | -189,065.02 |
| 本期利润 | -128,599.84 |
| 期末基金资产净值 | 10,841,437.75 |
| 期末基金份额净值 | 0.9856 |

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（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|---------|--------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 3,410,780.00 | 31.32 |
| | 其中：普通股 | 3,410,780.00 | 31.32 |
| | 存托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 7,468,394.14 | 68.59 |
| | 其中：货币基金 | 7,468,394.14 | 68.59 |



| 序号 | 项目 | 金额 (元) | 占基金总资产的 比例 (%) |
|-----|-------------------|---------------|-------------------|
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中：远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 527.99 | - |
| ... | 其他资产组合 | 9,438.93 | 0.09 |
| | 合计 | 10,889,141.06 | 100.00 |

4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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 | - | - |
| B | 采矿业 | 601,200.00 | 5.55 |
| C | 制造业 | 1,419,160.00 | 13.09 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 771,270.00 | 7.11 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 615,150.00 | 5.67 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 4,000.00 | 0.04 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,410,780.00 | 31.46 |

