

# 东源嘉盈棱镜优选1号私募证券投资基金2025年度信息披露报告

## 1、基金产品概况

### 1.1 基金基本情况

基金名称	东源嘉盈棱镜优选1号私募证券投资基金
基金编码	SLK210
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2020-07-23
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	国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)	84.245998
基金到期日期	2030-07-22

### 1.2 基金产品说明

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)	
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。

### 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	国信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	符思怡	薛璐
	联系电话	0755-82787773	0755-22940163
	电子邮箱	fusiyi@dongyuanjy.com	03339@guosen.com.cn
传真		0755-82787773	0755-22940165
注册地址		广东省深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路5001号深业上城(南区)T1栋2601	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址		广东省深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路5001号深业上城(南区)T1栋2601	深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦19楼
邮政编码		518000	518000
法定代表人		杨凡	张纳沙

#### 1.4 信息披露方式

官网披露

#### 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	国信证券股份有限公司	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 19 楼
外包机构	国信证券股份有限公司	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 19 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

期间数据和指标	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	46.77	26,763.35	-1,091,709.46
本期利润	-17,890.44	105,012.84	-520,200.52
期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	-227,249.72	-602,041.45	-652,382.38
期末可供分配基金份额利润	-0.2697	-0.3055	-0.3310
期末基金净资产	629,293.59	1,423,595.55	1,318,582.71
报告期期末单位净值	0.747	0.722	0.669
累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	-25.30	-27.80	-33.10

### 2.2 基金净值表现

阶段	净值增长率 (%)	净值增长率标准差 (%) (选填)	业绩比较基准收益率 (%) (选填)	业绩比较基准收益率标准差 (%) (选填)
当年	3.46			
自基金合同生效起至今	-25.30			

注：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当年净值增长率=（本年度末累计净值-上年度末累计净值）/上年度末累计净值

### 2.3 过去三年基金的利润分配情况

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
2025	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2024	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2023	0.0000	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	197.096509
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	112.850511
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	84.245998

**4、管理人说明的其他情况**（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）

本基金已于 2025 年 7 月 4 日终止。

### 5、托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

报告期内，国信证券股份有限公司（以下称“托管人”）严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益分配的情况等方面进行了必要的监督、复核和审查。

#### 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

托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现等财务信息相关内容，认为其不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

托管人提示投资者关注：

因托管人获取信息有限，请投资者谨慎识别和判断风险，并及时向基金管理人获取本基金实际投资项目状况及风险状况等。6.2 利润表备注中的暂估业绩报酬未经托管人复核，该金额与投资者实际承担的管理人报酬可能存在差异。

## 6、年度财务报表

### 6.1 资产负债表

单位：元

资产	本期末 2025-07-07	上年度末 2024-12-31
资产：		
银行存款	407.04	2,780.40
结算备付金	608,774.39	579,116.59
存出保证金	20,251.07	585,053.12
交易性金融资产	0.00	244,297.95
其中：股票投资	0.00	114,390.00
基金投资	0.00	129,907.95
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	18,840.00
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	629,432.50	1,430,088.06
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2025-07-07</b>	<b>上年度末 2024-12-31</b>
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	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00

应付管理人报酬		
应付托管费	130.23	5,550.99
应付销售服务费	4.34	185.04
应付交易费用	0.00	0.00
应交税费	0.00	0.00
应付利息	0.00	571.44
应付利润	0.00	0.00
递延所得税负债	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	4.34	185.04
<b>所有者权益：</b>	138.91	6,492.51
实收基金		
未分配利润	842,459.98	1,970,965.09
所有者权益合计	-213,166.39	-547,369.54
负债和所有者权益合计	629,293.59	1,423,595.55
	629,432.50	1,430,088.06

## 6.2 利润表

单位：元

项目	本期	上年度可比期间
	2025-01-01 至 2025-07-07	2024-01-01 至 2024-12-31
<b>一、收入</b>	-1,533.97	136,581.21
1. 利息收入	210.45	275.84
其中：存款利息收入	210.45	275.84
债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产利息收入	0.00	0.00
其他利息收入	0.00	0.00
2. 投资收益（损失以“-”填列）	10,597.96	84,989.65
其中：股票投资收益	-51,369.00	-28,260.00
基金投资收益	-2.07	2,083.85
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	60,885.00	98,685.00
股利收益	1,084.03	12,480.80
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-17,969.56	78,281.84
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	0.00	0.00

5. 其他收入（损失以“-”填列）	5,627.18	-26,966.12
<b>减：二、费用</b>	16,356.47	31,568.37
1. 管理人报酬	9,479.35	21,755.51
其中：固定管理费	9,479.35	21,755.51
业绩报酬	0.00	0.00
2. 托管费	316.01	725.26
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 外包服务费	316.01	725.26
5. 交易费用	6,228.09	8,088.14
6. 利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产款支出	0.00	0.00
7. 其他费用	17.01	274.20
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-17,890.44	105,012.84
减：所得税费用	0.00	0.00
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-17,890.44	105,012.84

备注：2025年12月31日，该产品的暂估业绩报酬金额为0.00元。

### 6.3 所有者权益变动表

单位：元

项目	本期 (2025-01-01至2025-07-07)		
	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）	1,970,965.09	-547,369.54	1,423,595.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	-17,890.44	-17,890.44
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）	-1,128,505.11	352,093.59	-776,411.52
其中：1. 基金申购款	0.00	0.00	0.00
2. 基金赎回款	-1,128,505.11	352,093.59	-776,411.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	842,459.98	-213,166.39	629,293.59
项目	上年度可比期间 (2024-01-01至2024-12-31)		

	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）	1,970,965.09	-652,382.38	1,318,582.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	105,012.84	105,012.84
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）	0.00	0.00	0.00
其中：1. 基金申购款	0.00	0.00	0.00
2. 基金赎回款	0.00	0.00	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	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	1,970,965.09	-547,369.54	1,423,595.55

## 7、期末投资组合情况

### 7.1 期末基金资产组合情况

项目		金额单位：元
现金类资产	银行存款	金额
		407.04
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	608,774.39
	存出保证金	20,251.07
	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）	
	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	

## 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	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

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
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
	<b>合计</b>	0.00	0.00

备注：以上股票投资不含港股通。

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 (%)
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
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
<b>合计</b>	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》

信息披露报告是否经托管机构复核：是