

附表 2 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 5 号基金
基金编号	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
基金运作方式	开放式
基金合同生效日期	2015-10-27
报告期末基金份额总额	130,441,892.54
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	“控制风险，长期复利，获取风险调整后的收益”是公司的投资理念。
业绩比较基准（如有）	沪深 300
风险收益特征	中

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)
当季	-1.31			
自基金合同生效起 至今	-2.20			

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

3、主要财务指标

单位：元

项目	2017-04-01 至 2017-06-30(元)
本期已实现收益	-5,111,274.42
本期利润	-2,561,049.28
期末基金资产净值	127,626,607.76
期末基金份额净值	0.978

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	120,662,868.47	94.50
	其中：普通股	120,662,868.47	94.50
	存托凭证		
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		
4	金融衍生品投资	0.00	0.00
	其中：远期		
	期货		
	期权	0.00	0.00
	权证		
5	买入返售金融资产	6,800,068.00	5.33
	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	228,762.19	0.18
8	其他各项资产	172.66	0.00
	合计	127,691,871.32	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		
B	采矿业		
C	制造业	61,523,782.25	48.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,915,434.00	9.34
E	建筑业		
F	批发和零售业	4,457,238.00	3.49
G	交通运输、仓储和邮政业	23,598,666.00	18.49
H	住宿和餐饮业		
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,393,524.00	1.09
J	金融业		
K	房地产业	12,125,876.26	9.50
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	5,648,347.96	4.43
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		
S	综合		
	合计	120,662,868.47	94.54

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 (%)
A: 基础材料		
B: 消费者非必需品		
C: 消费者常用品		
D: 能源		
E: 金融		
F: 医疗保健		
G: 工业		

H:信息技术		
I:电信服务		
J:公用事业		
K:建筑		
合计		

5、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	105,637,579.34
报告期期间基金总申购份额	66,176,481.16
减：报告期期间基金总赎回份额	41,372,167.96
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	130,441,892.54

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、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，本基金单位净值为0.978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。