

私募基金信息披露年度报表



1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	东源嘉盈回馈私募证券投资基金
基金编码	SN3432
基金运作方式	
基金成立日期	2016-12-01
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）	广发证券股份有限公司
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）	1,020.00
基金到期日期	

1.2 基金产品说明

投资目标	在深入研究的基础上构建投资组合，在严格控制投资风险的前提下，力求获得长期稳定的投资回报。
投资策略	采用多层次的投资策略，包括：资产类别配置策略、行业配置策略、个股配置策略等
业绩比较基准（如有）	
风险收益特征	高收益、高风险

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	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	伍晓敏
	联系电话	0755 82787773
	电子邮箱	wuxm@dongyuanjy.com
传真	0755-82785552	020-66336504
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	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室
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	广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 34 楼
邮政编码	518000	510627
法定代表人	杨凡	林传辉

1.4 信息披露方式

基金管理人有权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，传真、电子邮件或短信；邮寄服务；基金管理人网站；其他中国证监会以及基金业协会规定的信息披露途径或方式。

1.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所		
注册登记机构	国金道富投资服务有限公司	上海市浦东新区芳甸路 1088 号紫竹国际大厦 18 楼
外包机构	国金道富投资服务有限公司	上海市浦东新区芳甸路 1088 号紫竹国际大厦 18 楼
其他		

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	2023	2022	2021
本期已实现收益	322,027.68	202,245.99	487,416.35
本期利润	-707,969.74	655,868.00	-53,767.86
期末数据和指标	2023	2022	2021
期末可供分配利润	-244,580.52	181,889.22	-321,558.78
期末可供分配基金份额利润	-0.024	0.012	-0.0176
期末基金净资产	9,955,419.48	15,381,889.22	17,978,441.22
报告期期末单位净值	0.9760	1.0120	0.9824
累计期末指标	2023	2022	2021
基金份额累计净值增长率	-2.40%	1.20%	-1.76%

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率(%)
当年	-3.56	0.00	0.00	0.00
自基金合同生效起至今	-2.40	0.00	0.00	0.00

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
2023	0.00	0.00	0.00	0.00	-
2022	0.00	0.00	0.00	0.00	-
2021	0.00	0.00	0.00	0.00	-

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	1,520.00
报告期期间基金总申购份额	0.00
减：报告期期间基金总赎回份额	500.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
期末基金总份额/期末基金实缴总额	1,020.00

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：

杨凡先生，深圳市东源嘉盈资产管理有限公司董事长兼总经理、投资委员会主席、首席投资官，华中科技大学博士，30余年证券投资经历，曾任银泰证券公司研究部总经理、资产管理部总经理、公司总裁助理。

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

2023年是生产和生活正常化的第一年，尽管面临着有效需求不足和社会预期偏弱等挑战，我国经济仍然取得了令人瞩目的成绩，全年GDP增速为5.2%。在经济运行整体平稳下，各个行业感受到的具体温度却各不相同，投资端拉动经济作用偏弱使很多行业的收入增长都陷入了困境。2023年最令人欣喜事情的就是新技术的爆发，ChatGPT带动下生成式人工智能已经成为了各个国家在新时代科技竞争的主战场。

A股方面，全年可以以五一假期前后分成两个阶段，五一假期之前在“中特估”和AIGC概念引领下市场走出一波不错的行情。但假期之后，投资者的悲观情绪开始影响市场，A股也开始了漫漫的阴跌路。全年上证综指跌3.70%，深证成指跌13.54%，创业板指跌19.41%。港股方面，离岸市场的特性尽显无疑，业务在内地的公司的盈利前景饱受海外投资者质疑，除在年初受放开刺激上涨外，其余时间均维持弱势局面，这种弱势可能要等到国内经济真正企稳后吸引海外资金回流才能得到缓解。全年恒生指数跌13.82%，恒生国企指数跌13.97%，恒生科技指数跌8.83%。

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A股及港股通标的。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，目前港股通股票是我们的主要的投资标的。

报告期内，本基金份额净值增长率为-3.56%。

4、管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

有效需求不足和社会预期偏弱仍然是2024年我国经济发展面临的最主要问题。有效需求不足需要政府进一步加大投资力度，“三大工程”、大规模设备更新和消费品以旧换新应该是其最有力的政策抓手，而只有随着经济形势逐渐好转，社会预期偏弱的问题才能得到改善。我们认为如果决策层不推出更加强劲的刺激政策，2024年我国经济仍然是平稳偏弱的局面。国际方面，美联储降息次数似乎已经确定，但开始时点却一直悬而未决，美联储的接下来的货币政策会直接影响我国的出口需求和货币政策空间，需要我们对此保持深度的追踪。

A股方面，在经历了春节前的大幅波动后，现在的市场又重新恢复到了一个相对平衡的状态。我们认为在宏观经济偏弱的背景下，预计全年市场仍将呈现较强的结构性。因此今年的投资思路仍然要“存量思维”和“增量思维”并重。用“存量思维”选择业绩稳定、低估值、高分红率的股票，用“增量思维”寻找行业景气度改善或受益于重大政策的股票，比如“三大工程”、大规模设备更新和消费品以旧换新相关产业链就值得重点研究。港股方面，传统行业的走势和国内经济形势密切相关，互联网行业则和监管政策的相关性更强，因此2024年的港股仍然要看国内经济的恢复程度和对平台型企业的监管力度的变化。相较于港股整体走势，我们更关注“中国特色估值体系”下的低估值、高股息率类央企的投资机会，其享受的自身估值提升和AH价差缩小两方面的红利仍然是值得期待的。

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守信

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国金道富投资服务有限公司，托管机构为广发证券股份有限公司。

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，季度份额净值增长率为-3.56%。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. 《东源嘉盈回馈私募证券投资基金基金合同》
3. 《东源嘉盈回馈私募证券投资基金之委托服务协议》

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：0755-82787773

5、托管人报告（如有）

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本基金托管人在托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》和相关法律法规的规定，以及基金合同和托管协议（如有）的约定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

报告期内，本基金托管人根据法律法规的规定以及基金合同和托管协议（如有）的约定对基金管理人的投资运作进行了监督，管理人在本基金投资运作过程中遵规守信情况良好。托管人对本基金报告期内的净值计算、利润分配情况进行了复核，未发现基金管理人在上述事项中存在违反基金合同和托管协议（如有）相关约定的行为。

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

本基金托管人依法对年度报告中托管履职期间的财务指标、净值表现、投资组合情况、利润分配情况（如有）、财务会计报告（如有）等财务信息进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6、年度财务报表

金额单位：元

6.1 资产负债表

资产	2023-12-31	2022-12-31
资产：		
银行存款	94.54	131.77
结算备付金	83,921.88	1,840.11
存出保证金	0.00	0.00
交易性金融资产	9,954,500.09	15,402,656.95
其中：股票投资	9,934,298.27	15,382,553.93
基金投资	20,201.82	20,103.02
债券投资	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
贵金属投资	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
递延所得税资产	0.00	0.00

其他资产	0.00	0.00
资产总计	10,038,516.51	15,404,628.83
负债和所有者权益	2023-12-31	2022-12-31
负债：		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	60,164.74	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	19,245.59	19,108.92
应付托管费	1,732.12	1,719.79
应付销售服务费	0.00	0.00
应付交易费用	30.05	0.00
应交税费	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
递延所得税负债	0.00	0.00
其他负债	1,924.53	1,910.90
负债合计	83,097.03	22,739.61
所有者权益：		
实收基金	10,200,000.00	15,200,000.00
未分配利润	-244,580.52	181,889.22
所有者权益合计	9,955,419.48	15,381,889.22
负债和所有者权益总计	10,038,516.51	15,404,628.83

6.2 利润表

项目	本期			上年度可比期间		
	2023-01-01	至	2023-12-31	2022-01-01	至	2022-12-31
一、收入	-591,225.72			775,310.91		
1、利息收入	81.69			125.82		
其中：存款利息收入	81.69			125.82		
债券利息收入	0.00			0.00		
资产支持证券利息收入	0.00			0.00		
买入返售金融资产收入	0.00			0.00		
其他利息收入	0.00			0.00		
2、投资收益（损失以“-”填列）	463,738.26			321,563.08		
其中：股票投资收益	-259,210.01			-562,448.19		
基金投资收益	2.59			7.03		
债券投资收益	0.00			0.00		
资产支持证券投资收益	0.00			0.00		
贵金属投资收益	0.00			0.00		

衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	722,945.68	884,004.24
3、公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-1,029,997.42	453,622.01
4、汇兑收益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
5、其他收入（损失以“-”填列）	-25,048.25	0.00
减：二、费用	116,744.02	119,442.91
1. 管理人报酬	83,151.09	82,377.87
其中：固定管理费	83,151.09	82,377.87
业绩报酬	0.00	0.00
2、托管费	7,483.54	7,413.99
3、销售服务费	0.00	0.00
4、外包服务费	8,315.15	15,083.80
5、交易费用	16,291.35	14,567.25
6、利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
7、其他费用	1,502.89	0.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-707,969.74	655,868.00
减：所得税费用	0.00	0.00
（净亏损以“-”号填列） 四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-707,969.74	655,868.00

备注：

按照本产品合同约定的管理人业绩报酬条款
以 2023-12-31 为基准日计算的暂估管理人业绩报酬为 0 元
计算出的暂估管理人业绩报酬与投资者实际承担的管理人业绩报酬可能存在差异

6.3 所有者权益变动表

项目	2023-01-01	至	2023-12-31
	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）	15,200,000.00	181,889.22	15,381,889.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	-707,969.74	-707,969.74
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）	-5,000,000.00	281,500.00	-4,718,500.00
其中：1、基金申购款	0.00	0.00	0.00
2、基金赎回款	-5,000,000.00	281,500.00	-4,718,500.00
四、本期向基金份额持	0.00	0.00	0.00

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)	10,200,000.00	-244,580.52	9,955,419.48
项目	2022-01-01	至	2022-12-31
	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)	18,300,000.00	-321,558.78	17,978,441.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0.00	655,868.00	655,868.00
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)	-3,100,000.00	-152,420.00	-3,252,420.00
其中：1、基金申购款	0.00	0.00	0.00
2、基金赎回款	-3,100,000.00	-152,420.00	-3,252,420.00
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)	15,200,000.00	181,889.22	15,381,889.22

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	94.54
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	0.00
	其中：优先股	0.00
	其他股权类投资	0.00
上市公司定向增发投资	上市公司定向增发股票投资	0.00
新三板投资	新三板挂牌企业投资	0.00
境内证券投资规模	结算备付金	83,921.88
	存出保证金	0.00
	股票投资	9,934,298.27
	债券投资	0.00

	其中：银行间市场债券	0.00
	其中：利率债	0.00
	其中：信用债	0.00
	资产支持证券	0.00
	基金投资（公募基金）	20,201.82
	其中：货币基金	20,201.82
	期货及衍生品交易保证金	0.00
	买入返售金融资产	0.00
	其他证券类标的	0.00
资管计划投资	商业银行理财产品投资	0.00
	信托计划投资	0.00
	基金公司及其子公司资产管理计划投资	0.00
	保险资产管理计划投资	0.00
	证券公司及其子公司资产管理计划投资	0.00
	期货公司及其子公司资产管理计划投资	0.00
	私募基金产品投资	0.00
	未在协会备案的合伙企业份额	0.00
另类投资	另类投资	0.00
境内债权类投资	银行委托贷款规模	0.00
	信托贷款	0.00
	应收账款投资	0.00
	各类受（收）益权投资	0.00
	票据（承兑汇票等）投资	0.00
	其他债权投资	0.00
境外投资	境外投资	0.00
其他资产	其他资产	0.00
基金负债情况	债券回购总额	0.00
	融资、融券总额	0.00
	其中：融券总额	0.00
	银行借款总额	0.00
	其他融资总额	0.00

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	103,728.60	1.04
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	159,341.00	1.60
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	225,680.00	2.27
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	488,749.60	4.91

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 (%)
港股通	9,445,548.67	94.88
合计	9,445,548.67	94.88

信息披露报告是否经托管机构复核	是
-----------------	---