

允公慧享精选 6 号私募投资基金 2016 年第 4 季度报告

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	允公慧享精选 6 号私募投资基金
基金编码	SL6134
基金管理人	上海允公资产管理有限公司
基金托管人（如有）	招商证券股份有限公司
投资顾问（如有）	-
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2016 年 09 月 13 日
报告期末基金份额总额	30,500,000.00
投资目标	通过多种手段严格控制净值下行风险，积极投资于二级市场中定增主题相关的精选个股，获得较高的回报。
投资策略	本基金投资于上市公司定增类概念股，结合定增目的、对象、行业属性、财务状况等多种因素挖掘定增进程中不同时间段的投资机会；也可根据增发条款、破发幅度、解禁时间、市值、估值、市场情绪等多维度构建二级市场定增破发股投资组合，在整体风险可控前提下，追求收益的稳健表现。
业绩比较基准（如有）	无。
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	-4.26	-	-	-
自基金合同生效起至今	-4.33	-	-	-

说明：净值增长率等于（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当季净值增长率等于（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

单位：人民币元

项目	2016 年 10 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-143,404.36
本期利润	-1,300,097.36
期末基金资产净值	29,179,082.22
期末基金份额净值	0.9567

4、投资组合报告

4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	22,619,785.00	77.00
	其中：普通股	22,619,785.00	77.00
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	0.00	0.00
3	固定收益投资	0.00	0.00
	其中：债券	0.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00
4	金融衍生品投资	0.00	0.00
	其中：远期	0.00	0.00
	期货	0.00	0.00
	期权	0.00	0.00
	权证	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
6	货币市场工具	0.00	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	28,926.35	0.10
8	其他各项资产	6,728,913.39	22.90
	合计	29,377,624.74	100.00

注：其他各项资产：主要包括三方存管保证金、其他私募基金、基金公司专户、券商资管计划、有限合伙企业股权、未上市企业股权等。

4.2 期末按行业分类的股票投资组合(不含港股通)

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	7,840,585.00	26.87
C	制造业	11,640,100.00	39.89
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	1,738,000.00	5.96
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	1,401,100.00	4.80
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	22,619,785.00	77.52

4.3 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	占基金资产净值比例（%）
港股通	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

5、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	30,500,000.00
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	0.00
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	30,500,000.00

6、管理人报告

无
