

# 私募投资基金信息披露季度报表

(2023-04-01 至 2023-06-30)

## 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	开放式
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)	
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	10.62			
自基金合同 生效起至今	-5.62			

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

项目	单位:元	
	2023-04-01 至 2023-06-30	
本期已实现收益	54,649.97	
本期利润	577,186.09	
期末基金净资产	6,010,446.48	

报告期期末单位净值	0.9438
-----------	--------

#### 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	171.76 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	4,762,334.01 元
境内证券投资规模	结算备付金	
	存出保证金	71,046.93 元
	股票投资	1,200,780.00 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	3,163,754.00	52.64
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	69,500.00	1.16
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	2,122,500.01	35.31
J	金融业	483,720.00	8.05
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	123,640.00	2.06
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	5,963,114.01	99.21

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

1. 截止本季度末，本产品持有以下长期停牌股票：[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6034332.7元,净资产为6010446.48元,本基金总资产与净资产的比例为100.4%。

报告期内本基金无运用杠杆的情况。

#### 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。

2023年二季度,伴随上市公司一季报不及预期,市场对经济复苏担忧加重,A股市场面临经济、政策和情绪的三重谷底,虽然中央政治局会议短暂提振股市,但一系列经济数据不及预期,人民币贬值压力加大,A股主要指数承压。第二季度上证综指跌2.16%,深证成指跌5.97%,创业板指跌7.69%,科创50指数跌7.06%。一季度走强的AI板块整体走弱。

经济复苏低于预期也拖累新三板及北交所市场表现,且新三板市场流动性困境尚未摆脱,成交依旧低迷,北交所的交易亦不活跃,致第二季度三板做市指数跌3.05%、三板成指跌2.47%,北证50跌6.95%。

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10.62%。

#### 5. 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望:

4月28日,中共中央政治局会议强调,恢复和扩大需求是当前经济持续回升向好的关键所在。积极的财政政策要加力提效,稳健的货币政策要精准有力,形成扩大需求的合力。要发挥好政府投资和政策激励的引导作用,积极发挥政策合力恢复和扩大需求,为经济运行持续好转注入更大动力,有效推动经济实现质的有效提升和量的合理增长。展望下半年,虽然面临全球地缘因素扰动及通胀反复风险,中国宏观经济仍有望开启经济复苏的第二阶段,为恢复性增长迈向扩张性增长奠定良好基础,并推进现代化产业体系建设。

下半年,国内政策组合预计在7月末的中央政治局会议前后出台,此后还会有面向深层次改革的全国金融工作会议和二十届三中全会。伴随政策组合出台、市场预期修复、企业盈利改善,预计在内外部不明朗因素逐步消除后,A股市场情绪有望提升,市场波动性将有所降低,市场表现稳中向好。

北交所与新三板将在“高质量发展”、“支持实体经济”与“加快建设现代化产业体系”中发挥重要作用,因为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,新三板为培育“专精特新”中小企业的基地。北交所计划不断加大改革力度,聚焦高质量扩容、流动性提升等市场建设中心任务,研究推进市场关键制度创新。一是优化企业上市机制。完善发行上市准入安排,降低企业上市成本,让优质创新型中小企业更好更快对接北交所上市。二是完善市场交易机制。推进交易机制创新,研究扩大混合做市、融资融券业务规模,充分发挥制度功能;不断优化投资者结构,扩充投资者数量,提升交易效率、促进交易达成。三是优化发行承销制度。相应新三板的改革措施将同步推进。6月29日,“北+H”上市模式安排落地,此举有望推动北交所流动性水平的提升。

改革的推进将为北交所市场引入更多投资长期资金,提高市场流动性,营造有利于科技型中小微企业成长的良好环境,也必将吸引更多的资金关注北交所及新三板中的优质企业。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有望持续成市场热点。

#### 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。

本基金第三方综合服务基金为财信证券股份有限公司，外包机构为国信证券股份有限公司。

7. 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。

8. 会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项：

无

9. 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。

10. 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问题，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