

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	信复创值稳健 1 号私募投资基金
基金编号	SM9932
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）	中信证券股份有限公司
投资顾问（如有）	
基金运作方式	开放式
基金合同生效日期	2016-10-27
报告期末基金份额总额	201,050,019.44
投资目标	控制风险，长期复利，获取风险调整后的收益。
投资策略	利用量化对冲方法保护底仓安全，利用网下申购新股获取较为稳定的打新收益。
业绩比较基准（如有）	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【中高】、预期收益【中高】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	1.64			
自基金合同生效起至今	-0.60			

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
本期已实现收益	-6,167,361.04
本期利润	3,346,826.60
期末基金资产净值	199,925,486.00
期末基金份额净值	0.994

4、投资组合情况

4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

	金额	占基金总资产的
--	----	---------

序号	项目	(××元)	比例(%)
1	权益投资	57,012,244.05	28.48
	其中：普通股	57,012,244.05	28.48
	存托凭证		
2	基金投资	109,360,791.99	54.63
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		
	其中：远期		
	期货		
	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	7,643,465.94	3.82
	其他	26,154,441.51	13.07
	合计	200,170,943.49	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	40,664,220.05	20.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,973,954.00	2.49
E	建筑业		
F	批发和零售业	1,262,664.00	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	9,579,182.00	4.79
H	住宿和餐饮业		
I	信息传输、软件和信息技术服务业		
J	金融业		
K	房地产业	532,224.00	0.27
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		
S	综合		
	合计	57,012,244.05	28.52

--	--	--	--

4.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

金额单位：元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
------	------	--------------

5、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	201,050,019.44
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	201,050,019.44

6、管理人报告

（如报告期内高管、基金经理及其关联基金经验、基金运作合规守信情况、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、内部基金监察稽核工作、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 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 0.994 元。

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.994 元，本报告期份额净值增长率为 1.64%。

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。