

# 私募基金信息披露季报表

## 1、基金概况

项目	信息
基金名称	信复创值7号私募证券投资基金
基金编码	SK1874
基金管理人	北京信复创值投资管理有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2017-05-17
报告期末基金份额总额	15,000,000.00
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	本基金的投资策略可概括为量化思维下的主动管理，基金将利用量化选股、量化择时、量化对冲等多个模型轮动操作，以达到控制风险，长期复利，获取风险调整后收益的投资目的。
业绩比较基准	无
风险收益特征	本基金不承诺保本及最低收益，属预期风险【高】、预期收益【高】的投资品种，适合具有相应风险识别、评估、承受能力的合格投资者。

## 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	-3.44	0.42	-	-
自基金成立起至今	-1.80	0.38	-	-

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-上级度末累计净值)/上级度末净值

## 3、主要财务指标

项目	净值增长率
本期已实现收益	-559,279.2
本期利润	-524,181.79
期末基金资产净值	14,728,854.51
期末基金份额净值	0.982

备注

1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 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	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	11,479,010.00	77.45
	其中:普通股	11,479,010.00	77.45
	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	1,631,145.60	11.01
	其中:远期	-	-
	期货	1,631,145.60	11.01
	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	1,711,295.26	11.55
8	其他	5.75	-
	合计	14,821,456.61	100.00

#### 备注

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

本报表“金融衍生品投资”下的“期货”仅列示基金持有期货合约时被占用的保证金金额,不代表期货合约的实际市值。如需了解期货合约投资情况,见管理人披露的《期货合约持仓明细情况表》。

##### 4.2.1、报告期末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	占基金总净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,376,801.00	50.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	559,200.00	3.80
G	交通运输、仓储和邮政业	2,984,569.00	20.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术	332,816.00	2.26

	术服务业		
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	225,624.00	1.53
S	综合	-	-
	合计	11,479,010.00	77.94

备注

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

#### 4.2.2、报告期末行业分类的股票投资组合

金额单位:元

行业类别	公允价值（人民币）	占基金总净值的比例(%)
港股通	-	-
合计	-	-

#### 5、基金份额变动情况

单位：份

项目	2017-07-01至2017-09-30
报告期期初基金份额总额	15,000,000.00
报告期期间基金总申购份额	-
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）	-
报告期末基金份额总额	15,000,000.00

备注

如果本报告期间发生红利再投业务，则总申购份额中包含该业务。

#### 6、管理人报告

##### 6.1 高管、基金经理及其关联基金经验

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。

## 6.2 基金运作合规守信情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《私募投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、基金合同等规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 6.3 基金投资策略和业绩表现

截至2017年9月29日，基金单位净值为0.9820。

## 6.4 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。

## 6.5 基金估值程序

截止到报告期末，本管理人委托国泰君安证券股份有限公司为本基金提供估值核算服务。对于与基金资产有关的估值与会计核算问题，经相关当事人在平等基础上充分讨论后，达成一致意见。

- 1、本基金成立前，本管理人协调本基金其他当事人商定本基金的估值与会计核算方法。
- 2、在本基金的存续期内，本基金管理人定期评估基金估值与会计核算方法的合理性。
- 3、在本基金的运作过程中，经济环境发生重大变化且对基金资产的估值产生重大影响的，由本管理人协调本基金其他当事人采取必要措施，调整估值方法。

## 6.6 基金运作情况和运用杠杆情况

本基金无运用杠杆情况。

本基金本报告期初基金单位净值1.017元，期末基金单位净值0.982元，期初基金累计单位净值1.017元，期末基金累计单位净值0.982元，本报告期内基金累计单位净值增长率为-3.44%。

## 6.7 基金投资收益分配和损失承担情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 6.8 可能存在的利益冲突

本基金本报告期内不存在利益冲突。

## 6.9 托管人意见

本报告期内，托管人根据《私募投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、基金合同等规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督。

报告期内，管理人在本基金的投资运作合规守信、净值计算、基金份额申购赎回价格、基金费用开支及利润分配等情况上，托管人未发现管理人存在损害份额持有人利益的行为。