

## 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	17,028,223.33
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。
业绩比较基准（如有）	
风险收益特征	暂无

### 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	-14.42	-	-	-
自基金合同 生效起至今	-18.10	-	-	-

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	-14.42	-	-	-
自基金合同 生效起至今	-18.10	-	-	-

### 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	-14.42	-	-	-
自基金合同生效起至今	-18.10	-	-	-

### 3、主要财务指标

单位：人民币元

项目	2018-10-01 至 2018-12-31 (元)
本期已实现收益	-2,757,363.65
本期利润	-2,790,984.73
期末基金资产净值	13,948,503.66
期末基金份额净值	0.819

### A 级基金主要财务指标

单位：人民币元

项目	2018-10-01 至 2018-12-31 (元)
本期已实现收益	0.00
本期利润	0.00
期末基金资产净值	807,561.73
期末基金份额净值	0.819

### B 级基金主要财务指标

单位：人民币元

项目	2018-10-01 至 2018-12-31 (元)
本期已实现收益	0.00
本期利润	0.00
期末基金资产净值	13,140,941.93
期末基金份额净值	0.819

### 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	12,693,256.00	90.79
	其中：普通股	12,693,256.00	90.79
	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	234,280.80	1.68
	其中：远期	0.00	0.00
	期货	234,280.80	1.68
	期权	0.00	0.00
	权证	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	800,002.40	5.72
	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	252,979.95	1.81
8	其他资产组合	8.63	0.00
	合计	13,980,527.78	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	9,966,006.00	71.45
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	791,988.00	5.68
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	1,650,854.00	11.84
J	金融业	3,140.00	0.02
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	281,268.00	2.02
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	12,693,256.00	91.00

#### 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	23,319,223.33
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	6,291,000.00
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	17,028,223.33

### A 级基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	985,865.00
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	985,865.00

### B 级基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	22,333,358.33
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	6,291,000.00
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	16,042,358.33

## 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。注册资本人民币 1000 万元，实缴 1000 万元。截至 2018 年 3 月 31 日，公司共管理 8 只基金：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。信复创值立勋进取私募证券投资基金。

基金经理：耿立勋，先后毕业于北京工业大学工业企业管理专业和北京大学工商管理

专业，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（分管投资）。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。

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。

## 2、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2018年12月31日，本基金单位净值为0.819元。

## 4、内部基金监察稽核工作：

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。

报告是否经托管机构复核

是