

信复创值6号基金2016年年度报告

2016年12月31日

基金管理人：北京信复创值投资管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：二零一七年三月三日

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

项目	信息
基金名称	信复创值6号基金
基金编码	SE7305
基金运作方式	开放式
基金合同生效日期	2016年01月19日
基金管理人	北京信复创值投资管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司
投资顾问（如有）	无
报告期末基金份额总额	45,275,832.36份
基金合同存续期	三年

1.2 基金产品说明

投资目标	本基金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	以公开的财务信息为基础，挖掘最具价值的优秀上市公司的共同特征，构筑量化选股模型，形成投资组合，将长期投资的理念和操作策略融入其中，努力为投资人实现长期、持续、大幅超越市场的回报。
业绩比较基准 （如有）	沪深300指数
风险收益特征	高风险高收益

1.3 基金管理人和托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	北京信复创值投资管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李灏澄
	联系电话	010-64093284
		崔瑞娟
		020-87555888

电子邮箱	lihaocheng@faithfulvalue.com	gfzctgbxxpl@gf.com.cn
传真	010-64093284	020-87555129
注册地址	北京市东城区菊儿胡同 33 号 9 幢 601A	广州市天河北路183号
办公地址	北京市西城区铸钟胡同 50 号	广州市天河北路183号
邮政编码	100009	510075
法定代表人	耿立勋	孙树明

1.4 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	北京鸿天众道会计师事务所有限公司	北京市海淀区苏州街 75 号 4 号楼鼎钧大厦 110A
注册登记机构	广发证券股份有限公司	广州市天河北路183号
外包机构	广发证券股份有限公司	广州市天河北路183号

2、主要财务指标和基金净值表现

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	2016年01月19日-2016年12月31日
本期已实现收益	2,632,585.42
本期利润	4,784,224.76
期末数据和指标	2016年末
期末可供分配利润	2,619,410.02
期末可供分配基金份额利润	0.0579
期末基金资产净值	50,051,638.25
期末基金份额净值	1.105
累计期末指标	2016年末
基金份额累计净值增长率	10.50%

A级基金主要财务指标

单位：元

期间数据和指标	2016年01月19日-2016年12月31日
本期已实现收益	-
本期利润	-
期末数据和指标	2016年末
期末可供分配利润	-
期末可供分配基金份额利润	-
期末基金资产净值	26,836,479.09
期末基金份额净值	1.105
累计期末指标	2016年末
基金份额累计净值增长率	10.50%

B级基金主要财务指标

单位：元

期间数据和指标	2016年01月19日-2016年12月31日
本期已实现收益	-
本期利润	-
期末数据和指标	2016年末
期末可供分配利润	-
期末可供分配基金份额利润	-
期末基金资产净值	23,215,159.16
期末基金份额净值	1.105
累计期末指标	2016年末
基金份额累计净值增长率	10.50%

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差(%)
当年	10.50	-	-	-

自基金合同生效起至今	10.50	-	-	-
------------	-------	---	---	---

A级基金净值表现

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 (%)
当年	10.50	-	-	-
自基金合同生效起至今	10.50	-	-	-

B级基金净值表现

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 (%)
当年	10.50	-	-	-
自基金合同生效起至今	10.50	-	-	-

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
2016年	-	-	-	-	-
2015年	-	-	-	-	-
2014年	-	-	-	-	-
合计	0.0000	0.00	0.00	0.00	-

A级基金过去三年利润分配情况

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
2016年	-	-	-	-	-

2015年	-	-	-	-	-
2014年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

B级基金过去三年利润分配情况

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
2016年	-	-	-	-	-
2015年	-	-	-	-	-
2014年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

3、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	2,000,050.00
报告期期间基金总申购份额	44,617,460.32
减：报告期期间基金总赎回份额	1,341,677.96
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	45,275,832.36

A级基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,000,025.00
报告期期间基金总申购份额	24,617,460.32
减：报告期期间基金总赎回份额	1,341,677.96
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	24,275,807.36

B级基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,000,025.00
报告期期间基金总申购份额	20,000,000.00

减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	21,000,025.00

4 管理人说明的其他情况

4.1、基金管理人及其管理基金的经验

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 2016 年 12 月 31 日，公司共管理 6 只产品：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、信复创值 6 号基金、信复创值稳健 1 号私募投资基金。

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。

4.2、管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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。

4.3、管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.3.1、报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内公司采用“量化选股，量化择时，量化对冲”的投资策略。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。

4.3.2、报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，基金单位净值为 1.1050。

4.4、管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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。

4.5、管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，将基金估值业务外包给招商证券金融外包服务机构进行估值。

本基金管理人设立了由公司总经理、投资总监、风险管理部、营销服务部等部门负责人组成的基金估值复核小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。

4.6、管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金合同中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

4.7、管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无

4.8、报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内共 9 位投资者申购本基金，报告期内基金规模约 0.45 亿元。报告期内基金未出现预警情况。

5、托管人报告

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》、《证券投资基金托管业务管理办法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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和基金合同的约定对基金管理人的投资运作行为进行了监督，基金管理人在本基金投资运作过程中遵规守信情况良好；对基金的净值计算、利润分配情况进行了复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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本年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6、年度财务会计报告

6.1 资产负债表

单位：元

资 产	本期末2016年12月31日	上年度末日
资 产：	-	-
银行存款	-	-

结算备付金	2,673,981.32	-
存出保证金	13,555,877.81	-
交易性金融资产	33,907,894.00	-
其中：股票投资	33,907,894.00	-
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	42.84	-
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	0.03	-
资产总计	50,137,796.00	-
负债和所有者权益	本期末2016年12月31日	上年度末日
负 债：	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	61,541.29	-
应付托管费	12,308.23	-
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	12,308.23	-
负债合计	86,157.75	-
所有者权益：	-	-
实收基金	45,275,832.36	-
未分配利润	4,775,805.89	-
所有者权益合计	50,051,638.25	-
负债和所有者权益总计	50,137,796.00	-

6.2 利润表

单位：元

项 目	本期 2016年01月19日 至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日 至 日
一、收入	5,658,109.49	-
1. 利息收入	100,431.50	-
其中：存款利息收入	4,020.27	-
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	96,411.23	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	3,406,038.65	-
其中：股票投资收益	7,930,844.56	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-4,571,640.00	-
股利收益	46,834.09	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”	2,151,639.34	-

号填列)		
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	-	-
减: 二、费用	873,884.73	-
1. 管理人报酬	205,097.28	-
其中: 固定管理费	205,097.28	-
业绩报酬	-	-
2. 托管费	41,019.52	-
3. 销售服务费	-	-
4. 外包服务费	41,019.52	-
5. 交易费用	586,348.41	-
6. 利息支出	-	-
其中: 卖出回购金融资产支出	-	-
7. 其他费用	400.00	-
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	4,784,224.76	-
减: 所得税费用	-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	4,784,224.76	-

6.3 所有者权益变动表

单位: 元

项 目	本期 2016年01月19日至 2016年12月31日		
	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)	2,000,050.00	-	2,000,050.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,784,224.76	4,784,224.76
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)	43,275,782.36	-8,418.87	43,267,363.49

列)			
其中：1. 基金申购款	44,617,460. 32	32,539.68	44,650,000.00
2. 基金赎回款	-1,341,677. 96	-40,958.55	-1,382,636.51
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	45,275,832. 36	4,775,805.8 9	50,051,638.25

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

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	33,907,894.00	67.63
	其中：普通股	33,907,894.00	67.63
	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	2,673,981.32	5.33

8	其他各项资产	13,555,920.68	27.04
	合计	50,137,796.00	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末含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	占基金资产净值的比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,449,862.00	8.89
B	采矿业	-	-
C	制造业	18,101,167.00	36.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,351,516.00	8.69
E	建筑业	792,948.00	1.58
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,552,160.00	5.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	4,000.00	0.01
K	房地产业	3,656,241.00	7.30
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
	合计	33,907,894.00	67.75

7.2.2 、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：元

行业类别	公允价值	占基金资产净值的比例（%）
港股通	-	-
合计	-	-