

附表 3 私募基金信息披露年度报表

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	信复创值 5 号基金
基金编号	S83733
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2015-10-27
基金管理人	北京信复创值投资管理有限公司
基金托管人	中国银河证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	105,209,903.12 份
基金合同存续期	3 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	我们的投资策略可概括为：量化思维下的主动管理。投资策略追求三中平衡，即主观与客观的平衡、理论与实证的平衡、人脑与电脑的平衡。我们通过“量化选股、量化择时、量化对冲”的投资模型来展现我们的投资策略，从而达到“控制风险，长期复利，获取风险调整后的收益”的目标。
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 基金管理人和基金托管人

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	中国银河证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李灏澄	孟波
	联系电话	010-64093284	010-83574679
	电子邮箱	lihaocheng@faithfulvalue.com	yhqz_tggz@chinastock.com.cn
传真		010-64093284	010-66568532
注册地址		北京市东城区菊儿胡同 33 号 9 幢 601A	中国北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2-6 层
办公地址		北京市西城区铸钟胡同 50 号	中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
邮政编码		100009	100033
法定代表人		耿立勋	陈共炎

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	中国银河证券股份有限公司	中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
外包机构	中国银河证券股份有限公司	中国北京西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

2.1 主要会计数据和财务指标

期间数据和指标	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	2,635,492.04	-150,263.11	
本期利润	2,878,316.57	-35,122.40	
期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配利润	349,082.88	-211,986.27	
期末可供分配基金份额利润	0.0033	-0.0095	
期末基金资产净值	106,576,309.60	22,144,916.49	
期末基金份额净值	1.013	0.996	
累计期末指标	2016年末	2015年末	2014年末
基金份额累计净值增长率	1.30%	-0.40%	

2.2 基金净值表现

阶段	净值增长率	净值增长率标准差（选填）	业绩比较基准收益率（选填）	业绩比较基准收益率标准差（选填）
当年	1.71%			
自基金合同生效起至今	1.30%			

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) / 上季度末净值

2.3 过去三年基金的利润分配表

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	0.000	0.00			
2015年	0.000	0.00			
2014年	0.000	0.00			

3、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	22,241,762.05
报告期间基金总申购份额	91,175,761.61
减：报告期间基金总赎回份额	8,207,620.54
报告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	105,209,903.12

4、管理人说明的其他情况

(如报告期内高管、基金经理及其关联基金经验、基金运作)

遵规守信情况、基金投资策略和业绩表现、对宏观经济、证券市场及其行业走势展望、内部基金监督检查工作、基金估值程序、基金运作情况和运用杠杆情况、投资收益分配和损失承担情况、会计师事务所出具非标准审计报告所涉及相关事项、对本基金持有人数或基金资产净值预警情形、可能存在的利益冲突等)

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 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。

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 2016 年 12 月 31 日，基金单位净值为 1.013。本基金 2016 年度涨跌幅（1.30%），同期沪深 300 指数涨跌幅（-11.28%），同期上证综指涨跌幅（-12.31%）。

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，认真履行工作职责，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。

5. 其他相关情况说明

本基金未使用杠杆，报告期内未进行收益分配。本基金不收取管理费，报告期未计提业绩报酬。

5、托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

--

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的声明

--

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

--

6、年度财务报表

6.1 资产负债表

单位：元

资产	本期末 2016-12-31	上年度末 2015-12-31
资产：	0.00	0.00
银行存款	665,440.72	455,510.81
结算备付金	5,623,793.02	0.00
存出保证金	28,709,721.60	0.00
交易性金融资产	71,620,991.00	21,700,023.13
其中：股票投资	71,620,991.00	21,700,023.13
基金投资	0.00	0.00
债券投资	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
贵金属投资	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	258.08	107.55
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
递延所得税资产	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计	106,620,204.42	22,155,641.49
负债和所有者权益	本期末 2016-12-31	上年度末 2015-12-31
负债：	0.00	0.00
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	0.00	0.00
应付托管费	21,947.41	7,150.00
应付销售服务费	0.00	0.00

应付交易费用	0.00	0.00
应交税费	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
递延所得税负债	0.00	0.00
其他负债	21,947.41	3,575.00
负债合计	43,894.82	10,725.00
所有者权益：		
实收基金	105,209,903.12	22,241,762.05
未分配利润	1,366,406.48	-96,845.56
所有者权益合计	106,576,309.60	22,144,916.49
负债和所有者权益总计	106,620,204.42	22,155,641.49

6.2 利润表

单位：元

项目	本期	上年度可比期间
	2016-01-01 至 2016-12-31	2015-01-01 至 2015-12-31
一、收入	4,221,217.52	-3,146.90
1. 利息收入	227,202.55	22,466.04
其中：存款利息收入	14,710.25	4,798.30
债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产收入	212,492.30	17,667.74
其他利息收入	0.00	0.00
2. 投资收益（损失以“-”填列）	3,751,190.44	-140,753.65
其中：股票投资收益	11,531,218.37	-140,753.65
基金投资收益	0.00	0.00
债券投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
贵金属投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	-7,855,420.00	0.00
股利收益	75,392.07	0.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	242,824.53	115,140.71
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
5. 其他收入（损失以“-”填列）	0.00	0.00
减：二、费用	1,342,900.95	31,975.50
1. 管理人报酬	0.00	0.00
2. 托管费	74,040.72	7,150.00
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 外包服务费	73,765.72	3,575.00
5. 交易费用	1,195,094.51	20,850.50
6. 利息支出	0.00	0.00

其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
7. 其他费用	0.00	400.00
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	2,878,316.57	-35,122.40
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	2,878,316.57	-35,122.40

6.3 所有者权益变动表

单位：元

项目	本期 2016-01-01 至 2016-12-31		
	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）	22,241,762.05	-96,845.56	22,144,916.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	2,878,316.57	2,878,316.57
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	82,968,141.07	-1,058,150.22	81,909,990.85
其中：1. 基金申购款	91,175,761.61	-1,358,847.30	89,816,914.31
2. 基金赎回款	-8,207,620.54	300,697.08	-7,906,923.46
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）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	105,209,903.12	1,723,320.79	106,933,223.91
项目	上年度可比期间 2015-01-01 至 2015-12-31		
	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）	1,000,038.89	0.00	1,000,038.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	-35,122.40	-35,122.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	21,241,723.16	-61,723.16	21,180,000.00
其中：1. 基金申购款	21,241,723.16	-61,723.16	21,180,000.00
2. 基金赎回款	0.00	0.00	0.00
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）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	22,241,762.05	-96,845.56	22,144,916.49

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 (XX 元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	71,620,991.00	67.17
	其中：普通股	71,620,991.00	67.17
	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	6,289,233.74	5.90
8	其他各项资产	28,709,979.68	26.93
	合计	106,620,204.42	100.00

7.2 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	3,234,399.00	3.03
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	42,261,729.00	39.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,262,824.00	7.75
E	建筑业	3,220,278.00	3.02
F	批发和零售业	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	6,420,704.00	6.02
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	1,709,125.00	1.60
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	6,511,932.00	6.11
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	71,620,991.00	67.20