

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	其他方式
基金成立日期	2020-07-23
期末基金总份额(万份)/ 期末基金实缴总额(万元)	609.197660
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)	无
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	-5.58			
自基金合同 生效起至今	-28.90			

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

项目	单位:元	
	2023-04-01 至 2023-06-30	
本期已实现收益	-376,613.45	
本期利润	-254,382	
期末基金净资产	4,332,421.11	

报告期期末单位净值	0.711
-----------	-------

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	1,204,721.05 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	
境内证券投资规模	结算备付金	169,653.23 元
	存出保证金	82,238.47 元
	股票投资	
	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）	80,697.84 元
	其中：货币基金	80,697.84 元
	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	SSS329#674448.11; SCA348#1023787.07; SJH593#1115040.00;
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	0.00	0.00
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	0.00	0.00

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

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
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：万份
报告期期初基金份额总额	702.048171
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	92.850511
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	609.197660

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、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：

包涵先生，CFA、CPA、CIIA，北京理工大学硕士，8年证券投资经历，2年智能装备系统研发经验。

陈国锋先生，华中科技大学数学、经济学双学士，12年华为技术有限公司工作经验，离职后从事A股、美股以及衍生品投资。

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

二季度国内经济的恢复程度不及预期，特别是五一假期过后，内需和出口都出现了不同程度的困难。面对困难，决策层保持了足够的定力，并没有急于推出强刺激政策，在保证一定增长速度的同时更加注重了结构的调整。根据万得一致预测，第二季度GDP增速在6.8%左右。

二季度的A股在五一假期前后走势迥异。五一假期之前，ChatGPT概念带领下的TMT行业和“中特估”持续推动A股上行。但假期之后，由于上市公司一季报的不及预期和市场对经济复苏担忧的加重，A股开始了调整，随之而来的就是板块轮动速度的加快。单季上证综指跌2.16%，深证成指跌5.97%，创业板指跌7.69%。

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-5.58%。

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，居民对未来收入增长不确定性的担忧是现阶段扩大内需最大的阻碍，而在强刺激政策尚未推出之际，基建投资更多只是起到托底的作用。因此我们预计第三季度国内经济仍将是温和复苏的态势。国际方面，在前期持续加息影响下发达经济体的通胀基本得到控制，但在较好的就业数据下，停止加息甚至降息的预期开始逆转。如果发达经济体维持高利率的时间较长，那么国内货币政策空间势必会受到压缩。

A股方面，市场目前正面临一定的困境。主要表现为前几年涨幅较好的行业有各自的基本面难题，而人工智能概念股在无强基本面支撑下已经积累了不小的风险。在无明显优势板块的情况下板块之间的轮动速度变得更快。尽管如此，我们也没有必要对未来的市场感到悲观，7月末中央政治局会议前后刺激政策的进一步出台还是值得期待的。

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守信、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及托管人均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。在标的基金的选择上，主要关注标的基金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-5.58%。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

信息披露报告是否经托管机构复核：是

