

# 信复创值勇进 1 号私募证券投资基金 2024 年第 2 季度报告

## 1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	信复创值勇进 1 号私募证券投资基金
基金编码	SAJF96
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	2024 年 4 月 9 日
期末基金总份额（万份）/ 期末基金实缴总额（万元）	1,100
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	本基金使用主观与量化双轮驱动的组合投资策略。将近 30 年主观投资所形成的投资理念及实战经验融入多因子选股模型及择时模型，通过选股模型构建有逻辑的投资组合获取 Alpha 收益，通过择时模型获取 Beta 收益；将主观思维及多年量化实战经验形成的对冲模型作为补充，通过多头暴露比例的调节，剥离系统性风险，降低投资组合的波动性。上述内容仅为基金管理人针对本基金全部或部分投资标的对应投资策略的说明，不构成对本基金投资范围、投资比例及限制或其他投资风控措施的解释、限缩或补充，也不代表本基金仅投资、必然投资或持续投资于上述内容中提及的特定投向和/或标的品种，基金管理人有权在符合本合同约定的投资范围、投资比例及限制的范围内选择投资任意一个或多个标的品种。
业绩比较基准（如有）	无
风险收益特征	本基金属于 R5 风险等级的投资品种，适合专业投资者和风险识别、评估、承受能力为 C5 的普通合格投资者。上述关于本基金的风险等级由募集机构评定。募集机构应确保所有委托人已符合投资者适当性的相关要求，管理人应自行负责确保和控制本基金的投资情况（包括但不限于管理人选择的投资标的、投资比例控制等整体综合的投资情况）符合本基金的风险等级，托管人不对前述事宜进行任何监督或承担任何责任。

## 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	-5.67			
自基金合同生效起至今	-5.67			

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	0			
自基金合同生效起至今	0			

#### 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	-5.67			
自基金合同生效起至今	-5.67			

### 3、主要财务指标

金额单位：元

项目	2024年4月1日至2024年6月30日 (元)
本期已实现收益	-284,212.05
本期利润	-623,723.71
期末基金净资产	10,376,276.29
报告期期末单位净值	0.9433

备注：

#### A 级基金主要财务指标

金额单位：元

项目	2024年4月1日至2024年6月30日 (元)
本期已实现收益	0.00
本期利润	0.00
期末基金净资产	0.00
报告期期末单位净值	0.0000

#### B 级基金主要财务指标

金额单位：元

中信中证印章(如有)  
仅对本报告中的财务数据负责

项目	2024年4月1日至2024年6月30日（元）
本期已实现收益	-284,212.05
本期利润	-623,723.71
期末基金净资产	10,376,276.29
报告期期末单位净值	0.9433

#### 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	2,700.62
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	741,780.86
	存出保证金	689,347.2
	股票投资	8,942,927.11
	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）	
	其中：货币基金	
	期货及衍生品交易保证金	689,347.2
	买入返售金融资产	
	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	

中信中证印章（如有）  
仅对本报告中的财务数据负责

	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	
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	9,876.00	0.10
B	采矿业	154,756.00	1.49
C	制造业	7,252,930.60	69.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	146,476.00	1.41
E	建筑业	109,566.00	1.06
F	批发和零售业	278,131.20	2.68
G	交通运输、仓储和邮政业	125,811.00	1.21
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	647,523.31	6.24
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	62,397.00	0.60
L	租赁和商务服务业	48,552.00	0.47
M	科学研究和技术服务业	89,383.00	0.86
N	水利、环境和公共设施管理业	17,525.00	0.17
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	8,942,927.11	86.19

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（%）
合计		

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	1,100
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）	1,100

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	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）	0

#### 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	1,100
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）	1,100

### 6、管理人报告

--

信息披露报告是否经托管机构复核：是