

北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证 券投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：北信瑞丰基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 27 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 03 月 27 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	43
§8 基金份额持有人信息	44

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	44
§10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
§12 备查文件目录.....	49
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	北信瑞丰健康生活主题灵活配置
基金主代码	001056
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 3 月 27 日
基金管理人	北信瑞丰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,443,083,463.73 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置，重点投资于可以代表未来健康生活发展趋势的上市公司，从中挑选三个方向即健康饮食类的农林牧渔、餐饮行业，文明生活类的体育、传媒、公共园林行业，健康辅助类的医疗环保行业，优中选优，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金管理人 的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行各大类资产中的个股、个券精选。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四部分组成。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60% +中证综合债券指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票基金，高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		北信瑞丰基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孟曦	蒋松云
	联系电话	010-68619390	010-66105799
	电子邮箱	mengxi@bxrfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4000617297	95588

传真	010-68619300	010-66105798
注册地址	北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市海淀区首体南路 9 号主语国际大厦四号楼 3 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100048	100140
法定代表人	周瑞明	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bxrfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	北信瑞丰基金管理有限公司	北京市海淀区首体南路 9 号主语国际 4 号楼 3 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 3 月 27 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	351,838,272.58
本期利润	200,442,546.01
加权平均基金份额本期利润	0.0879
本期加权平均净值利润率	8.10%
本期基金份额净值增长率	6.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	92,410,481.99
期末可供分配基金份额利润	0.0640
期末基金资产净值	1,535,493,945.72
期末基金份额净值	1.064
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	6.40%

注：1、本基金基金合同自 2015 年 3 月 27 日起生效，至 2015 年 6 月 30 日未满六个月；

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；

3、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）；

4、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

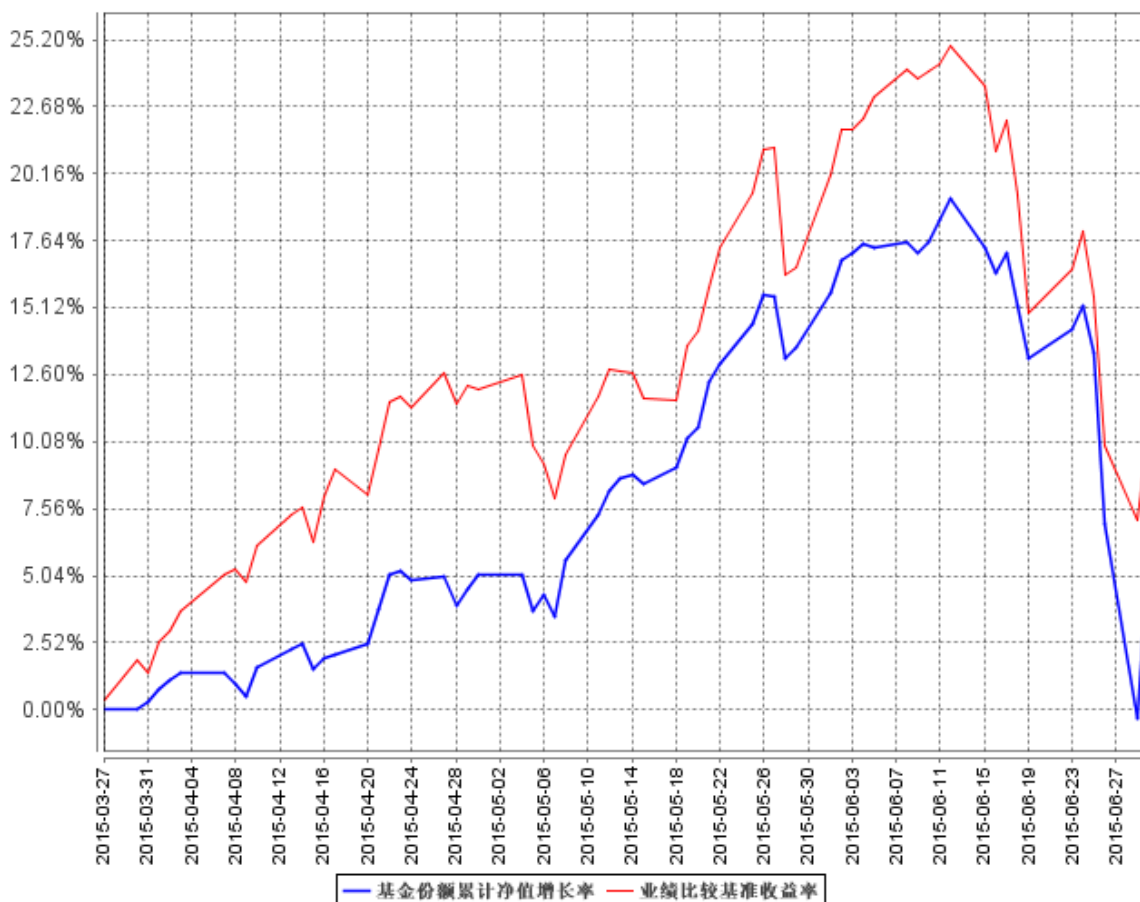
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.34%	2.66%	-4.74%	2.11%	-1.60%	0.55%
过去三个月	6.08%	1.68%	9.62%	1.58%	-3.54%	0.10%
自基金合同生效起至今	6.40%	1.64%	11.12%	1.55%	-4.72%	0.09%

注：本基金的业绩比较基准为中证 800 指数收益率×60% + 中证综合债券指数收益率×40%。中证 800 指数是由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场统一指数，它的样本选自沪深两个证券市场。中证 800 指数成分股覆盖了中证 500 和沪深 300 的所有成分股，综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况，具有一定权威性，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。中证综合债券指数是一个是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同于 2015 年 03 月 27 日生效，截止报告期末未满六个月。

3.3 其他指标

注：无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

北信瑞丰基金管理有限公司成立于 2014 年 3 月初，是经中国证监会证监许可[2014]265 号文批准，由北京国际信托有限公司与莱州瑞海投资有限公司两家股东共同发起设立的基金公司。公司注册资本 17,000 万人民币，总部设在北京，是一家从事基金募集、基金销售、资产管理以及中国证监会许可的其他业务的专业资产管理公司。

北信瑞丰基金着力打造具有高水平的投研团队，公司高管和主要投资管理人员的金融相关从

业年限均在 10 年以上，拥有丰富的管理和证券投资实战经验。公司秉承价值投资理念和勤勉尽责的职业道德，严守风险控制底线，遵循份额持有人利益优先、最大化原则，制定了严格的投资管理流程和制度。公司将注重开发权益类、固定收益类和资产配置类等特定资产管理产品，着眼于塑造“诚信、专业、稳健、创新”的行业品牌形象，力争为投资人创造持续良好的投资回报。北信瑞丰追求北京信托所恪守的“受人之托、代人理财”承诺，推崇“简洁、快速、有效”的经营管理理念，倡导“勤奋、坚韧”的企业文化，秉承投资人价值最大化的经营宗旨，坚持以专业的态度服务于投资者，为把公司打造成“投资者值得信任的投资平台、投资者丰盈财富的资管机构”而努力奋斗！

北信瑞丰基金旗下目前管理 6 只开放式基金产品，分别为北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金、北信瑞丰宜投宝货币市场基金、北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、北信瑞丰现金添利货币市场基金、北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金、北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
于军华	基金经理	2014 年 9 月 30 日	-	4	CPA，中国人民大学世界经济经济学硕士毕业。 原国家信息中心经济咨询中心高级项目分析师，宏源证券研究所行业分析师，擅长公司基本面分析，2014 年 4 月加入北信瑞丰基金管理有限公司投资研究

					部，现任北信瑞丰无限互联灵活配置基金基金经理，北信瑞丰健康生活灵活配置基金基金经理。
高峰	副总经理	2014年5月 26日	-	15	北京大学光华管理学院国民经济管理硕士，20年金融从业经验，15年证券投资研究经验。曾任中国对外经济贸易信托投资公司计划财务部财务科经理，中化总公司财务部综合部经理，中国对外经济贸易信托有限公司资产管理部副总经理、证券业务部总经理，宝盈基金管理有限公司董事，宝盈基金管理有限公司总经

					理助理、 投资部总 监、基金 经理、公 司投委会 主席，现 任北信瑞 丰基金管 理有限公 司副总经 理。
--	--	--	--	--	--

注：证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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。本报告期内，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、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《北信瑞丰基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度市场中间略有调整，但整体是一个快速向上的态势，二季度的市场则走出了标准的倒

V 型反转的行情，而且和 6 月下旬的下跌比起来，前几个月的上涨已经成为标准的“慢牛”。中旬准备季度报告草稿的时候市场一片看涨之声，我们的主要内容还在试图说明泡沫过大的潜在危险，现在却要面临暴跌对实体经济和投资者信心巨大的打击。毋庸讳言，暴跌的根本原因是因为前期的暴涨，但这种短期内巨幅的股市只能起到财富再分配的效果，对实体经济不仅无益，而且有害，加上市场高位的时候中小个人投资者大量入市，暴跌的结果已经成为各种投机力量对中小个人投资者赤裸裸的掠夺。这一轮的暴涨暴跌过后，值得我们监管机构、新闻媒体、研究机构以及机构投资者反思的应该非常多。

本基金正式成立于今年 3 月底，4 月快速上涨时正是基金的建仓期，大部分股票的估值即使仍处于合理的区间，但也已不便宜，为控制成本，基金在建仓期内始终维持了相对较低的股票仓位，个股方面，主要选择历史涨幅较低、估值也相对合理的制药企业的龙头公司、文化和传媒企业中有国企改革预期的上市公司。二季度末由于基金打开申购赎回仓位有一个被动上升的过程，正好遇到 6 月底的大幅下跌，基金净值也遭受到一定损失。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 6.4%，波动率 1.64%，业绩比较基准收益率 11.12%，波动率 1.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

关于下半年的市场环境，根据目前的情况，对于宏观经济走势、货币财政政策等的分析对于投资的指导意义已经非常有限，何况我们并不认为上述基本面的因素下半年会发生重大的变化。我们一直认为，中国经济不可能长期保持在 8% 以上的增长速度，但在以往依靠房地产、基建投资、劳动密集型产品出口拉动经济增长的情况下，收入分配极度不均，低于 8% 增速意味着大部分国民收入的绝对水平是下降的，会影响到就业和社会稳定。但随着房地产、出口对经济增长在经济增长中的贡献降低，以及收入分配改革的深化，可以保持社会稳定、保证低收入人群收入不下降的经济增速在逐步降低，而且这种经济增速的下降并不必然表现为企业盈利增速的降低。我们的一贯观点是，中国经济和社会的长期发展，既有空间，又有动力，即使不考虑技术进步的因素，中国经济仍有空间和能力保持 10 年以上较快速度的发展，这是对市场保持长期乐观判断的基础。而经济增速下行、流动性宽松、房地产市场及实体经济投资机会缺乏、决策机构希望保持一个活跃的市场起到降低融资成本、刺激社会投资的效果等，则形成了短期市场持续走强的直接动力。虽然 6 月中下旬开始的市场大跌使许多投资者的市场判断发生了根本性转变，但我们认为上述支撑本轮牛市的基础并没有发生任何改变。不过一定要认识到股票市场不是一个短期可以获

得暴利的地方，建立理性的盈利预期，树立起长期价值投资的理念，是在股市中获得长期稳定收益最重要的条件。

具体到本基金投资主题——广义健康生活领域，可以说是很多公司已经具有很强的投资价值。这一轮下跌是泥沙俱下式的，除了已停牌的股票及部分大盘指标股，其他所有股票不论行业、不分估值跌幅都差不多，医药、消费等行业公司涨幅本来就落后于大盘，现在很多公司股价已经回到去年下半年的水平，由于业绩增长，估值较去年下半年还要便宜。价值投资是我们一贯坚持的理念，我们所说的价值投资是选择优秀的成长企业根据估值水平进行投资，所以经常会表现为在市场高涨时更多地看到投资风险，而在市场低迷时更为关注投资机会。医药消费行业受周期影响不大，增长的确定性强，优质公司有很强的持续成长潜力，所以本基金下半年的投资会更为积极，主要方向是估值合理的优质医药、消费品公司以及有符合本基金投资主题并有国企改革预期的公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2008]38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

本基金管理公司设立的估值小组，成员由总经理、副总经理、督察长、基金运营部总监、基金经理及基金会计组成。估值小组负责确定基金估值程序及标准以及对突发事件的处理。

基金运营部根据估值小组的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金和理财类基金）。

自2015年3月30日起，公司按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值价格，对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人中国工商银行在对北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金的管理人——北信瑞丰基金管理有限公司在北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对北信瑞丰基金管理有限公司编制和披露的北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金 2015 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	83,388,543.70
结算备付金		87,928,448.45
存出保证金		822,367.21
交易性金融资产	6.4.7.2	1,365,825,451.23
其中：股票投资		1,364,421,653.23
基金投资		-
债券投资		1,403,798.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-

衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		147,092,001.53
应收利息	6.4.7.5	196,192.62
应收股利		-
应收申购款		190,147.79
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,685,443,152.53
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		140,289,493.94
应付管理人报酬		3,089,130.19
应付托管费		514,855.02
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	5,703,445.63
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	352,282.03
负债合计		149,949,206.81
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	1,443,083,463.73
未分配利润	6.4.7.10	92,410,481.99
所有者权益合计		1,535,493,945.72
负债和所有者权益总计		1,685,443,152.53

注：1、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.064 元，基金份额总额

1,443,083,463.73 份。

2、本基金基金合同自 2015 年 03 月 27 日起生效，至 2015 年 6 月 30 日未满六个月。

6.2 利润表

会计主体：北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 3 月 27 日(基金合同生 效日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		221,478,853.48
1.利息收入		8,337,619.28
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,072,762.63
债券利息收入		331.12
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		7,264,525.53
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		362,051,129.62
其中：股票投资收益	6.4.7.12	355,529,221.19
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	6,521,908.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-151,395,726.57
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,485,831.15
减：二、费用		21,036,307.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,644,813.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,607,468.82
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	9,782,383.21
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	1,642.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		200,442,546.01
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		200,442,546.01

注：本基金 2015 年 03 月 27 日成立，截止到报告期未满六个月，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	2,327,526,690.74	-	2,327,526,690.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	200,442,546.01	200,442,546.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-884,443,227.01	-108,032,064.02	-992,475,291.03
其中：1.基金申购款	1,303,875.06	143,865.24	1,447,740.30
2.基金赎回款	-885,747,102.07	-108,175,929.26	-993,923,031.33
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,443,083,463.73	92,410,481.99	1,535,493,945.72

注：本基金基金合同自 2015 年 03 月 27 日起生效，至 2015 年 6 月 30 日未满六个月，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

朱彦

基金管理人负责人

郭亚

主管会计工作负责人

孟曦

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 100 号《关于准予北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由北信瑞丰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金募集期限自 2015 年 3 月 6 日至 2015 年 3 月 24 日止。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,327,331,239.57 元，业经中喜会计师事务所(特殊普通合伙)中喜验字(2015)第 0114 号验资报告予以验证。经向中国

证监会备案,《北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 3 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,327,526,690.74 份基金份额,其中认购资金利息折合 195,451.17 份基金份额。本基金的基金管理人为北信瑞丰基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%,其中 80%以上的非现金基金资产投资于健康生活主题的上市公司证券;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%。 $\text{中证 800 指数收益率} \times 60\% + \text{中证综合债券指数收益率} \times 40\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金采用公历年度,即从每年 1 月 1 日至 12 月 31 日为一个会计期间。本报告期间为

2015 年 03 月 27 日（基金合同生效日）至 06 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	83,388,543.70
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	83,388,543.70

注：本基金基金合同自 2015 年 03 月 27 日起生效，至 2015 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,516,080,177.80	1,364,421,653.23	-151,658,524.57
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约				
债券	交易所市场	1,141,000.00	1,403,798.00	262,798.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,141,000.00	1,403,798.00	262,798.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,517,221,177.80	1,365,825,451.23	-151,395,726.57

注：本基金基金合同自 2015 年 03 月 27 日起生效，至 2015 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本年度末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	155,923.60
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	39,567.80
应收债券利息	331.12
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	370.10
合计	196,192.62

注：本基金基金合同自 2015 年 03 月 27 日起生效，至 2015 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	5,703,445.63
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,703,445.63

注：本基金基金合同自 2015 年 03 月 27 日起生效，至 2015 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	352,282.03
合计	352,282.03

注：本基金基金合同自 2015 年 03 月 27 日起生效，至 2015 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	2,327,526,690.74	2,327,526,690.74
本期申购	1,303,875.06	1,303,875.06
本期赎回(以“-”号填列)	-885,747,102.07	-885,747,102.07
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,443,083,463.73	1,443,083,463.73

注：1、本基金基金合同自 2015 年 03 月 27 日起生效，至 2015 年 6 月 30 日未满六个月。

2、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

3、本基金自 2015 年 3 月 6 日至 2015 年 3 月 24 日期间公开募集，基金合同生效日的基金份额总额为 2,327,526,690.74 份基金份额，其中认购资金利息折合 195,451.17 份基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	351,838,272.58	-151,395,726.57	200,442,546.01
本期基金份额交易	-129,606,607.00	21,574,542.98	-108,032,064.02

产生的变动数			
其中：基金申购款	191,848.79	-47,983.55	143,865.24
基金赎回款	-129,798,455.79	21,622,526.53	-108,175,929.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	222,231,665.58	-129,821,183.59	92,410,481.99

注：本基金基金合同自 2015 年 03 月 27 日起生效，至 2015 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	791,163.46
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	279,897.45
其他	1,701.72
合计	1,072,762.63

注：本基金基金合同自 2015 年 03 月 27 日起生效，至 2015 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,242,113,222.01
减：卖出股票成本总额	2,886,584,000.82
买卖股票差价收入	355,529,221.19

注：本基金基金合同自 2015 年 03 月 27 日起生效，至 2015 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月27日(基金合同生效日)至2015年 6月30日
股票投资产生的股利收益	6,521,908.43
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,521,908.43

注：本基金基金合同自2015年03月27日起生效，至2015年6月30日未满六个月。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年3月27日(基金合同生效日)至 2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-151,395,726.57
——股票投资	-151,658,524.57
——债券投资	262,798.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-151,395,726.57

注：本基金基金合同自2015年03月27日起生效，至2015年6月30日未满六个月。

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月27日(基金合同生效日)至 2015年6月30日
基金赎回费收入	2,485,831.15
合计	2,485,831.15

注：本基金基金合同自2015年03月27日起生效，至2015年6月30日未满六个月。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	9,782,383.21
银行间市场交易费用	-
合计	9,782,383.21

注：本基金基金合同自 2015 年 03 月 27 日起生效，至 2015 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	-
信息披露费	-
其他	400.00
银行费用	1,242.34
合计	1,642.34

注：本基金基金合同自 2015 年 03 月 27 日起生效，至 2015 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本报告期内，本基金不存在或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金不存在应披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
北信瑞丰基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
北京国际信托有限公司	基金管理人的控股股东
莱州瑞海投资有限公司	基金管理人的股东

注：关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。

债券交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。

债券回购交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月27日(基金合同生效日)至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,644,813.10	-
其中：支付销售机构的客户维护费	5,692,047.13	-

注：1、本基金基金合同自 2015 年 3 月 27 日起生效，至 2015 年 6 月 30 日未满六个月。

2、支付基金管理人北信瑞丰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5 % / 当年天数。

3、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产里列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月27日(基金合同生效日) 至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,607,468.82	-

注：1、本基金基金合同自 2015 年 3 月 27 日起生效，至 2015 年 6 月 30 日未满六个月。

2、支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金无关联方销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015年3月27日(基金合同生效日)至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
基金合同生效日（2015年3月27日）持有的基金份额	14,999,000.00	-
期初持有的基金份额	14,999,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	14,999,000.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.0394%	-

注：本基金基金合同自 2015 年 03 月 27 日起生效，至 2015 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期内未发生除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日		2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	83,388,543.70	635,239.86	-	-

注：1、本基金基金合同自 2015 年 03 月 27 日起生效，至 2015 年 6 月 30 日未满六个月。

2、本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000566	海南海药	2015 年 6 月 18 日	筹划重大事项	49.97	-	-	299,934	14,576,792.40	14,987,701.98	-

注：本基金截至 2015 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

至本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

至本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在定期存款和银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用产品投资流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
AAA	842,798.00	-
AAA 以下	561,000.00	-
未评级	-	-

合计	1,403,798.00	-
----	--------------	---

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金所持大部分证券在证券交易所上市和银行间同业市场交易，除 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于

市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	83,388,543.70	-	-	-	-	-	83,388,543.70
结算备付金	87,928,448.45	-	-	-	-	-	87,928,448.45
存出保证金	822,367.21	-	-	-	-	-	822,367.21
交易性金融资产	-	-	-	1,403,798.00	-	1,364,421,653.23	1,365,825,451.23
应收证券清算款	-	-	-	-	-	147,092,001.53	147,092,001.53
应收利息	-	-	-	-	-	196,192.62	196,192.62
应收申购款	-	-	-	-	-	190,147.79	190,147.79
资产总计	172,139,359.36	-	-	1,403,798.00	-	1,511,899,995.17	1,685,443,152.53
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	140,289,493.94	140,289,493.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,089,130.19	3,089,130.19
应付托管费	-	-	-	-	-	514,855.02	514,855.02
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,703,445.63	5,703,445.63
其他负债	-	-	-	-	-	352,282.03	352,282.03
负债总计	-	-	-	-	-	149,949,206.81	149,949,206.81
利率敏感度缺口	172,139,359.36	-	-	1,403,798.00	-	1,361,950,788.36	1,535,493,945.72

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于本期末，本基金成立不满一年，尚无足够经验数据。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的

影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,364,421,653.23	88.86	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,403,798.00	0.09	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,365,825,451.23	88.95	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于本期末，本基金成立不满一年，尚无足够经验数据。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层级金融工具公允价值

于 2015 年 06 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 1,350,276,749.25 元，属于第二层级的余额为 15,548,701.98 元，无属于第三层级的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 30 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值（附注 6.4.5.2），并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,364,421,653.23	80.95
	其中：股票	1,364,421,653.23	80.95
2	固定收益投资	1,403,798.00	0.08
	其中：债券	1,403,798.00	0.08
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	171,316,992.15	10.16
7	其他各项资产	148,300,709.15	8.80
8	合计	1,685,443,152.53	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	28,140,000.00	1.83
B	采矿业	1,635,059.25	0.11
C	制造业	739,328,257.54	48.15
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	259,710,807.06	16.91
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	160,477,014.72	10.45
J	金融业	49,170,309.38	3.20
K	房地产业	8,595,000.00	0.56
L	租赁和商务服务业	82,364,205.28	5.36
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	35,001,000.00	2.28
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	1,364,421,653.23	88.86

注：以上行业分类以 2015 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600976	武汉健民	3,784,373	128,820,056.92	8.39
2	002653	海思科	4,426,775	119,522,925.00	7.78
3	600637	百视通	2,299,834	96,777,014.72	6.30
4	600332	白云山	2,630,200	90,636,692.00	5.90
5	002432	九安医疗	2,304,417	64,523,676.00	4.20
6	000503	海虹控股	1,300,000	63,700,000.00	4.15
7	002707	众信旅游	567,447	53,476,205.28	3.48
8	002038	双鹭药业	870,400	49,308,160.00	3.21
9	601318	中国平安	600,077	49,170,309.38	3.20
10	300006	莱美药业	1,128,746	48,423,203.40	3.15
11	601607	上海医药	2,000,000	44,540,000.00	2.90
12	600422	昆明制药	1,199,902	44,312,380.86	2.89
13	300016	北陆药业	950,000	40,574,500.00	2.64
14	002412	汉森制药	1,599,920	40,397,980.00	2.63
15	002287	奇正藏药	1,000,000	38,710,000.00	2.52
16	600697	欧亚集团	1,234,143	38,233,750.14	2.49
17	300254	仟源医药	1,100,000	37,785,000.00	2.46
18	600600	青岛啤酒	799,996	37,271,813.64	2.43
19	000826	桑德环境	900,000	35,001,000.00	2.28
20	000078	海王生物	1,500,000	33,000,000.00	2.15
21	300289	利德曼	600,000	31,200,000.00	2.03
22	000919	金陵药业	1,600,000	31,168,000.00	2.03
23	300273	和佳股份	1,000,000	29,790,000.00	1.94
24	300178	腾邦国际	800,000	28,888,000.00	1.88
25	600467	好当家	3,000,000	28,140,000.00	1.83

26	600521	华海药业	600,000	18,750,000.00	1.22
27	600511	国药股份	300,000	15,117,000.00	0.98
28	000566	海南海药	299,934	14,987,701.98	0.98
29	600158	中体产业	300,000	8,595,000.00	0.56
30	603116	红蜻蜓	65,334	1,831,965.36	0.12
31	603979	金诚信	66,063	1,635,059.25	0.11
32	603085	天成自控	11,690	122,394.30	0.01
33	002773	康弘药业	500	11,865.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	315,528,842.90	20.55
2	601166	兴业银行	273,915,881.38	17.84
3	600637	百视通	234,404,634.66	15.27
4	002653	海思科	232,689,759.58	15.15
5	600976	武汉健民	196,592,431.03	12.80
6	600600	青岛啤酒	163,718,056.82	10.66
7	300273	和佳股份	140,759,268.19	9.17
8	300006	莱美药业	136,454,427.23	8.89
9	601288	农业银行	121,099,350.00	7.89
10	601988	中国银行	118,905,000.00	7.74
11	600158	中体产业	113,502,230.19	7.39
12	600511	国药股份	111,954,992.77	7.29
13	600332	白云山	104,585,322.27	6.81
14	002432	九安医疗	101,969,328.75	6.64
15	600422	昆明制药	98,241,108.36	6.40
16	601888	中国国旅	96,622,477.80	6.29
17	600030	中信证券	94,751,933.73	6.17
18	002707	众信旅游	93,732,757.09	6.10
19	300003	乐普医疗	90,082,491.83	5.87
20	000826	桑德环境	81,344,415.25	5.30
21	300254	仟源医药	74,334,715.26	4.84

22	000503	海虹控股	73,044,456.00	4.76
23	300081	恒信移动	68,273,087.72	4.45
24	300005	探路者	60,200,131.37	3.92
25	300288	朗玛信息	59,270,826.99	3.86
26	600521	华海药业	58,035,993.26	3.78
27	600832	东方明珠	54,179,524.79	3.53
28	300178	腾邦国际	52,465,130.27	3.42
29	002038	双鹭药业	52,460,744.00	3.42
30	601607	上海医药	48,762,186.60	3.18
31	002412	汉森制药	46,831,946.14	3.05
32	300289	利德曼	46,571,485.00	3.03
33	300144	宋城演艺	42,878,031.46	2.79
34	300016	北陆药业	42,572,987.00	2.77
35	600697	欧亚集团	42,004,632.00	2.74
36	002287	奇正藏药	39,928,060.00	2.60
37	000739	普洛药业	37,987,985.18	2.47
38	300204	舒泰神	37,830,311.74	2.46
39	300244	迪安诊断	37,652,157.78	2.45
40	000661	长春高新	36,441,611.04	2.37
41	000566	海南海药	36,380,326.15	2.37
42	000078	海王生物	36,284,696.46	2.36
43	000919	金陵药业	33,779,771.93	2.20
44	600594	益佰制药	31,822,396.88	2.07
45	300197	铁汉生态	31,821,664.46	2.07

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	275,457,448.04	17.94
2	601318	中国平安	274,093,200.31	17.85
3	600637	百视通	153,910,835.05	10.02
4	600600	青岛啤酒	139,119,218.60	9.06
5	002653	海思科	135,949,862.83	8.85
6	300273	和佳股份	131,352,347.51	8.55
7	600511	国药股份	122,332,488.80	7.97

8	600158	中体产业	119,760,342.81	7.80
9	601288	农业银行	116,892,190.00	7.61
10	300003	乐普医疗	115,542,046.60	7.52
11	601988	中国银行	114,832,973.56	7.48
12	601888	中国国旅	104,607,262.37	6.81
13	300006	莱美药业	94,792,596.00	6.17
14	600030	中信证券	91,912,120.14	5.99
15	300081	恒信移动	76,391,719.73	4.98
16	600832	东方明珠	67,596,480.59	4.40
17	300005	探路者	66,601,367.28	4.34
18	300288	朗玛信息	58,448,166.10	3.81
19	600976	武汉健民	54,534,040.80	3.55
20	600422	昆明制药	52,791,560.00	3.44
21	000826	桑德环境	51,571,814.06	3.36
22	300144	宋城演艺	47,641,859.30	3.10
23	300244	迪安诊断	46,315,611.38	3.02
24	600521	华海药业	45,766,462.52	2.98
25	000739	普洛药业	43,033,169.04	2.80
26	300204	舒泰神	41,137,399.59	2.68
27	300254	仟源医药	40,575,116.00	2.64
28	000661	长春高新	39,427,347.32	2.57
29	600351	亚宝药业	38,212,756.81	2.49
30	300197	铁汉生态	37,441,023.18	2.44
31	600594	益佰制药	34,707,136.96	2.26
32	002707	众信旅游	33,023,648.00	2.15

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,402,664,178.62
卖出股票收入（成交）总额	3,242,113,222.01

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	842,798.00	0.05
8	其他	561,000.00	0.04
9	合计	1,403,798.00	0.09

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	5,800	842,798.00	0.05
2	132002	15 天集 EB	5,610	561,000.00	0.04

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：（1）本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金本报告期内未进行股指期货交易。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：（1）本基金本报告期末未持有国债期货。

（2）本基金本报告期内未进行国债期货交易。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	822,367.21
2	应收证券清算款	147,092,001.53
3	应收股利	-
4	应收利息	196,192.62
5	应收申购款	190,147.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	148,300,709.15

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	842,798.00	0.05

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
15,172	95,114.91	21,445,353.14	1.49%	1,421,638,110.59	98.51%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	326,090.93	0.0226%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、该只基金的基金经理未持有该只基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年3月27日）基金份额总额	2,327,526,690.74
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,303,875.06
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	885,747,102.07
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份 额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,443,083,463.73

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人本报告期内没有发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
联讯证券	2	1,071,272,230.13	14.02%	439,647.59	7.71%	新增
国都证券	1	275,463,255.62	3.60%	195,688.11	3.43%	新增
国联证券	1	1,604,021,726.54	20.99%	1,139,497.62	19.98%	新增
信达证券	2	1,010,216,841.19	13.22%	717,657.93	12.58%	新增
东兴证券	1	832,573,516.08	10.89%	757,973.87	13.29%	新增
中信建投	2	1,911,848,382.28	25.02%	1,740,543.24	30.52%	新增
招商证券	1	234,836,952.20	3.07%	213,795.13	3.75%	新增
川财证券	1	359,262,745.12	4.70%	255,219.90	4.47%	新增
国金证券	1	188,148,555.08	2.46%	133,660.96	2.34%	新增
山西证券	1	154,505,910.32	2.02%	109,761.28	1.92%	新增

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本基金合同于 2015 年 03 月 27 日正式生效，本期新增国都证券、国联证券、东兴证券、招商证券、川财证券、国金证券和山西证券各一个交易单元，以及联讯证券、信达证券、中信建投证券各两个交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
联讯证券	-	-	13,541,600,000.00	27.24%	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	6,768,900,000.00	13.62%	-	-
东兴证券	-	-	19,537,700,000.00	39.30%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	1,700,000,000.00	3.42%	-	-
川财证券	-	-	1,660,300,000.00	3.34%	-	-
国金证券	-	-	6,500,000,000.00	13.08%	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本基金合同于 2015 年 03 月 27 日正式生效，本期新增国都证券、国联证券、东兴证券、招商证券、川财证券、国金证券和山西证券各一个交易单元，以及联讯证券、信达证券、中信建投证券各两个交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	北信瑞丰健康生活主题灵活配置 混合型证券投资基金基金合同摘 要	中国证券报	2015 年 3 月 3 日
2	北信瑞丰健康生活主题灵活配置 混合型证券投资基金招募说明书	中国证券报	2015 年 3 月 3 日
3	北信瑞丰健康生活主题灵活配置 混合型证券投资基金发售公告	中国证券报	2015 年 3 月 3 日
4	关于增加东兴证券股份有限公司 为基金销售机构的公告	中国证券报	2015 年 3 月 9 日
5	北信瑞丰健康生活主题灵活配置 混合型证券投资基金新增代销机 构公告	中国证券报	2015 年 3 月 9 日
6	北信瑞丰基金管理有限公司关于 增加华融证券股份有限公司为基	中国证券报	2015 年 3 月 24 日

	金销售机构的公告		
7	北信瑞丰基金管理有限公司关于增加华宝证券有限责任公司为基金销售机构的公告	中国证券报	2015 年 3 月 25 日
8	北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报	2015 年 3 月 27 日
9	北信瑞丰基金管理有限公司关于广州证券股份有限公司推出基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报	2015 年 4 月 28 日
10	北信瑞丰基金管理有限公司关于增加西南证券股份有限公司为基金销售机构公告	中国证券报、证券时报	2015 年 5 月 19 日
11	北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时报	2015 年 6 月 16 日
12	北信瑞丰基金管理有限公司关于天天基金网推出基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报	2015 年 6 月 26 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

注：无影响投资者决策的其他重要信息披露。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金的文件。
- 2、北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同。
- 3、北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议。
- 4、中国证监会批准设立北信瑞丰基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

北京市海淀区首体南路 9 号主语国际 4 号楼 3 层

12.3 查阅方式

网站：<http://www.bxrfund.com>

北信瑞丰基金管理有限公司
2015 年 8 月 27 日