

信复创值 5 号基金 2021 年第 3 季度报告

1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	信复创值 5 号基金
基金编码	S83733
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）	中国银河证券股份有限公司
投资顾问（如有）	-
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2015 年 10 月 27 日
期末基金总份额（万份）/ 期末基金实缴总额（万元）	3,943.354918
投资目标	控制风险，长期复利，追求风险调整后的收益。
投资策略	-
业绩比较基准（如有）	-
风险收益特征	中高风险

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	-24.07	-	-	-
自基金合同生效 起至今	15.80	-	-	-

无分级 二级基金 三级基金

信复创值 5 号 A 级级基金净值表现

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 (%)
-	-	-	-	-

信复创值 5 号 B 级级基金净值表现

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 (%)
-	-	-	-	-

3、主要财务指标

金额单位：元

项目	2021年7月1日至2021年9月30日(元)
本期已实现收益	-188,939.84
本期利润	-14,491,869.73
期末基金净资产	45,648,976.02
报告期期末单位净值	1.1580

信复创值5号A级基金主要财务指标

金额单位：元

项目	2021年7月1日至2021年9月30日(元)
本期已实现收益	0.0000
本期利润	0.0000
期末基金净资产	0.00
报告期期末单位净值	0.0000

信复创值5号B级基金主要财务指标

金额单位：元

项目	2021年7月1日至2021年9月30日(元)
本期已实现收益	0.0000
本期利润	0.0000
期末基金净资产	0.00
报告期期末单位净值	0.0000

4、投资组合情况

4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

项目		金额
现金类资产	银行存款	1,495,643.12
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	0.00
	其中：优先股	0.00
	其他股权类投资	-
上市公司定向增发投资	上市公司定向增发股票投资	0.00
新三板投资	新三板挂牌企业投资	0.00
境内证券投资规模	结算备付金	10,010.00
	存出保证金	0.00
	股票投资	7,324,542.00
	债券投资	0.00
	其中：银行间市场债券	0.00
	其中：利率债	0.00

	其中：信用债	0.00
	资产支持证券	0.00
	基金投资（公募基金）	0.00
	其中：货币基金	0.00
	期货及衍生品交易保证金	0
	买入返售金融资产	0.00
	其他证券类标的	-
资管计划投资	商业银行理财产品投资	-
	信托计划投资	-
	基金公司及其子公司资产管理计划投资	-
	保险资产管理计划投资	-
	证券公司及其子公司资产管理计划投资	-
	期货公司及其子公司资产管理计划投资	-
	私募基金产品投资	-
	未在协会备案的合伙企业份额	-
另类投资	另类投资	-
境内债权类投资	银行委托贷款规模	-
	信托贷款	-
	应收账款投资	-
	各类受（收）益权投资	-
	票据（承兑汇票等）投资	-
	其他债权投资	-
境外投资	境外投资	-
其他资产	其他资产	应收股利#0.00；应收利息#103.91；应收申购款#0.00；其他应收款#0.00；待摊费用#0.00；证券清算款#0.00
基金负债情况	债券回购总额	0.00
	融资、融券总额	0.00
	其中：融券总额	0.00
	银行借款总额	0.00
	其他融资总额	-

4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

4.2.1 报告期末按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	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	--------------

A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	3,316,401.00	7.27
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	4,008,141.00	8.78
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
S	综合	0.00	0.00
	合计	7,324,542.00	16.05

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（%）
-	-	-
-	-	-
合计	0.00	0.00

5、基金份额变动情况

单位：万份/万元

报告期期初基金份额总额	3,972.996042
报告期期间基金总申购份额	0
减：报告期期间基金总赎回份额	29.641124
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	3,943.354918

信复创值 5 号 A 级级基金份额变动情况

单位：万份/万元

报告期期初基金份额总额	0
报告期期间基金总申购份额	0
减：报告期期间基金总赎回份额	29.641124
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	3,428.589887

信复创值 5 号 B 级级基金份额变动情况

单位：万份/万元

报告期期初基金份额总额	0
报告期期间基金总申购份额	0
减：报告期期间基金总赎回份额	0
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	514.765031

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。注册资本人民币 1000 万元，实缴 1000 万元。截至本报告期末，公司共管理 12 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 9 号私募证券投资基金、信复创值 9 号私募证券投资基金 A、信复创值立勋进取私募证券投资基金、信复创值立勋进取 1 号私募证券投资基金、信复创值新起点私募证券投资基金、信复创值灵活配置 1 号私募证券投资基金、信复创值灵活配置 2 号私募证券投资基金、信复创值价值平衡私募证券投资基金、信复创值 8 号私募证券投资基金。

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. 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 2021 年 09 月 30 日，基金单位净值为 1.1580。

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。托管人复核说明：本基金托管人按照相关法律法规、基金合同的规定，对本基金在本报告中的财务数据进行了复核。对按照规定应由托管人复核的数据，托管人无异议。

信息披露报告是否经托管机构复核：是