

东源嘉盈棱镜优选 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	东源嘉盈棱镜优选 1 号私募证券投资基金
基金编号	SLK210
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	开放式
基金合同生效日期	2020-07-23
报告期末基金份额总额 (份)	14,315,561.75
投资目标	在控制风险的前提下, 追求本基金财产的增值。
投资策略	股票策略
业绩比较基准 (如有)	
风险收益特征	募集机构根据相关规则和本基金实际情况判定, 本基金属于 [R4] 级投资品种, 适合风险承受能力为 [C4] 型及以上的合格投资者。

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	-0.90			
自基金合同生效起至今	-0.90			

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	2020-07-23 至 2020-09-30
本期已实现收益	-197,583.98
本期利润	-296,839.72
期末基金资产净值	14,183,160.28

期末基金份额净值	0.991
----------	-------

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	1,058,259.98	7.44
	其中：普通股	1,058,259.98	7.44
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	868,367.90	6.11
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	279,847.66	1.97
8	其他	12,013,118.03	84.48
	合计	14,219,593.57	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	996,829.00	7.03
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	0.00	0.00
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	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	996,829.00	7.03

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	61,430.98	0.43
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	61,430.98	0.43

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	5,180,000.00
报告期期间基金总申购份额	9,135,561.75
减：报告期期间基金总赎回份额	0.00
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	14,315,561.75

6、管理人报告

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：包涵先生，CPA、CIIA，北京理工大学硕士，5 年证券投资经历，2 年智能装备系统研发经验。

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

2020 年第 3 季度国内经济继续从疫情的巨大冲击中恢复，GDP 同比增长 4.9%，前三季度同比增长 0.7%。供给端看，工业生产已逐步恢复正常，9 月工业增加值同比增长 6.9%；需求端看，固定资产投资完成额累计同比转正，1-9 月累计同比增长 0.8%；出口方面，9 月 PMI 新出口订单数据连续 5 个月反弹，以美元计，出口同比增 9.9 个百分点，较 8 月提高 0.4 个百分点。但在海外疫情出现反复的情况下，订单回流和需求减速共同作用下未来出口情况仍存不确定性；消费方面，9 月社会消费品零售总额同比增长 3.3%，较 8 月提高 2.8 个百分点，居民消费取决于其对未来收入的预期，恢复程度可能仍然慢于生产端。

证券市场方面，A股从7月中上旬的情绪高涨到后面的缩量调整，一个典型的疯牛到震荡的历程被压缩在短短的一个季度之内。机构抱团股顽强抵抗，大市值的低估值股票只要略有表现就会带来牛市的假象，而目前的宏观经济情况又不支持此类股票持续表现，最终结果就是市场大幅震荡，而抱团现象没有根本性的改变。整个第三季度，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%。

本基金主要采用组合基金的方式进行投资，并采用衍生品进行一定的风险对冲。在标的基金的选择上，主要关注标的基金经理的长期业绩表现和主要投资方向。

报告期内，本基金份额净值增长率为-0.9%。

4、 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望第四季度，恢复常态仍然是国内经济的基本趋势。尽管面临内外部多种不确定性，但中国经济的韧性仍然较强。老基建托底，新基建布局未来，消费逐步复苏，在疫情防控工作越发科学合理的情况下，国内经济出现重大风险的可能性不大。

在经历了三季度的极端走势后，选择在消费、医疗、科技行业继续抱团还是转而投向周期行业仍然是大家面临的选择题。所以市场在这两个方向摇摆可能会是四季度的一个常态。在美国大选结果最终出炉之前，对岸的小动作可能会给市场带来一定的冲击，但这可能都是暂时的影响，大选结果才是判断未来市场走势的关键。是现任总统连任还是新人上台，其对华政策以及我们的应对方法都将会影响市场的走势和投资方向。

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

管理人于每个估值核对日的次工作日计算估值核对日的基金资产净值、基金份额净值并以传真方式或其他管理人和托管人认可的方式发送给托管人。托管人对净值计算结果复核后盖章并以传真方式或其他管理人和托管人认可的方式传送给管理人。

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。

本基金外包服务和托管方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

本基金主要采用组合基金的方式进行投资，并采用衍生品进行一定的风险对冲。在标的基金的选择上，主要关注标的基金经理的长期业绩表现和主要投资方向。报告期内本基金整体运行平稳，季度份额净值增长率为-0.9%。本基金将继续选择国内表现优秀且投资方向符合中国长期发展方向的私募及公募投资基金，在控制回撤的基础上，争取做到客户利益的最大化。

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. 《东源嘉盈棱镜优选1号私募证券投资基金基金合同》
3. 《金融服务外包操作备忘录》
4. 《运营外包服务总协议》
5. 基金管理人业务资格批件和营业执照
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照

存放地点：

基金管理人处、基金托管人处

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：0755-82785505

报告是否经托管机构复核：是

六
五
五
五