

东源嘉盈谦和 1 号私募证券投资基金 2021 年年度报告

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	东源嘉盈谦和 1 号私募证券投资基金	
基金编码	SSE410	
基金运作方式	开放式	
基金成立日期	2021 年 8 月 20 日	
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）	中信证券股份有限公司	
投资顾问（如有）		
期末基金总份额（万份）/ 期末基金实缴总额（万元）	233.96672	
基金到期日期	2031 年 8 月 19 日	

1.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，实现基金资产的稳健增长。
投资策略	本基金将根据宏观经济分析和整体市场各类资产价格变化情况，以资产配置策略为核心驱动，为投资者提供风险收益特征稳定持续的长期复利绝对收益。
业绩比较基准（如有）	无
风险收益特征	本基金属于 R4 风险等级的投资品种，适合风险识别、评估、承受能力为 C5, C4 的合格投资者。

1.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		深圳市东源嘉盈资产管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	伍晓敏	杨军智
	联系电话	18820041696	95548-3
	电子邮箱	wuxm@dongyuanjy.com	cust_serv@citics.com
传真		0755-82787773	010-60834004
注册地址		深圳市福田区香梅路中投国际商务中心 A 栋 13 层 C 单元	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址		深圳市福田区香梅路中投国际商务中心 A 栋 13 层 C 单元	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦
邮政编码		518000	100026

法定代表人	杨凡	张佑君
-------	----	-----

1.4 信息披露方式

基金管理人应当至少采用下列一种或多种方式向基金份额持有人提供报告或进行相关通知。

1、传真、电子邮件或短信 如基金份额持有人留有传真号、电子邮箱或手机号等联系方式，基金管理人可通过传真、电子邮件或短信等方式将报告信息告知基金份额持有人。2、邮寄服务 基金管理人可向基金份额持有人邮寄年度报告等有关本基金的信息。基金份额持有人在销售机构留存的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，基金份额持有人应当及时以书面方式或以基金管理人规定的其他方式通知基金管理人。3、基金管理人网站 基金管理人通过基金管理人网站向基金份额持有人提供报告和信息查询，内容包括净值报告等。

1.5 其他相关资料（如有）

项目	名称	办公地址
会计师事务所		
注册登记机构	中信中证投资服务有限责任公司	深圳市福田区中心三路8号 中信证券大厦21楼
外包机构	中信中证投资服务有限责任公司	深圳市福田区中心三路8号 中信证券大厦21楼

2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：元

期间数据和指标	2021年	2020年	2019年
本期已实现收益	-41,855.22	0.00	0.00
本期利润	-44,111.73	0.00	0.00
期末数据和指标	2021年末	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	-46,308.44	0.00	0.00
期末可供分配基金份额利润	-0.0198	0.0000	0.0000
期末基金净资产	2,295,888.27	0.00	0.00
报告期期末单位净值	0.9813	0.0000	0.0000
累计期末指标	2021年末	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率(%)	-1.87	0	0

备注：

√无分级 □二级 □三级

2.2 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(%)
当年	-1.87			
自基金合同 生效起至今	-1.87			

备注:

2.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位: 元

年度	每份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021	0.0000	0.00	0.00	0.00	

备注:

3、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	210
报告期期间基金总申购份额	23.985609
减: 报告期期间基金总赎回份额	0.018889
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	0
期末基金总份额 (万份) / 期末基金实缴总额 (万元)	233.96672

备注:

4、管理人说明的其他情况

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32期, 均已在中国基金业协会备案。

基金经理概况: 廖克宁先生, 14年金融行业从业及投资经验, 曾供职于国内知名保险、证券、期货和私募基金公司, 对各类金融产品理解透彻并有丰富的实战经验。10年香港、美国境外市场及衍生品交易经验, 对海内外宏观变化影响有敏锐的触觉, 并及时作出相应投资决策。熟悉各类投资策略, 对基金公司投研团队及基金经理洞若观火, 有成熟且严谨的价值评述体系。

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

2021年尽管散发的疫情不时扰动经济, 但作为全球疫情控制最好的国家, 我国经济在强劲出口带动下仍然呈现出了较强的韧性, 全年GDP增速8.1%, 两年复合增速5.1%。分季度来看, 由于基数作用, GDP增速呈现出了前高后低、逐级放缓的态势。

证券市场, A股方面, 全年上证综指涨4.8%, 深证成指涨2.67%, 创业板指涨12.02%。

结构上看,2021年市场的分化程度甚至要超过2020年,新能源(锂电、光伏、风电)相关产业链股票涨势较好,其他行业类股票表现一般。港股方面,政策对新经济类企业的冲击较大,导致港股整体表现低迷,投资者的风险偏好较低。全年恒生指数跌14.08%,恒生国企指数跌23.3%。

本基金的投资方向为业绩稳定向好、符合国内经济发展大方向的国内股票、港股通标的及证监会允许的金融衍生品。具体操作上,本基金采取较为灵活的操作策略,根据市场变化,适时主动调整仓位及持仓品种,报告期内,本基金份额净值增长率为-1.87%。

4、管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济方面,疫情的影响尚未完全消除,尽管整体风险可控,但仍面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力,突出表现在需求弱于供给、内需弱于外需,服务业弱于工业。这就需要决策部门加大跨周期调节力度,并与逆周期调节相结合来进行应对。国际经济方面,2020年疫情之后的大量货币投放导致通胀高企,主要经济体加息和回收流动性的频率和速度是全年最值得关注的的事件。此外,俄乌冲突导致的能源和粮食供应问题可能使由于疫情冲击本就脆弱的全球供应体系更加雪上加霜。

A股方面,年初至今的市场走势使得投资者对全面的收益率预期较低。我们预计今年仍将是结构化行情,但领涨的行业会与前面几年不太相同。在本轮疫情完全得到控制后,受益于强刺激政策推出的行业将会成为市场主要的进攻方向。港股方面,尽管经历了很大幅度的调整(估值降低),但新经济类公司股价是否完全触底仍有不确定性,政策风险在这个周期内会一直存在(业绩下降)。我们看好并投资的低估值、高股息率的和中国经济发展高度相关的公司的表现可能会好于市场整体。

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测: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中信中证投资服务有限公司,托管人为中信证券股份有限公司

司。

7、基金运作情况和运用杠杆情况

本基金采取较为灵活的操作策略，根据市场变化，适时主动调整仓位及持仓品种。报告期内本基金整体运行平稳，年度份额净值增长率为-1.87%。本基金将继续采用多层次的投资策略，在控制回撤的基础上，争取做到客户利益的最大化。

报告期内本基金适度运用杠杆。

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. 《东源嘉盈谦和1号私募证券投资基金基金合同》
3. 《私募基金行政管理服务协议》
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照
5. 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

5、 托管人报告（如有）

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期，基金托管人在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，在本基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现本基金的管理人损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由本基金管理人编制并经托管人复核审查的有关本基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6、年度财务报表

金额单位：元

6.1 资产负债表

资产	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末
资产：		
银行存款	164.46	
结算备付金	434,868.64	
存出保证金	0.00	
交易性金融资产	1,857,040.82	
其中：股票投资	1,857,040.82	
基金投资	0.00	
债券投资	0.00	
资产支持证券投资	0.00	
贵金属投资	0.00	
衍生金融资产	8,700.00	
买入返售金融资产	0.00	
应收证券清算款	0.00	
应收利息	54.34	
应收股利	0.00	
应收申购款	0.00	
递延所得税资产	0.00	
其他资产	0.00	
资产总计	2,300,828.26	
负债和所有者权益	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末
负债：		
短期借款	0.00	
交易性金融负债	0.00	
衍生金融负债	0.00	
卖出回购金融资产款	0.00	
应付证券清算款	0.00	
应付赎回款	0.00	
应付管理人报酬	4,497.26	
应付托管费	218.98	
应付销售服务费	0.00	
应付交易费用	0.00	
应交税费	4.77	
应付利息	0.00	
应付利润	0.00	
递延所得税负债	0.00	
其他负债	218.98	
负债合计	4,939.99	
所有者权益：		

实收基金	2,339,667.20
未分配利润	-43,778.93
所有者权益合计	2,295,888.27
负债和所有者权益总计	2,300,828.26

备注：

6.2 利润表

项目	本期	上年度可比期间
	2021年8月20日至 2021年12月31日	至
一、收入	-31,666.53	
1. 利息收入	4,595.34	
其中：存款利息收入	1,045.47	
债券利息收入	0.00	
资产支持证券利息收入	0.00	
买入返售金融资产收入	3,634.22	
其他利息收入	-84.35	
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-33,483.34	
其中：股票投资收益	-40,429.64	
基金投资收益	-338.06	
债券投资收益	0.00	
资产支持证券投资收益	0.00	
贵金属投资收益	0.00	
衍生工具收益	6,789.36	
股利收益	495.00	
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”填列）	-2,256.51	
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	0.00	
5. 其他收入（损失以“-”填列）	-522.02	
减：二、费用	12,445.20	
1. 管理人报酬	6,384.49	
其中：固定管理费	6,195.49	
业绩报酬	189.00	
2. 托管费	313.26	
3. 销售服务费	0.00	
4. 外包服务费	313.26	
5. 交易费用	4,912.09	
6. 利息支出	46.74	
其中：卖出回购金融资产支出	0.00	
7. 其他费用	475.36	
三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）	-44,111.73	
减：所得税费用	0.00	

四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	-44,111.73
-----------------------	------------

备注:

6.3 所有者权益变动表

项目	本期 2021年8月20日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,100,000.00	0.00	2,100,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0.00	-44,111.73	-44,111.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	239,667.20	332.80	240,000.00
其中: 1. 基金申购款	239,856.09	143.91	240,000.00
2. 基金赎回款	-188.89	188.89	0.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	2,339,667.20	-43,778.93	2,295,888.27
项目	上年度可比期间 至		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款			
2. 基金赎回款			
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)			

备注:

7、 期末投资组合情况

7.1 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	164.46
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	209,555
境内证券投资规模	结算备付金	434,868.64
	存出保证金	
	股票投资	1,647,485.82
	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	应收利息#54.34;
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	

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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 (%)
A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	1,355,456.00	59.05
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	239,215.00	10.42
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	37,956.00	1.65
M	科学研究和技术服务业	131,663.00	5.73
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	1,764,290.00	76.85

备注：

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合（如有）

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例 (%)
信息技术	0.00	0.00
公用事业	0.00	0.00
医疗保健	0.00	0.00
基础材料	0.00	0.00
工业	0.00	0.00

房地产	0.00	0.00
消费者常用品	0.00	0.00
消费者非必需品	92,750.82	4.04
电信服务	0.00	0.00
能源	0.00	0.00
金融	0.00	0.00
合计	92,750.82	4.04
备注:		

8、信息披露报告

信息披露报告是否经托管机构复核：是

托管人复核说明：本基金托管人按照相关法律法规、基金合同的规定，对本基金在本报告中的财务数据进行了复核。对按照规定应由托管人复核的数据，托管人无异议。

