

北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金 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：华夏银行股份有限公司

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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 26 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 1 月 1 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.....	6
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.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	12
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	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息	43

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	44
§10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
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.....	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
§12 备查文件目录.....	48
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	48

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金	
基金简称	北信瑞丰稳定收益	
基金主代码	000744	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 8 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	华夏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	551,101,232.96 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	北信瑞丰稳定收益 A	北信瑞丰稳定收益 C
下属分级基金的交易代码:	000744	000745
报告期末下属分级基金的份额总额	311,535,717.31 份	239,565,515.65 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>1、信用债投资策略</p> <p>本基金将重点投资信用类债券，以提高组合收益能力。信用债券相对央票、国债等利率产品的信用利差是本基金获取较高投资收益的来源，本基金将在北信瑞丰基金内部信用评级的基础上和内部信用风险控制的框架下，积极投资信用债券，获取信用利差带来的高投资收益。</p> <p>债券的信用利差主要受两个方面的影响，一是市场信用利差曲线的走势；二是债券本身的信用变化。本基金依靠对宏观经济走势、行业信用状况、信用债券市场流动性风险、信用债券供需情况等分析，判断市场信用利差曲线整体及分行业走势，确定各期限、各类属信用债券的投资比例。依靠内部评级系统分析各信用债券的相对信用水平、违约风险及理论信用利差，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债券进行投资，减持信用利差被低估、未来信用利差可能上升的信用债券。</p> <p>2、收益率曲线策略</p> <p>收益率曲线形状变化代表长、中、短期债券收益率差异变化，相同久期债券组合在收益率曲线发生变化时差异较大。通过对同一类属下的收益率曲线形态和期限结构变动进行分析，首先可以确定债券组合的目标久期配置区域并确定采取子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略；其次，通过不同期限间债券当前利差与历史利差的比较，可以进行增陡、减斜和凸度变化的交易。</p> <p>3、杠杆放大策略</p> <p>杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用买断式回购、质押式回购等方式融入低成本资金，并购买剩余年限相对较长并具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>当前国内资产支持证券市场以信贷资产证券化产品为主（包括以银行贷款资产、住房抵押贷款等作为基础资产），仍处于创新试点阶段。产品投资关键</p>

	在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中债信用债总指数。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

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	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孟曦	徐昊光
	联系电话	010-68619390	010-85238982
	电子邮箱	mengxi@bxrfund.com	bjxhg@hxb.com.cn
客户服务电话		4000617297	95577
传真		010-68619300	010-85238419
注册地址		北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号	北京市东城区建国门内大街 22 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	北京市东城区建国门内大街 22 号
邮政编码		100048	100005
法定代表人		周瑞明	吴建

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、基金托管人的办公地址

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 号主语国际大厦四号楼 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

基金级别	北信瑞丰稳定收益 A	北信瑞丰稳定收益 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)

本期已实现收益	42,380,269.95	17,731,240.42
本期利润	37,276,866.42	20,326,666.95
加权平均基金份额本期利润	0.0776	0.0845
本期加权平均净值利润率	7.48%	8.13%
本期基金份额净值增长率	9.04%	9.14%
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	22,964,338.38	17,887,781.71
期末可供分配基金份额利润	0.0737	0.0747
期末基金资产净值	339,589,844.65	261,351,885.02
期末基金份额净值	1.090	1.091
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	14.42%	14.30%

注：1、本基金基金合同自 2014 年 08 月 27 日起生效，至 2015 年 6 月 30 日未满十二个月；

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）。

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

北信瑞丰稳定收益 A

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	2.16%	0.37%	0.25%	0.02%	1.91%	0.35%
过去三个月	6.97%	0.28%	2.64%	0.07%	4.33%	0.21%
过去六个月	9.04%	0.27%	4.01%	0.07%	5.03%	0.20%
自基金合同生效起至今	14.42%	0.27%	7.02%	0.10%	7.45%	0.17%

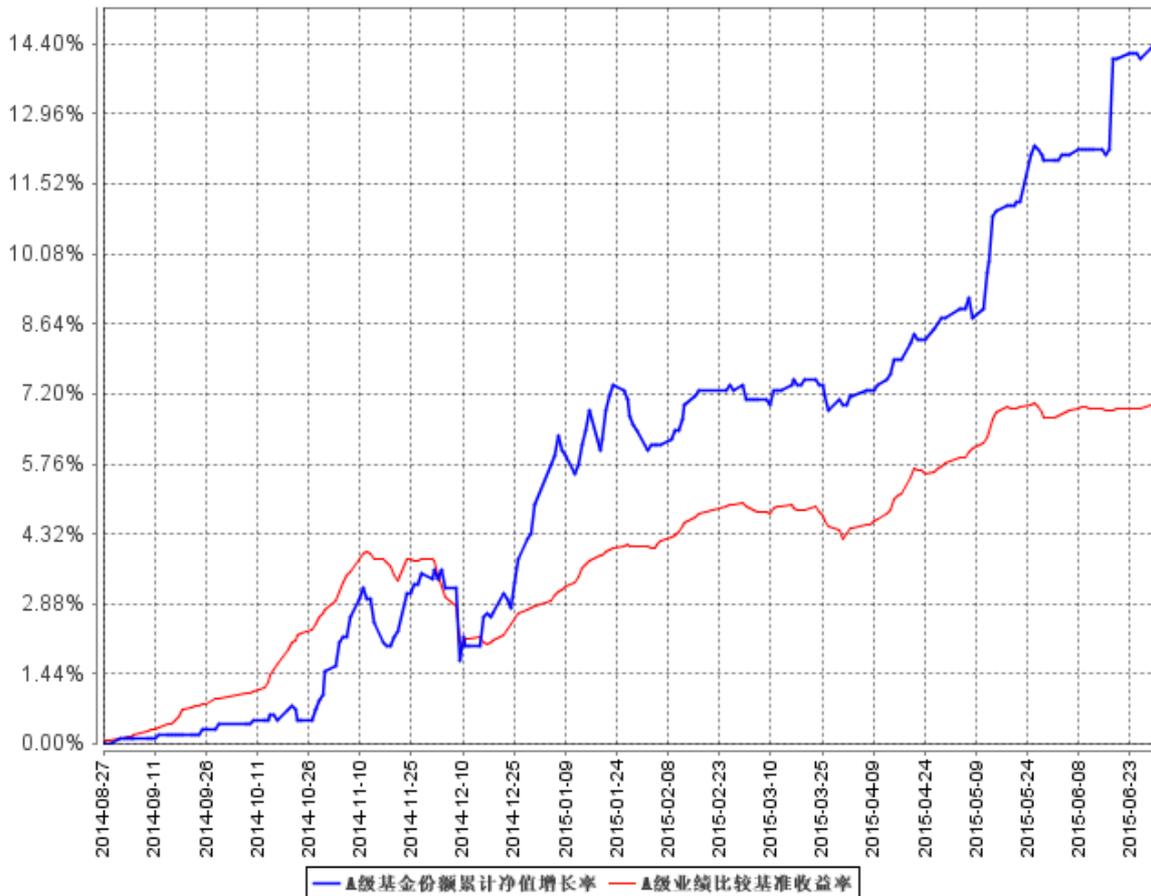
北信瑞丰稳定收益 C

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	2.15%	0.37%	0.25%	0.02%	1.90%	0.35%
过去三个月	7.17%	0.28%	2.64%	0.07%	4.53%	0.21%
过去六个月	9.14%	0.27%	4.01%	0.07%	5.13%	0.20%
自基金合同	14.30%	0.27%	7.02%	0.10%	7.33%	0.17%

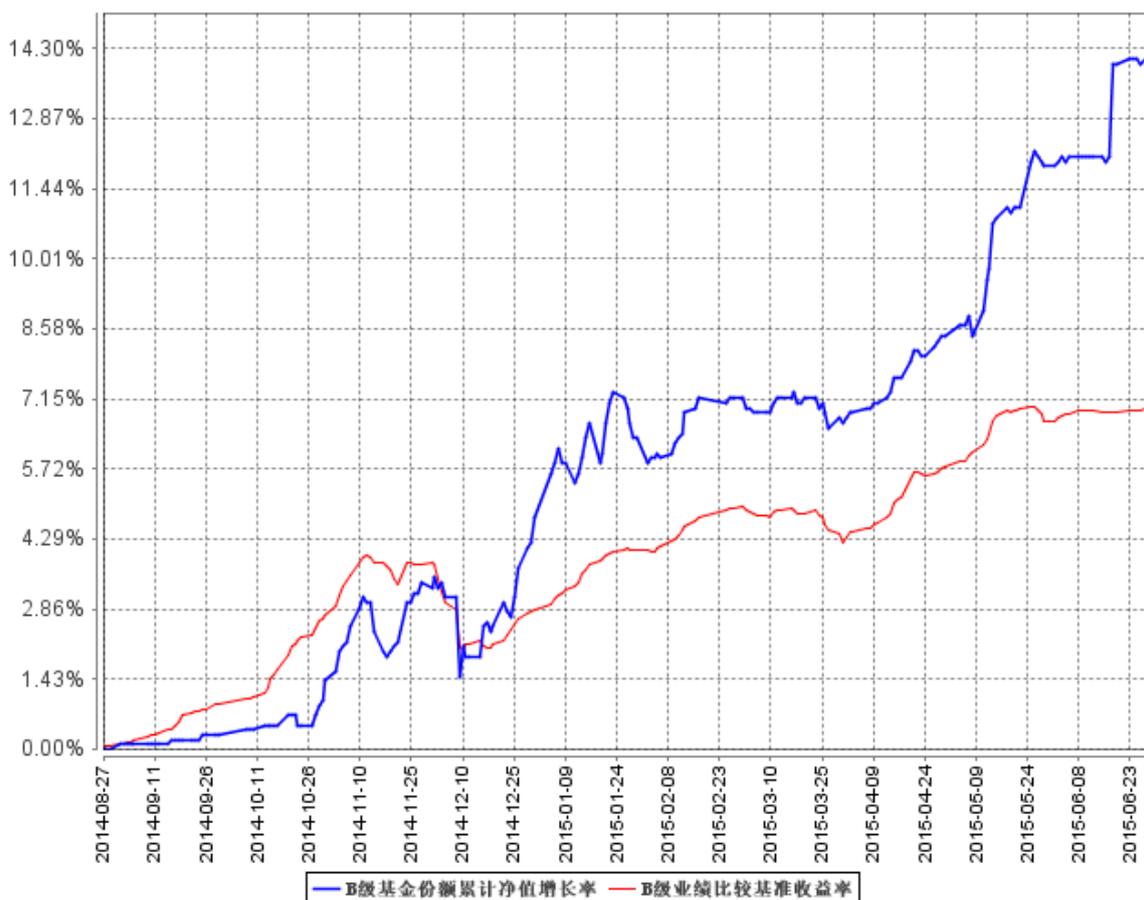
生效起至今					
-------	--	--	--	--	--

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

A级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



B级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 2014 年 08 月 27 日生效，截止报告期末未满一年。

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

资产管理流程和制度。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		
王靖	基金经理	2014 年 8 月 27 日	-	8	王靖先生，澳大利亚国立大学财务管理硕士，对外经济贸易大学经济学学士，注册金融分析师（CFA），7 年证券或基金从业资历。曾就职于于毕马威华振会计事务所、华夏基金管理有限公司基金运作部、华融证券股份有限公司资产管理部、国盛证券有限责任公司资产管理总部。曾任华融稳健成长 1 号基金精选集合资产管理计划、国盛金

					麒麟 1 号集合资产管理计划投资主办人。2014 年 5 月加盟北信瑞丰基金管理公司，任北信瑞丰稳定收益债券型基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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遵规守信情况的说明

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、《北信瑞丰稳定收益债券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。

2015 年 6 月 26 日，管理人使用风险准备金用于弥补 2015 年 6 月 24 日因操作失误给基金财产所造成的损失，金额共计 1,302,895.14 元，记入基金“其他收入”科目。本次风险准备金使用符合《公开募集证券投资基金风险准备金监督管理暂行办法》的使用条件，由风险准备金存管银行办理，并已在使用后 2 个工作日内向证监会书面报告。本次风险准备金使用后未给基金财产及基金份额持有人造成损失。

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

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组

合之间进行利益输送。

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

2015 年上半年利率债市场整体仍处于“牛市”行情中。在经济走弱、物价低位运行、资金面宽松影响下，债券收益率整体呈下行态势。其中，短端券种受资金面宽松影响，收益率下行幅度较大。在地方债供给压力影响下，收益率在 4 月份有小幅反弹。进入二季度以后，利率债收益率呈现典型的陡峭化特征。债券收益率陡峭化理论上是经济复苏的信号。但是目前来看陡峭化伴随的是经济的下滑。此轮陡峭化主要缘于短端收益率快速下行，而非长端利率抬升。

报告期内，本基金波段操作减持了低流动性的信用债，增持了较高流动性的信用债。并相应的缩短了久期，提高了杠杆操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期稳定收益 A 净值增长率 14.42%，稳定收益 C 净值增长率 14.30%，业绩比较基准收益率 6.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

考虑到去年的低基数，下半年实现 7%增长目标概率较高。不过经济下行压力同样不能忽视，6 月中旬以来股市调整、IPO 和再融资的暂停加重了企业融资难问题；房地产投资依旧没有改变投资增长率下滑的局面；随着规范地方政府债务工作的推进，贷款、非标和城投等传统融资渠道逐步受限，而国家预算内资金总量有限，地方政府自筹资金进行基建投资难度越来越大；房地产投资弱势而基建投资增长空间受限，制造业固定资产投资受需求低迷和产能过剩制约，固定资产投资仍面临大幅下行风险，工业增速大幅反弹后也有再度回落的风险。在房地产投资和基建投资放缓的大背景下，中央和地方政府也受制于财政收入放缓而无法加杠杆。因此目前中国经济面临的较大问题是缺乏持续加杠杆的经济主体，经济在转型升级过程中，仍然缺乏新的增长点。市场担忧猪肉价格的上行以及潜在的厄尔尼诺威胁可能推高下半年通胀。但在观察到猪肉价格上涨的同时，也需要注意到鸡蛋价格跌至最近几年的新低，牛肉和羊肉价格则在高位逐步回落，大宗商品价格的低位运行，物价的上涨并不是普遍现象。总而言之，下半年稳增长压力不减，通胀反

弹动力不大，积极财政政策仍是关键，货币政策仍有宽松空间。

预计下半年央行降息降准的节奏仍将根据经济状况调整。而且跨季后 7 天逆回购持续，央行维稳流动性的态度十分明确，逆回购利率维持在 2.5%，与目前市场价格接近，后续 R007 在 2.5%附近波动是大概率事件。7 月份 A 股市场剧烈波动给债市造成较大冲击，资金面在央行维稳下也保持平稳，IPO 暂停可能导致部分资金重回债市，套息策略可以延续采用，中期品种杠杆套利仍有较好的机会。与此同时，也需要关注未来 IPO 和再融资再次重启、更多积极财政政策的推出、猪价对市场心理扰动等因素的影响，在久期控制方面保持相对谨慎的态度。

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

本基金的基金管理人于 2015 年 1 月 16 日（公告日）宣告 2015 年度第 1 次分红，向截至 2015 年 1 月 16 日止在本基金注册登记人北信瑞丰基金管理有限责任公司登记在册的全体持有人，稳定收益 A 按每 10 份基金份额派发红利 0.15 元，稳定收益 C 按每 10 份基金份额派发红利 0.14 元，收益分配基准日为 2015 年 1 月 13 日，共发放红利 9,531,267.80 人民币元（包含现金和红利再投资形式）。

本基金的基金管理人于 2015 年 3 月 4 日（公告日）宣告 2015 年度第 2 次分红，向截至 2015 年 3 月 4 日止在本基金注册登记人北信瑞丰基金管理有限责任公司登记在册的全体持有人，

稳定收益 A 按每 10 份基金份额派发红利 0.20 元，稳定收益 C 按每 10 份基金份额派发红利 0.20 元，收益分配基准日为 2015 年 2 月 27 日，共发放红利 15,590,114.40 人民币元（包含现金和红利再投资形式）。

§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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内进行了 2 次利润分配。

报告期内，托管人就北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金投资民生转债事宜进行了提示。

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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金 2015 年半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、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：北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金

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	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	186,805,354.73	8,399,247.93
结算备付金		1,371,261.73	4,379,359.92

存出保证金		70,201.72	57,515.94
交易性金融资产	6.4.7.2	725,921,042.02	789,737,276.00
其中：股票投资		10,251,499.72	-
基金投资		-	-
债券投资		715,669,542.30	789,737,276.00
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		408,199.59	-
应收利息	6.4.7.5	15,486,250.19	19,135,706.08
应收股利		-	-
应收申购款		2,380,990.21	6,500.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		932,443,300.19	821,715,605.87
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31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		195,099,732.70	139,999,465.00
应付证券清算款		-	3,701,646.99
应付赎回款		822,379.19	2,023,632.13
应付管理人报酬		322,746.54	414,832.73
应付托管费		92,213.30	118,523.64
应付销售服务费		65,587.02	57,961.15
应付交易费用	6.4.7.7	47,611.08	21,423.30
应交税费		-	-
应付利息		8,020.28	252,887.83
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	135,043,280.41	80,015.02
负债合计		331,501,570.52	146,670,387.79
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	551,101,232.96	653,225,217.57
未分配利润	6.4.7.10	49,840,496.71	21,820,000.51
所有者权益合计		600,941,729.67	675,045,218.08
负债和所有者权益总计		932,443,300.19	821,715,605.87

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额总额 551,101,232.96 份。其中北信瑞丰稳定收益 A 类基金份额净值 1.090 元，基金份额总额 311,535,717.31 份；北信瑞丰稳定收益 C 类基金份额净值 1.091 元，基金份额总额 239,565,515.65 份。

6.2 利润表

会计主体：北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		64,775,595.34
1.利息收入		28,652,355.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	114,099.48
债券利息收入		28,316,591.31
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		221,664.42
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		38,469,672.81
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	38,469,672.81
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	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,507,977.00
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	161,544.32
减：二、费用		7,172,061.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,617,082.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	747,737.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	435,397.91
4. 交易费用	6.4.7.19	31,967.80
5. 利息支出		3,215,775.62
其中：卖出回购金融资产支出		3,215,775.62
6. 其他费用	6.4.7.20	124,100.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		57,603,533.37
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		57,603,533.37

注：本基金成立于 2014 年 08 月 27 日，无上年度可比较期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 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)	653,225,217.57	21,820,000.51	675,045,218.08
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	-	57,603,533.37	57,603,533.37
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)	-102,123,984.61	-4,461,654.97	-106,585,639.58
其中：1.基金申购款	1,118,021,118.75	37,585,625.12	1,155,606,743.87
2.基金赎回款	-1,220,145,103.36	-42,047,280.09	-1,262,192,383.45
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)	-	-25,121,382.20	-25,121,382.20
五、期末所有者权益 (基金净值)	551,101,232.96	49,840,496.71	600,941,729.67

注：本基金成立于 2014 年 08 月 27 日，无上年度可比较期间。

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

北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金(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[2014]第 703 号《关于准予北信瑞丰稳定收益债券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《北信瑞丰稳定收益债券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

2014年7月28日至2014年8月22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740,914,368.92元，业经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）毕马威华振验字(2014)第1400943号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金基金合同》于2014年8月27日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为740,955,196.61份基金份额，其中认购资金利息折合40,827.69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，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债、地方政府债、资产支持证券、可转换债券（含分离交易可转债）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的80%。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等，不参与一级市场的新股申购或增发新股。

本基金的业绩比较基准为：中债信用债总指数。

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日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（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》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

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年半年度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1月1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

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 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

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)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期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。

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	186,805,354.73
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	186,805,354.73

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	9,633,773.73	10,251,499.72	617,725.99

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	176,423,010.06	177,806,942.30	1,383,932.24
	银行间市场	532,767,463.57	537,862,600.00	5,095,136.43
	合计	709,190,473.63	715,669,542.30	6,479,068.67
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		718,824,247.36	725,921,042.02	7,096,794.66

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

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：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有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	8,831.52
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	555.39
应收债券利息	15,476,834.84
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	28.44
合计	15,486,250.19

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	-
银行间市场应付交易费用	47,611.08

合计	47,611.08
----	-----------

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	11.18
应付卖出银行间回购到期款	133,655,931.86
预提费用	84,300.75
其他	1,303,036.62
合计	135,043,280.41

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

北信瑞丰稳定收益 A		
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	469,591,640.45	469,591,640.45
本期申购	400,387,933.52	400,387,933.52
本期赎回(以“-”号填列)	-558,443,856.66	-558,443,856.66
- 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	311,535,717.31	311,535,717.31

金额单位：人民币元

北信瑞丰稳定收益 C		
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	183,633,577.12	183,633,577.12
本期申购	717,633,185.23	717,633,185.23
本期赎回(以“-”号填列)	-661,701,246.70	-661,701,246.70
- 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	239,565,515.65	239,565,515.65

注：申购含红利再投和转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

北信瑞丰稳定收益 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,058,468.73	9,675,329.30	15,733,798.03
本期利润	42,380,269.95	-5,103,403.53	37,276,866.42
本期基金份额交易产生的变动数	-6,423,463.11	517,863.19	-5,905,599.92
其中：基金申购款	5,941,301.87	7,992,674.82	13,933,976.69
基金赎回款	-12,364,764.98	-7,474,811.63	-19,839,576.61
本期已分配利润	-19,050,937.19	-	-19,050,937.19
本期末	22,964,338.38	5,089,788.96	28,054,127.34

单位：人民币元

北信瑞丰稳定收益 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,311,855.85	3,774,346.63	6,086,202.48
本期利润	17,731,240.42	2,595,426.53	20,326,666.95
本期基金份额交易产生的变动数	3,915,130.45	-2,471,185.50	1,443,944.95
其中：基金申购款	22,089,304.36	1,562,344.07	23,651,648.43
基金赎回款	-18,174,173.91	-4,033,529.57	-22,207,703.48
本期已分配利润	-6,070,445.01	-	-6,070,445.01
本期末	17,887,781.71	3,898,587.66	21,786,369.37

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	81,941.48
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	31,506.88
其他	651.12
合计	114,099.48

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**

注：本基金本报告期无股票投资收益-买卖股票差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,693,649,259.05
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,600,586,944.19
减：应收利息总额	54,592,642.05
买卖债券差价收入	38,469,672.81

注：本基金合同自 2014 年 08 月 27 日起生效，截止到报告期末未满十二个月。

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收益。

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

注：本基金本报告期无股利收益。

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1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,507,977.00
——股票投资	617,725.99
——债券投资	-3,125,702.99
——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	-2,507,977.00

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	161,544.32
合计	161,544.32

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	682.81
银行间市场交易费用	31,284.99
合计	31,967.80

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	64,588.57
其他	8,100.00
帐户维护费	16,700.00
合计	124,100.75

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**

截至报表批准报出日，截至资产负债表日本基金未存在或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2015 年 8 月 6 日（公告日）宣告 2015 年度第 3 次分红，向截至 2015 年 8 月 7 日止在本基金注册登记人北信瑞丰基金管理有限责任公司登记在册的全体持有人，稳定收益 A 按每 10 份基金份额派发红利 0.90 元，稳定收益 C 按每 10 份基金份额派发红利 0.90 元。

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
华夏银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
北京国际信托有限公司	基金管理人的股东
莱州瑞海投资有限公司	基金管理人的股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

6.4.10.1 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	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	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	2,617,082.16	-
其中：支付销售机构的客户维护费	331,017.76	-

注：1、支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70% 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 0.70% / 当年天数。

2、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	上年度可比期间
----	----	---------

	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	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	747,737.73	-

注：1、支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 \times 0.20 % / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	北信瑞丰稳定收益 A	北信瑞丰稳定收益 C	合计
	北信瑞丰基金管理有限公司	0.00	387,782.25
合计	0.00	387,782.25	387,782.25

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.35% 年费率计提；

C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费 = C 类基金份额前一日基金资产净值 \times 0.35% / 当年天数。

本期间内无发生关联方销售服务费用。

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：本基金本报告期无通过关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

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

注：本基金本报告期内无关联方投资本基金。

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

份额单位：份

北信瑞丰稳定收益 A				
关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
北京国际信托有限公司	106,693,636.09	19.3601%	-	-

份额单位：份

北信瑞丰稳定收益 C				
关联方名称	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
北京国际信托有 限公司	188,857,412.65	34.2691%	-	-

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 2015 年 1 月 1 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华夏银行股份有限 公司	186,805,354.73	81,941.48	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人华夏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：本基金本报告期内无在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

北信瑞丰稳定收益 A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配 合计	备注
		场内	场外					
1	2015 年 3 月 4 日	-	2015 年 3 月 4 日	0.2000	12,001,596.00	15,651.16	12,017,247.16	
2	2015 年 1 月 16 日	-	2015 年 1 月 16 日	0.1500	7,020,228.11	13,461.92	7,033,690.03	
合计	-	-	-	0.3500	19,021,824.11	29,113.08	19,050,937.19	

北信瑞丰稳定收益 C

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配 合计	备注
		场内	场外					
1	2015 年 3 月 4 日	-	2015 年 3 月 4 日	0.2000	3,561,750.37	11,116.87	3,572,867.24	

2	2015 年 1 月 16 日	-	2015 年 1 月 16 日	0.1400	2,491,308.07	6,269.70	2,497,577.77	
合计	-	-		0.3400	6,053,058.44	17,386.57	6,070,445.01	

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

注：本基金本报告期末无持有的暂时停牌等流通受限股票。

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

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 134,599,732.70 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1282452	12 清控 MTN2	2015 年 7 月 1 日	102.85	300,000	30,855,000.00
1480567	14 江苏春辉债 02	2015 年 7 月 1 日	99.55	200,000	19,910,000.00
1280248	12 随州债	2015 年 7 月 1 日	104.47	250,000	26,117,500.00
1480384	14 滨海新塘债	2015 年 7 月 1 日	104.01	200,000	20,802,000.00
1182323	11 甘公投 MTN2	2015 年 7 月 1 日	104.80	400,000	41,920,000.00
合计				1,350,000	139,604,500.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 60,500,000 元，于 2015 年 7 月 6 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金为债券型基金，预期收益和风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。本基金投资的金融工具主要为债券。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险及利率风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报的投资目标。

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在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的债券信用风险主要分为：单券种的信用风险和债券组合的信用风险。

针对单券种发行主体的信用风险，本基金管理人将通过以下三个方面来进行信用风险的管理：①进行独立的发行主体信用分析，运用信用产品的相关数据资料，分析发行人的公司背景、行业特性、流动性、盈利能力、偿债能力和表外事项等因素，对信用债进行信用风险评估，并确定信用债的风险等级；②严格遵守信用类债券的备选库制度，根据不同的信用风险等级，按照不同的投资管理流程和权限管理制度，对入库债券进行持续信用跟踪分析；③采取分散化投资策略和集中度限制，严格控制组合整体的违约风险水平。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
A-1	20,214,000.00	39,736,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	-

合计	20,214,000.00	39,736,000.00
----	---------------	---------------

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。

6.4.13.2.2 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	72,775,000.00	77,525,800.00
AAA 以下	583,207,555.00	522,736,476.00
未评级	-	-
合计	655,982,555.00	600,262,276.00

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所持金融工具变现的难易程度。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。

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，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间市场交易，均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。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投资的公允价值。

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

感性金融工具均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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 201 5 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	186,805,354.73	-	-	-	-	-	186,805,354.73
结 算 备 付 金	1,371,261.73	-	-	-	-	-	1,371,261.73
存 出 保 证 金	70,201.72	-	-	-	-	-	70,201.72
交 易 性 金 融 资 产	-	-	50,628,000.00	595,353,555.00	61,750,000.00	18,189,487.02	725,921,042.02
应	-	-	-	-	-	408,199.59	408,199.59

收 证 券 清 算 款							
应 收 利 息	-	-	-	-	-	15,486,250.19	15,486,250.19
应 收 申 购 款	-	-	-	-	-	2,380,990.21	2,380,990.21
资 产 总 计	188,246,818.18	-	50,628,000.00	595,353,555.00	61,750,000.00	36,464,927.01	932,443,300.19
负 债							
卖 出 回 购 金 融 资 产 款	195,099,732.70	-	-	-	-	-	195,099,732.70
应 付 赎 回 款	-	-	-	-	-	822,379.19	822,379.19
应 付 管 理 人 报 酬	-	-	-	-	-	322,746.54	322,746.54
应 付 托	-	-	-	-	-	92,213.30	92,213.30

管费							
应付销售服务费		-	-	-	-	65,587.02	65,587.02
应付交易费用		-	-	-	-	47,611.08	47,611.08
应付利息		-	-	-	-	8,020.28	8,020.28
其他负债		-	-	-	-	135,043,280.41	135,043,280.41
负债总计	195,099,732.70		-	-	-	136,401,837.82	331,501,570.52
利率敏感度缺口	-6,852,914.52		-50,628,000.00	595,353,555.00	61,750,000.00	99,936,910.81	-600,941,729.67
上年度末 2014 年 12 月 31 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	8,399,247.93	-	-	-	-	-	8,399,247.93
结算备付金	4,379,359.92	-	-	-	-	-	4,379,359.92
存出保证金	57,515.94	-	-	-	-	-	57,515.94
交易性金融资产	-	8,786,550.00	153,619,154.00	272,104,947.00	355,226,625.00	-	789,737,276.00
应收利息	-	-	-	-	-	19,135,706.08	19,135,706.08
应收申购款	-	-	-	-	-	6,500.00	6,500.00
资产总计	12,836,123.79	8,786,550.00	153,619,154.00	272,104,947.00	355,226,625.00	19,142,206.08	821,715,605.87
负债							
卖出回购金融资	139,999,465.00	-	-	-	-	-	139,999,465.00

产款							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,701,646.99	3,701,646.99
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,023,632.13	2,023,632.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	414,832.73	414,832.73
应付托管费	-	-	-	-	-	118,523.64	118,523.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-	57,961.15	57,961.15
应付交易费用	-	-	-	-	-	21,423.30	21,423.30
应付利息	-	-	-	-	-	252,887.83	252,887.83
其他	-	-	-	-	-	80,015.02	80,015.02

负债							
负债总计	139,999,465.00	-	-	-	-	6,670,922.79	146,670,387.79
利率敏感度缺口	-127,163,341.21	8,786,550.00	153,619,154.00	272,104,947.00	355,226,625.00	12,471,283.29	675,045,218.08

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规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债券、货币市场工具、资产支持证券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）。本基金主要投资于固定收益类资产，包括国债、地方政府债、中央银行票据、中期票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、次级债、中小企业私募债、可转换债券（含可分离交易可转债）、资产支持证券、债券回购、银行存款等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不参与一级市场新股申购或增发新股，也不直接从二级市场上买入股票、权证等权益类金融工具，但可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离交易可转债而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金应在其可交易之日起的 30 个交易日内卖出。本基金的投资组合比例为：本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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	10,251,499.72	1.71	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	715,669,542.30	119.09	789,737,276.00	116.99
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	725,921,042.02	120.80	789,737,276.00	116.99

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 6 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 7,937,987.30 元，属于第二层级的余额为 707,731,555.00 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	10,251,499.72	1.10
	其中：股票	10,251,499.72	1.10
2	固定收益投资	715,669,542.30	76.75
	其中：债券	715,669,542.30	76.75
	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	188,176,616.46	20.18
7	其他各项资产	18,345,641.71	1.97
8	合计	932,443,300.19	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
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	-	-
J	金融业	10,251,499.72	1.71
K	房地产业	-	-
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	10,251,499.72	1.71

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	600016	民生银行	1,031,338	10,251,499.72	1.71
---	--------	------	-----------	---------------	------

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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	9,633,773.73	1.43

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

注：无。

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	9,633,773.73
卖出股票收入（成交）总额	-

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	30,414,000.00	5.06
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	238,711,555.00	39.72
5	企业短期融资券	20,214,000.00	3.36
6	中期票据	417,271,000.00	69.44
7	可转债	7,937,987.30	1.32
8	其他	1,121,000.00	0.19
9	合计	715,669,542.30	119.09

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	122126	11 庞大 02	500,000	52,575,000.00	8.75
2	101556002	15 广汇集团 MTN001	500,000	51,455,000.00	8.56
3	101554021	15 粤物资 MTN001	500,000	50,450,000.00	8.40
4	101567001	15 西王 MTN001	500,000	50,335,000.00	8.38
5	101569007	15 华联股 MTN002	500,000	50,040,000.00	8.33

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：本基金本报告期末无列示的资产支持证券投资。

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：本基金本报告期末无列示的贵金属投资。

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：本基金本报告期末无列示的权证投资。

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：本基金本报告期末无投资的股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末无投资的股指期货。

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：本基金本报告期末无投资的国债期货。

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：本基金本报告期末无投资的国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末无投资的国债期货。

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	70,201.72
2	应收证券清算款	408,199.59
3	应收股利	-
4	应收利息	15,486,250.19
5	应收申购款	2,380,990.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,345,641.71

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	110023	民生转债	7,937,987.30	1.32

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

§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

份额级别	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
北信瑞丰稳定收益	160	1,947,098.23	306,696,636.09	98.45%	4,839,081.22	1.55%

A						
北信瑞丰稳定收益 C	1,012	236,724.82	189,615,527.93	79.15%	49,949,987.72	20.85%
合计	1,172	470,222.90	496,312,164.02	90.06%	54,789,068.94	9.94%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	北信瑞丰稳定收益 A	761,331.84	0.2444%
	北信瑞丰稳定收益 C	546,244.82	0.2280%
	合计	1,307,576.66	0.2373%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	北信瑞丰稳定收益 A	50~100
	北信瑞丰稳定收益 C	50~100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	北信瑞丰稳定收益 A	10~50
	北信瑞丰稳定收益 C	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	北信瑞丰稳定收益 A	北信瑞丰稳定收益 C
基金合同生效日（2014年8月27日）基金份额总额	268,133,183.73	472,822,012.88
本报告期期初基金份额总额	469,591,640.45	183,633,577.12
本报告期基金总申购份额	400,387,933.52	717,633,185.23
减：本报告期基金总赎回份额	558,443,856.66	661,701,246.70
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-

本报告期末基金份额总额	311,535,717.31	239,565,515.65
-------------	----------------	----------------

注：总申购份额含转换入份额和红利再投资，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

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

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

注：本基金本报告期无基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

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

自本基金基金合同生效日起毕马威华振会计师事务所为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

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

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

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	
信达证券	2	-	-	-	-	-

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本报告期内，本基金租用证券公司交易单元未变更。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
信达证券	546,773,281.46	14.00%	3,459,000,000.00	86.00%	-	-

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本报告期内，本基金租用证券公司交易单元未变更。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24日
2	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
3	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
4	北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报	2015年4月20日
5	北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金 2014 年年度报告（摘要）	中国证券报	2015年3月31日
6	北信瑞丰基金管理有限公司关于公司旗下基金固定收益品种估值方法调整的公告	中国证券报	2015年3月31日
7	北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证券报	2015年3月30日
8	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
9	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金销售机构的公告	中国证券报	2015年3月24日
10	北信瑞丰基金管理有限公司关于增加中信建投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20日
11	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
12	关于北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金的分红更正公告	中国证券报	2015年3月3日
13	北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金第三次分红公告	中国证券报	2015年3月2日

14	北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中国证券报	2015 年 1 月 23 日
15	北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金第二次分红公告	中国证券报	2015 年 1 月 14 日
16	北信瑞丰基金管理有限公司关于增加厦门市鑫鼎盛控股有限公司为基金销售机构并参加相关费率优惠活动的公告	中国证券报	2015 年 1 月 13 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稳定收益债券型证券投资基金的文件。
- 2、北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金基金合同。
- 3、北信瑞丰稳定收益债券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