**信复创值3号基金2016年第2季度报告**

[**1、基金基本情况**](#_Toc454790235)

[**2、基金净值表现**](#_Toc454790236)

[**3、主要财务指标**](#_Toc454790237)

[**4、投资组合报告**](#_Toc454790238)

[**4.1 期末基金资产组合情况**](#_Toc454790239)

[**4.2 期末按行业分类的股票投资组合(不含沪港通)**](#_Toc454790240)

[**5、基金份额变动情况**](#_Toc454790241)

[**6、管理人报告**](#_Toc454790242)

**1、基金基本情况**

|  |  |
| --- | --- |
| 项目  | 信息  |
| 基金名称  | 信复创值3号基金 |
| 基金编号  | S21884 |
| 基金管理人  | 北京信复创值投资管理有限公司 |
| 基金托管人  | 招商证券股份有限公司 |
| 基金运作方式  | 开放式 |
| 基金合同生效日期  | 2014年10月24日 |
| 报告期末基金份额总额  | 81,106,935.52份 |
| 投资目标  | 追求长期年平均回报率超越沪深300指数，为客户创造长期稳定的绝对回报。 |
| 投资策略  | 公司用“量化选股，量化择时”的投资策略来诠释上述的投资理念。公司将长期的主动投资实战方法与量化投资方法相结合，形成了公司多策略的投资体系。公司采用立足于大数据研究之上的量化模型投资方法，以公开的市场数据为基础，采用不同的量化工具识别跟踪市场最具上涨潜力的股票组合，并量化择时投资，以追求风险调整后的最优回报。 |
| 业绩比较基准  | 沪深300股指 |
| 风险收益特征  | 本季末最新净值为1.5314，收益率标准差为0.0461 |

**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 | -2.01% | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 53.46% | - | - | - |

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 | 2016-04-01至2016-06-30 |
| 本期已实现收益 | 4,257,834.45 |
| 本期利润 | -3,172,341.24 |
| 期末基金资产净值 | 124,464,877.43 |
| 期末基金份额净值 | 1.5346 |

**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  | 83,226,506.16 | 66.84 |
|  | 其中：普通股  | 83,226,506.16 | 66.84 |
|  | 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合计  | 9,674,996.75 | 7.77 |
| 8  | 其他各项资产  | 31,617,420.69 | 25.39 |
|  | 合计  | 124,518,923.60 | 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(不含沪港通)**

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  | 4,865,908.00 | 3.91 |
| B  | 采矿业  | 1,742,136.00 | 1.40 |
| C  | 制造业  | 55,247,690.94 | 44.39 |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业  | 2,587,378.00 | 2.08 |
| E  | 建筑业  | 714,110.00 | 0.57 |
| F  | 批发和零售业  | 6,105,133.00 | 4.91 |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业  | 2,402,903.00 | 1.93 |
| H  | 住宿和餐饮业  | - | - |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 983,262.00 | 0.79 |
| J  | 金融业  | - | - |
| K  | 房地产业  | 2,684,557.00 | 2.16 |
| L  | 租赁和商务服务业  | - | - |
| M  | 科学研究和技术服务业  | 1,088,214.00 | 0.87 |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业  | 2,772,145.00 | 2.23 |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业  | - | - |
| P  | 教育  | - | - |
| Q  | 卫生和社会工作  | - | - |
| R  | 文化、体育和娱乐业  | - | - |
| S  | 综合  | 2,033,069.22 | 1.63 |
|  | 合计  | 83,226,506.16 | 66.87 |

**5、基金份额变动情况**

单位：份

|  |  |
| --- | --- |
| 报告期期初基金份额总额  | 59,991,178.86 |
| 报告期期间基金总申购份额  | 26,466,605.60 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额  | 5,350,848.94 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）  | - |
| 报告期期末基金份额总额  | 81,106,935.52 |

**6、管理人报告**

|  |
| --- |
| 1.基金管理人及基金经理情况 北京信复创值投资管理有限公司成立于2013年7月23日。注册资本人民币1000万元，实缴1000万元。截至2015年12月31日，公司共管理4只基金：信复创值1号资产管理计划、信复创值2号基金、信复创值3号基金、信复创值5号基金。 基金经理：刘宇晨， 毕业于北京工业大学，1998年创建北京裂变投资顾问有限责任公司，任总经理。2013年7月创建北京信复创值投资管理有限公司，任执行董事，投资总监。20多年投资实践中，广泛调研了国内A股上市公司，在行业研究和公司定价方面有深刻的认识。拥有完善的价值投资理念，善于从基本面出发自下而上的逆向投资策略，形成独特高效的投资方法。 基金经理：耿立勋，北京工业大学学士，北京大学工商管理专业硕士。2016年3月加入信复创值的投资团队。历任国泰证券交易员，中国电力信托投资有限公司证券部权益投资经理，中国电力财务有限公司投资管理部副主任。有超过20年的股票价值投资实战经验。2010年起，全面负责中国电财投资业务的大类资产配置策略的制定和实施，投资品种涵盖股票、债券、基金及各类非标金融资产，管理投资规模超过百亿。2012年开始，研究量化投资，量化选股、量化择时及量化对冲策略日渐成熟。2.报告期内本基金运作遵规守信情况 本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。 本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。 本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。3.报告期内基金业绩表现 截至2016年6月30日，基金单位净值为1.5314。4.内部基金监察稽核工作情况 报告期内，本基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部门按照规定的权限和程序，认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行定期和不定期监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通。  同时，本基金管理人根据全面性原则、独立性原则、相互制约原则、定性和定量相结合原则、重要性原则建立了一套比较完整的内部控制体系，该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息和沟通、监控等要素。 |