

信复创值价值平衡私募证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

1、基金基本情况

| 项目 | 信息 |
|------------------------------|--|
| 基金名称 | 信复创值价值平衡私募证券投资基金 |
| 基金编码 | SQB637 |
| 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 |
| 基金成立日期 | 2021 年 4 月 19 日 |
| 期末基金总份额（万份）/ 期末基金实缴总额（万元） | 3,253.305773 |
| 投资目标 | 在深入研究的基础上构建投资组合，力争实现基金资产的持续稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金以价值投资为基础，积极的投资组合管理为手段，并通过有效的风险防范措施，追求基金资产的长期、稳定增值，力争实现中长期基金资产的持续稳健增值。 |
| 业绩比较基准（如有） | 无 |
| 风险收益特征 | 本基金属于 R4 风险等级的投资品种，适合风险识别、评估、承受能力为 C5, C4 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 | -5.19 | | | |
| 自基金合同生 效起至今 | -14.03 | | | |

备注：

无分级 二级基金 三级基金

A 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 (%) |
|----------------|--------------|------------------|-------------------|-------------------------|
| 当季 | -5.4 | | | |
| 自基金合同生 效起至今 | -15.09 | | | |

B 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 (%) |
|------------|-----------|--------------|---------------|------------------|
| 当季 | -5.16 | | | |
| 自基金合同生效起至今 | -13.88 | | | |

3、主要财务指标

金额单位：元

| 项目 | 2022年7月1日至2022年9月30日 (元) |
|-----------|--------------------------|
| 本期已实现收益 | -669,672.14 |
| 本期利润 | -1,534,416.33 |
| 期末基金净资产 | 27,967,950.99 |
| 报告期期末单位净值 | 0.8597 |

备注：

A 级基金主要财务指标

金额单位：元

| 项目 | 2022年7月1日至2022年9月30日 (元) |
|-----------|--------------------------|
| 本期已实现收益 | -89,051.41 |
| 本期利润 | -194,153.03 |
| 期末基金净资产 | 3,394,095.40 |
| 报告期期末单位净值 | 0.8491 |

B 级基金主要财务指标

金额单位：元

| 项目 | 2022年7月1日至2022年9月30日 (元) |
|-----------|--------------------------|
| 本期已实现收益 | -580,620.73 |
| 本期利润 | -1,340,263.30 |
| 期末基金净资产 | 24,573,855.59 |
| 报告期期末单位净值 | 0.8612 |

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 | 58.99 |
| 境内未上市、未挂牌公司股权投资 | 股权投资 | |
| | 其中：优先股 | |
| | 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 | |
| 新三板投资 | 新三板挂牌企业投资 | |
| 境内证券投资规模 | 结算备付金 | 53,355.81 |
| | 存出保证金 | |
| | 股票投资 | 8,445,431.89 |
| | 债券投资 | |
| | 其中：银行间市场债券 | |
| | 其中：利率债 | |
| | 其中：信用债 | |
| | 资产支持证券 | |
| | 基金投资（公募基金） | 1,174,500 |
| | 其中：货币基金 | |
| | 期货及衍生品交易保证金 | |
| | 买入返售金融资产 | 18,300,183 |
| 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#10,077.46; |
| 基金负债情况 | 债券回购总额 | |
| | 融资、融券总额 | |
| | 其中：融券总额 | |
| | 银行借款总额 | |

| | |
|--|--------|
| | 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 | 2,188,765.00 | 7.83 |
| 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 | 831,600.00 | 2.97 |
| 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 | 716,900.00 | 2.56 |
| 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 | 3,737,265.00 | 13.36 |

备注：

该项目根据中国证券监督管理委员会发布的《上市公司行业分类指引（2012年修订）》中的分类指导进行填报

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 (%) |
|---------|--------------|---------------|
| 信息技术 | 2,195,760.00 | 7.85 |
| 公用事业 | 0.00 | 0.00 |
| 医疗保健 | 1,893,934.49 | 6.77 |
| 基础材料 | 0.00 | 0.00 |
| 工业 | 0.00 | 0.00 |
| 房地产 | 0.00 | 0.00 |
| 消费者常用品 | 618,472.40 | 2.21 |
| 消费者非必需品 | 0.00 | 0.00 |
| 电信服务 | 0.00 | 0.00 |

| | | |
|----|--------------|-------|
| 能源 | 0.00 | 0.00 |
| 金融 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 4,708,166.89 | 16.83 |

备注：

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 | 3,253.305773 |
| 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） | 3,253.305773 |

备注：

A 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 | 399.741345 |
| 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） | 399.741345 |

B 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 | 2,853.564428 |
| 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） | 2,853.564428 |

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 13 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 8 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、信复创值行稳致远 1 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。

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 2022 年 09 月 30 日，基金单位净值为 0.8597，分级基金 A 单位净值为：0.8491，分级基金 B 单位净值为：0.8412。

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。

信息披露报告是否经托管机构复核：是