

东源嘉盈新三板1号私募证券投资基金 2020年第3季度报告

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)	无
投资顾问(如有)	
基金运作方式	定期开放
基金合同生效日期	2017-05-24
报告期末基金份额总额(份)	6,368,053
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

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	-10.78			
自基金合同生效起至今	-17.56			

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	2020-07-01 至 2020-09-30
本期已实现收益	282,909.85
本期利润	-604,227.36
期末基金资产净值	5,249,886.34
期末基金份额净值	0.8244

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)	占基金总资产的 比例 (%)
1	权益投资	5,248,130.00	99.47
	其中：普通股	5,248,130.00	99.47
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	0.00	0.00
3	固定收益投资	0.00	0.00
	其中：债券	0.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00
4	金融衍生品投资	0.00	0.00
	其中：远期	0.00	0.00
	期货	0.00	0.00
	期权	0.00	0.00
	权证	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
6	货币市场工具	0.00	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	27,999.75	0.53
8	其他	2.30	0.00
	合计	5,276,132.05	100.00

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	2,981,110.00	56.78
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	182,000.00	3.47
G	交通运输、仓储和邮政业	301,600.00	5.74

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	1,783,420.00	33.97
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	0.00	0.00
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	5,248,130.00	99.97

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
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：份

报告期期初基金份额总额	7,349,527.67
报告期期间基金总申购份额	0.00
减：报告期期间基金总赎回份额	981,474.67
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
报告期期末基金份额总额	6,368,053.00

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）

截止本季度末，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30期，均已在中国证券投资基金业协会备案。

基金经理概况：

刘推进先生，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，25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，28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。

2020年第3季度国内GDP同比增长4.9%，前三季度同比增长0.7%，中国率先在全球疫情反复情况下实现经济正增长，国内经济已基本恢复至正常状态，但海外疫情仍未受控，全球经济复苏仍然缓慢。

A股市场经历从7月中上旬的情绪高涨到之后的缩量调整过程，第三季度，上证综指涨7.82%，深证成指涨7.63%，中小板指涨8.19%，创业板指涨5.60%。

新三板市场方面，新三板精选层在7月27日正式挂牌开市，首批32家公司股价基本高开低走，之后交易日的股价走势也是缩量下移，大多公司长期处于破发状态、成交低迷，精选层市场表现远远低于市场预期。短期看，精选层的推出改善了融资便利性，但并未对流动性难题有任何实质性改变和影响，期待的新三板优质企业绽放的时代并未来临。由于精选层表现不佳，导致转层类概念股票普遍下挫调整，第三季度，三板做市指数下跌4.01%，三板成指微涨1.46%。

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医药、先进制造业、信息技术、消费等领域。由于配置的品种中做市类或转层类股票偏多，本基金单季净值表现弱于三板指数。

报告期内，本基金份额净值增长率为-10.78%。

4、管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

第四季度，国内经济将继续保持恢复增长的态势，即便国际经济与政治局势面临不确定性，但中国已逐步构建以国内大循环为主体、国内国际双循环相互促进的新发展格局，我国超大规模市场和内需潜力将稳定中国经济的基本盘。

A股市场方面，注册制改革有望加快推进，转板制度也将在创业板、科创板落地，市场将迎来大扩容和鼓励科技创新的时代，上市公司质量将进一步提升，配套制度也将更加完备。在“坚持市场化、法治化方向，建设规范、透明、开放、有活力、有韧性的资本市场”目标下，来市场参与主体责任将更加清晰、监管将趋严、处罚将加重，市场也有望更趋理性。

新三板市场改革将继续推进，改善流动性的措施还将陆续推出。精选层混合交易制度即将落地；存量公募基金投资新三板将更加便利；QFII与RQFII自11月1日起可以投资新三板等等；精选层的流动性将实质性改善。交易所正在加紧制定转板制度，精选层转板有望在2021年实现。转板制度将带动新三板相关股票活跃，精选层中转板类个股将焕发出全新的活力！

本基金将保持在创新型、成长型类股票中的配置并增加精选层股票的配置。

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信用、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

本基金本报告期初基金累计单位净值 0.9240 元,本报告期末基金累计单位净值 0.8244 元,本报告期内基金单位净值增长率为-10.78%。

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

报告是否经托管机构复核: