

私募基金信息披露季度报表

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 |
| 基金管理人 | 北京信复创值投资管理有限公司 |
| 基金托管人（如有） | 广发证券股份有限公司 |
| 投资顾问（如有） | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金成立日期 | 2016-01-19 |
| 报告期末基金份额总额 | 47,485,777.11 |
| 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（如有） | 沪深 300 指数 |
| 风险收益特征 | 高风险高收益 |

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 | -1.46 | - | - | - |
| 自基金合同 生效起至今 | 8.30 | - | - | - |

说明：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）/上季度末累计净值

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（%） |
|-------------|-------|--------------|---------------|------------------|
| 当季 | -1.46 | - | - | - |
| 自基金合同 生效起至今 | 8.30 | - | - | - |

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 (%) |
|------------|-------|--------------|---------------|------------------|
| 当季 | -1.46 | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 8.30 | - | - | - |

3、主要财务指标

单位：人民币元

| 项目 | 2017-04-01 至 2017-06-30 (元) |
|----------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | -88,516.96 |
| 本期利润 | -773,017.47 |
| 期末基金资产净值 | 51,433,311.81 |
| 期末基金份额净值 | 1.083 |

A 级基金主要财务指标

单位：人民币元

| 项目 | 2017-04-01 至 2017-06-30 (元) |
|----------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | 0.00 |
| 本期利润 | |
| 期末基金资产净值 | 28,687,536.14 |
| 期末基金份额净值 | 1.083 |

B 级基金主要财务指标

单位：人民币元

| 项目 | 2017-04-01 至 2017-06-30 (元) |
|----------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | 0.00 |
| 本期利润 | 0.00 |
| 期末基金资产净值 | 22,745,775.67 |
| 期末基金份额净值 | 1.083 |

4、投资组合情况

4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

| 序号 | 项目 | 金额 (元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|---------|--------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 0.00 | 0.00 |
| | 其中：普通股 | 0.00 | 0.00 |
| | 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 | 25,785.88 | 0.05 |
| 8 | 其他资产组合 | 51,496,107.19 | 99.95 |
| | 合计 | 51,521,893.07 | 100.00 |

4.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

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 |
| 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 | 0.00 | 0.00 |

4.2.2 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（人民币） | 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 | 47,485,777.11 |
|-------------|---------------|

| | |
|---------------------------|---------------|
| 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 | 47,485,777.11 |

A 级基金份额变动情况

单位：份

| | |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 26,485,752.11 |
| 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 | 26,485,752.11 |

B 级基金份额变动情况

单位：份

| | |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 21,000,025.00 |
| 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 | 21,000,025.00 |

6、管理人报告（如有）

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 2017 年 06 月 30 日，公司共管理 8 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、信复创值 6 号基金、信复创值稳健 1 号私募投资基金、信复创值 7 号私募证券投资基金、信复创值 9 号私募证券投资基金。

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。

2.报告期内本基金运作合规守信情况

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 2017 年 6 月 30 日，基金单位净值为 1.0830。

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。