

(机密)

中融鼎新定增组合类私募证券投资基金 2016 年 4 季度定期管理报告

基金管理人：北京中融鼎新投资管理有限公司

基金托管人：光大证券股份有限公司

报告撰写日期：2017 年 1 月 3 日

尊敬的合伙人/基金份额持有人：

感谢您投资于本公司设立的“中融鼎新定增组合类私募证券投资基金”。本公司作为基金管理人，向您报告自 2016 年 10 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日本基金事务管理事宜。

一、基金基本情况

项目	信息
基金名称	中融鼎新定增组合类私募证券投资基金
基金编号	SK7258
基金管理人	北京中融鼎新投资管理有限公司
基金托管人（如有）	光大证券股份有限公司
基金类型	契约型
基金运作方式	开放式
基金成立时间	2016 年 6 月 22 日
基金期限	60 个月
报告期末基金份额总额	518,756,831.81 份
投资顾问名称	中融国际信托有限公司
投资目标	通过持续投资于股票定向增发市场，以类指数化投资为指导思想，以分散投资，构建行业中性、市值中性的投资组合为原则，在承担市场波动风险的同时，享受市场波动收益叠加定向增发的折价收益。

投资策略	本基金从估值至上的价值投资理念出发，采取自下而上的策略，选择价值相对低估的优质公司为主要投资标的，并通过投资组合的方式，追求资产的稳定增值。
业绩比较基准（如有）	无。
风险收益特征	无。

二、主要财务指标和基金净值表现

1、主要财务指标

币种：人民币

项目	本期金额（元）	成立以来累计金额（元）
已实现收益	-326,480.51	-358,614.70
利润	9,955,547.59	10,986,056.00

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益

2、基金净值表现

指标	收益情况
期末基金资产净值	535,634,696.00
期末基金份额净值	1.0325
当季净值增长率	2.7670%
自成立以来净值增长率	3.2500%

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
季度末净值

三、投资组合情况

1、报告期末基金资产组合情况

币种：人民币

序号	项目	期末资产金额 (元)	占基金总资产 的比例 (%)
1	权益投资	—	—
	其中：普通股	—	—
	存托凭证	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售 金融资产	—	—
6	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金	33,917,839.66	6.32%
8	其他资产	502,497,533.82	93.68%
	其中：理财产品投资	502,497,533.82	93.68%
	合计	536,415,373.48	100.00%

2、报告期末按期末资产金额占基金总资产比例大小排序前五名投资股票明细

（本基金通过基金资产管理计划间接参与下列股票的定向增发）

币种：人民币

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	期末资产金额（元）	占基金资产净值比例（%）	占投资标的总股本比例（%）
1	000536.SZ	华映科技	3,798,670	44,482,425.70	8.30%	0.22%
2	600604.SH	市北高新	1,959,504	33,527,113.44	6.26%	0.21%
3	000807.SZ	云铝股份	5,769,231	31,096,155.09	5.81%	0.22%
4	000521.SZ	美菱电器	3,577,817	21,109,120.30	3.94%	0.34%
5	600400.SH	红豆股份	2,444,988	20,317,850.28	3.79%	0.15%

3、报告期末前五名股票中存在流通受限情况的说明

币种：人民币

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的期末资产金额（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000536.SZ	华映科技	44,482,425.70	8.30%	定增限售期 12 个月，预计于 2017 年 10 月 10 日解禁
2	600604.SH	市北高新	33,527,113.44	6.26%	定增限售期 12 个月，预计于 2017 年 8 月 29 日解禁
3	000807.SZ	云铝股份	31,096,155.09	5.81%	定增限售期 12 个月，预计于 2017 年 11 月 21 日解禁
4	000521.SZ	美菱电器	21,109,120.30	3.94%	定增限售期 12 个月，预计于 2017 年 10 月 16 日解禁

5	600400. SH	红豆股份	20, 317, 850. 28	3. 79%	定增限售期 12 个月，预计于 2017 年 8 月 31 日解禁
---	------------	------	------------------	--------	-----------------------------------

四、基金份额变动情况

项目	份额（份）
报告期期初基金份额总额	254, 735, 372. 52
报告期期间基金总申购份额	318, 921, 459. 29
减：报告期期间基金总赎回份额	54, 900, 000. 00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0. 00
报告期期末基金份额总额	518, 756, 831. 81

五、管理人报告

本公司针对本基金的运作特点，通过定期和不定期的风险监控及风险预警机制，及时发现运作过程中可能出现的风险状况，并采取相应的风险规避措施，确保基金合法、合规、安全、正常运行。

本报告期内，本基金运作合法合规，未出现违反相关规定的状况，也未发生损害投资者利益的行为。

六、其他重大事项报告

无。

如您对本基金有疑问或对客户服务有任何要求，请联系本公司客服人员。

客服热线：400-6508-666

北京中融鼎新投资管理有限公司