

# 私募投资基金信息披露季度报表

(2022-04-01 至 2022-06-30)

## 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	
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)	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	-3.54			
自基金合同 生效起至今	3.88			

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	2022-04-01 至 2022-06-30
本期已实现收益	90,785.4
本期利润	-243,022.52
期末基金净资产	6,615,008.45

报告期期末单位净值	1.0388
-----------	--------

#### 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	182.83 元
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	5,928,961.06 元
境内证券投资规模	结算备付金	
	存出保证金	117,918.85 元
	股票投资	607,384.00 元
	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	3,298,999.00	49.87
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	77,200.00	1.17
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	2,003,384.00	30.29
J	金融业	117,720.00	1.78
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	1,039,042.06	15.71
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	6,536,345.06	98.81

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

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
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：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. 截止本季度末，本产品持有以下长期停牌股票：[430208][优炫软件]；[834496][赛乐奇]  
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)]；

2. 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。

3. 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 6,615,008.45 元，净资产为 6,615,008.45 元，本基金总资产与净资产的比例为 100%

4) 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。

2022 年二季度俄乌冲突继续，美联储启动加息进程，全球经济走向“滞胀”的风险提升。中国本土疫情防控压力骤增，一度上海等地疫情对经济冲击明显，稳增长成为政策主基调，后随着国内疫情开始逐步控制，各项宏观经济政策也逐步发力，国内经济下行压力得到缓解。

二季度 A 股市场先抑后扬，4 月上海新冠疫情扩散并最终封城，致使市场悲观情绪再起，A 股市场继续下行，5 月起，虽然海外美股继续下跌，但 A 股却走出独立行情，主要是随着稳增长政策不断加码、疫情本身和复工复产边际向好，市场信心逐步恢复。第二季度，上证综指上涨 4.5%，深证成指上涨 6.42%，创业板指数上涨 5.68%，科创 50 指数上涨 1.34%。

二季度北交所与新三板市场整体继续下挫调整，受流动性不足及个股质地参差不齐影响，北交所个股平均下跌幅度超过 8%；新三板创新层与基础层成交普遍依然低迷，个股基本下跌调整，只是调整幅度较北交所小。第二季度，三板做市指数下跌 4.86%、三板成指下跌 6.78%。

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、消费等领域。

报告期内，本基金份额净值增长率为-3.54%。

5) 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，宏观经济方面，国内稳增长政策持续发力下，经济增速较二季度将显著改善。货币政策方面，美元处于加息缩表的收缩趋势中，国内继续宽松，“外紧内松，以我为主”是主基调。

A 股方面，在稳增长预期下，下半年 A 股有望延续结构性上涨行情，不过，“内忧外患”并未完全消除，中报业绩分化、科创板解禁高峰、疫情波动及外部经济衰退担忧等因素仍将影响行情演变的方向。

新三板迎来与北交所一体发展的历史性机遇期。虽然新三板暂又陷入流动性不足的低迷状态，但由于新三板的包容性更强，且北交所为更多中小企业打开方便上市之门，新三板开始吸引更多的中小企业（包括已摘牌的企业）前来挂牌；北交所审核进程趋于常态，越来越多的创新层公司将于北交所上市；北交所、创业板、科创板竞争将良性展开，北交所服务创新型中小企业及重点发展“专精特新”中小企业、创业板集中服务于成长型创新创业企业、科创板集中服务于科技创新企业，它们之间会有交集竞争，更多将是错位良性竞争。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将成市场热点。

本基金将保持在创新型、成长型类股票中的配置。

#### 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

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

信息披露报告是否经托管机构复核：否