

# 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 2016 年半年度报告

2016 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：2016 年 8 月 26 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 2016 年 8 月 24 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
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.....	38
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.....	39
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.....	50
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51

7.12 投资组合报告附注.....	51
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	53
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	53
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>57</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	北信瑞丰无限互联主题灵活配置
基金主代码	000886
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 12 月 24 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	62,795,133.52 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，重点投资于有独特商业模式、深刻影响人们生活方式的快速成长的互联网公司，为互联网建设提供基础设施的软件、硬件设备等行业的公司，以及使用互联网技术、互联网工具、互联网思维带动传统产业升级改造的优质上市公司，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	朱彦	蒋松云
	联系电话	010-68619390	010-66105799

	电子邮箱	service@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	易会满

## 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	<a href="http://www.bxrfund.com">http://www.bxrfund.com</a>
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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-43,960,532.93
本期利润	-40,795,553.06
加权平均基金份额本期利润	-0.5997
本期加权平均净值利润率	-65.27%
本期基金份额净值增长率	-34.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-23,683,487.87
期末可供分配基金份额利润	-0.3772
期末基金资产净值	52,282,513.13
期末基金份额净值	0.833
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	-3.43%
-------------	--------

注：1、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；

2、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、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。

4、基金份额累计净值增长率采用证监会要求的基金累计净值增长率的计算公式进行计算（ $[(\text{期末份额净值}/(\text{分红日份额净值}-\text{分红金额})) \times n]^{1/n} - 1$ （其中，每次分红之间的时间当作一个区间单独计算，然后累乘）。

## 3.2 基金净值表现

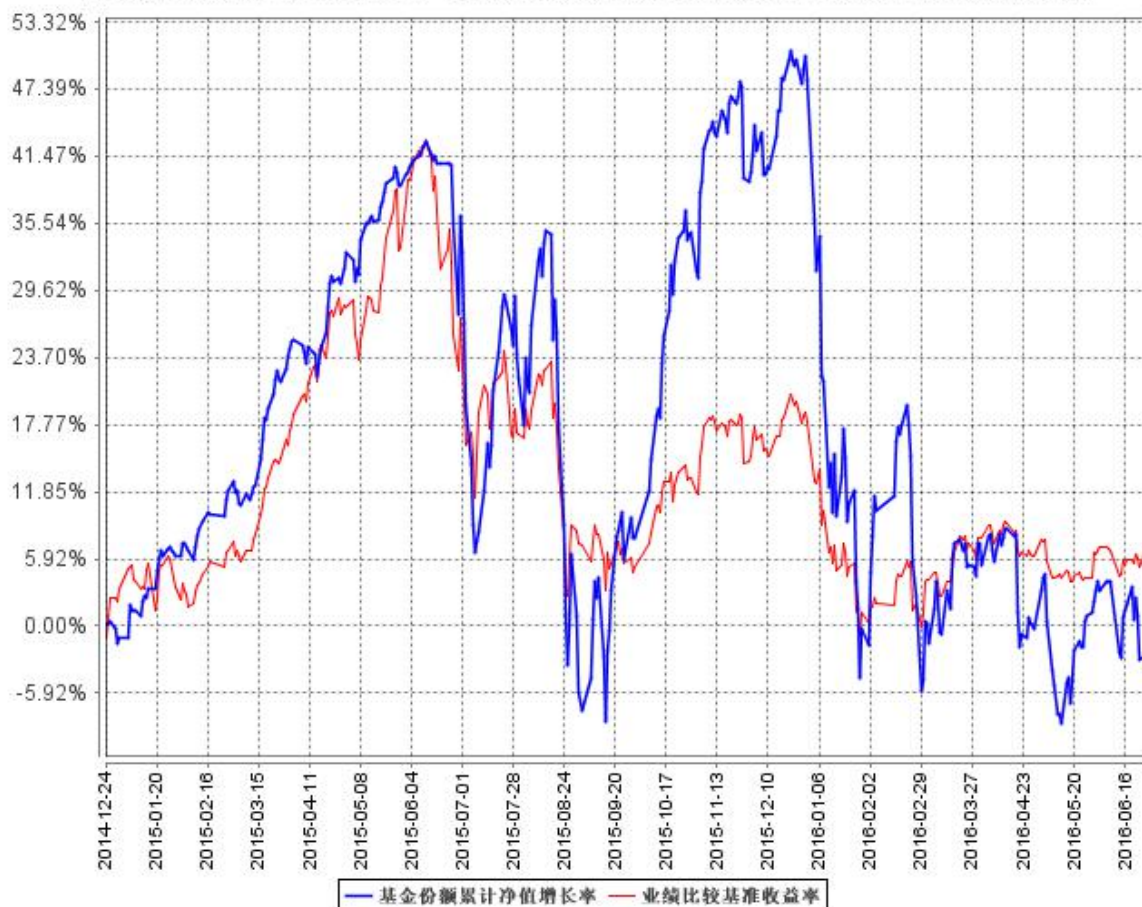
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.45%	2.09%	0.59%	0.68%	-6.04%	1.41%
过去三个月	-9.95%	2.07%	-0.67%	0.71%	-9.28%	1.36%
过去六个月	-34.82%	2.98%	-9.29%	1.22%	-25.53%	1.76%
过去一年	-29.04%	2.98%	-15.78%	1.45%	-13.26%	1.53%
自基金合同生效起至今	-3.43%	2.52%	7.06%	1.41%	-10.49%	1.11%

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：报告期内基金的各项投资比例符合基金合同的有关规定。

### 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 17 日，是经中国证监会批准，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。

2015 年 7 月 10 日，基金子公司——上海北信瑞丰资产管理有限公司成立。2015 年，公司荣膺大众证券报“2015 十大风云基金公司”；北信瑞丰稳定收益债券基金摘得“2015 东方财富风云榜”最受欢迎债券类基金大奖。



北信瑞丰基金旗下目前管理 11 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、北信瑞丰新成长主题灵活配置混合型证券投资基金、北信瑞丰中国智造主题灵活配置混合型证券投资基金、北信瑞丰稳定增强偏债混合型证券投资基金、北信瑞丰外延增长主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、北信瑞丰丰利保本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		
高峰	副总经理	2014 年 12 月 24 日	-	16	北京大学光华管理学院国民经济管理硕士，21 年金融从业经验，16 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。
王洋	基金经理	2016 年 1 月 15 日	-	5	巴黎高等经济学院硕士毕业。原合众资产管理股份有限公司行业分析员，有丰富的市场研究经验，2014 年 11 月加入北信瑞丰基金管理有限公司投资研究部。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；

2、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、《北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式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

本报告期内，公司严格执行《公司公平交易管理办法》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、特定客户资产管理组合等。具体如下：

在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

### 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

一季度市场在 1 月份出现了快速下跌，在流动性相对宽松、经济环境没有显著变化、经过 2015 年下半年市场两次暴跌之后估值水平基本处于合理区间、高杠杆融资盘清理已经基本完成的环境

下，市场依然连续大跌，创出调整以来的新低，还是非常超出我们的预期，市场观点也迅速一边倒的转向看空。由于股票投资比例较高、本基金主题所限，又无法投资相对表现较强的煤炭、有色、化工等周期性行业，在年初的市场下跌中净值跌幅也较大；不过在市场浓厚的看空氛围中，我们从基本面和估值分析，坚定认为市场下跌只是投资者恐慌形成的羊群效应，在市场底部依然保持了较高的股票投资比例，2 月份在市场阶段性底部后出现了几轮快速的反弹，本基金组合在企稳反弹中保持了一定的弹性，并在二季度市场指数阶段性区间震荡中挑选了一些市场热点做了短期弹性较好的主题投资。

整体看上半年本基金投资的大部分股票集中在计算机、传媒、通信、电子和其他涉及互联网的板块，这里面的中小板、创业板股票较多，估值一直较高，在市场风险偏好下降过程中，这些股票向下的弹性也明显高于上证 50、沪深 300 为代表的蓝筹股，在反弹过程中出现过脉冲式上涨，但是短期整体趋势还是弱于市场的其他板块，本基金由于投资范围限制主要选取以无线互联相关公司在估值合理阶段进行左侧布局，等待市场整体风险偏好的提升。

#### 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-34.82%，波动率 2.98%，业绩比较基准收益率-9.29%，波动率 1.22%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于下半年的宏观经济走势，我们认为长期看由于劳动力等生产要素结构性问题，并不能期待中国经济恢复到过去五年的高增长，同时政府有能力通过积极的财政政策和稳健货币政策保证经济不发生硬着陆，因此经济 L 型的市场预期并不会会有明显的向上或向下的趋势变化。短期看今年年初地产去库存政策带动投资和消费的反弹，上年的经济增速出现了一定的增速改善迹象，然而从全年看后续地产销量逐步恢复到自然水平，预计后续经济增速仍将在一个平稳的阶段。

A 股自年初在人民币贬值和资金外流压力下，经历了一轮快速下跌，长期看央行正不断通过积极的预期管理稳定市场情绪，而近期人民币贬值并没有带来新一轮的市场杀跌，从未来半年或更长时间看这种担忧正被市场理性看待，再次出现股灾的概率不大，而行业和上市公司整体高估值的情况也制约了大幅抬升的空间，市场围绕 2 月份后形成底部区间震荡盘整的概率偏大，未来半年维持对市场整体偏中性的判断。短期看虽然 6 月 24 日在英国脱欧公投结果出来后，全球市场特别是欧洲市场经历了一波快速的杀跌，反映了市场对于英国脱欧带来的经济政治长期不确定性带来的担忧，另一方面在事件冲击后，欧美以及 A 股市场出现了快速的修复，受到当前经济环境影响，市场预期全球包括中国将继续用宽松的货币政策应对全球经济的不确定性，对于股票市

场来说存在一定的风险偏好提升空间。

同时国内的改革包括供给侧结构性改革、国企改革等等仍在有序积极推进，反应到市场面上，过去两年市场以成长股为主线的投资逻辑并没有被破坏，而在金融监管和多层资本市场改革、退市制度不断完善的情况下，市场越来越关注公司的业绩驱动带来确定性的投资机会，同时在在经济转型需寻找地产外的新增长动力的大背景下，一些新兴行业如新能源汽车、半导体制造、传媒文化、互联网等行业发展空间巨大，反应到市场虽然整体指数空间不大，但是结构性机会持续出现热点层出不穷的局面，因此我们仍然会力求积极把握经济脱虚入实和文化消费快速增长的领域寻找如 OLED、集成电路、云计算、大数据、互联网医疗、VR、IP 等等主题和个股机会。短期看市场流动性充足，但是缺乏大量的增量资金和新热点，在投资机会的选择以及时点的把握上我们需要保持心平气和，在业绩优良和成长预期较好的公司中耐心选择标的进行短长结合的投资。

#### 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。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

注：无

## § 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，本基金托管人在对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，北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式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无限互联主题灵活配置混合型发起式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。本报告期内，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未进行利润分配。

### 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无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金 2016 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：北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,305,254.30	3,404,354.29
结算备付金		2,790,816.32	2,563,720.72
存出保证金		345,712.64	226,923.98
交易性金融资产	6.4.7.2	35,712,608.49	113,367,196.30
其中：股票投资		35,712,608.49	113,367,196.30
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	15,000,000.00
应收证券清算款		15,729,464.63	9,762,327.43
应收利息	6.4.7.5	4,171.75	8,772.18
应收股利		-	-
应收申购款		294,320.90	16,235.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		60,182,349.03	144,349,530.64
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		4,108,800.02	742,452.67
应付赎回款		543,928.22	470,989.91
应付管理人报酬		68,133.71	147,404.48
应付托管费		11,355.63	24,567.44
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,832,598.02	876,430.95
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	335,020.30	220,482.86
负债合计		7,899,835.90	2,482,328.31
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	62,795,133.52	111,016,298.78
未分配利润	6.4.7.10	-10,512,620.39	30,850,903.55
所有者权益合计		52,282,513.13	141,867,202.33
负债和所有者权益总计		60,182,349.03	144,349,530.64

注：1、报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.833 元，基金份额累计净值 1.033 元，基金份额总额 62,795,133.52 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-35,756,926.21	166,091,389.80
1.利息收入		65,306.50	3,391,128.44
其中：存款利息收入	6.4.7.11	55,621.15	254,945.86
债券利息收入		-	130.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,685.35	3,136,052.05
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-39,398,637.50	157,494,065.96
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-39,457,050.97	156,617,599.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	603,144.17
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	58,413.47	273,322.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,164,979.87	2,988,688.05
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	411,424.92	2,217,507.35
<b>减：二、费用</b>		5,038,626.85	7,499,950.51
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	469,172.88	3,148,534.67
2. 托管费	6.4.10.2.2	78,195.57	524,755.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,370,947.10	3,734,488.77
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	120,311.30	92,171.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-40,795,553.06	158,591,439.29
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-40,795,553.06	158,591,439.29

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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)	111,016,298.78	30,850,903.55	141,867,202.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-40,795,553.06	-40,795,553.06
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)	-48,221,165.26	-567,970.88	-48,789,136.14
其中：1.基金申购款	23,125,752.40	-2,073,579.97	21,052,172.43
2.基金赎回款	-71,346,917.66	1,505,609.09	-69,841,308.57
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)	62,795,133.52	-10,512,620.39	52,282,513.13
	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
项目	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)	659,565,513.19	-6,458,658.66	653,106,854.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	158,591,439.29	158,591,439.29
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)	-578,091,329.33	-122,707,237.14	-700,798,566.47
其中：1.基金申购款	13,595,004.35	3,478,988.25	17,073,992.60
2.基金赎回款	-591,686,333.68	-126,186,225.39	-717,872,559.07
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)	81,474,183.86	29,425,543.49	110,899,727.35



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	_____ 郭亚	_____ 孟曦
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金(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 1173 号《关于准予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《北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式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 12 月 8 日至 2014 年 12 月 19 日止。本基金为契约型开放式发起式,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 659,488,739.06 元,业经中喜会计师事务所(特殊普通合伙)中喜验字(2014)第 0284 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于 2014 年 12 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 659,565,513.19 份基金份额,其中认购资金利息折合 76,774.13 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《北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,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。本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%,80%以上的非现金资产投资于无限互联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%。中证 800 指数收益率×60% + 中证综合债券指数收益率×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(以下简称

“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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 会计年度

本基金财务报表的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的编制期间为 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 6 月 30 日止。

#### 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和债券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中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债券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，并且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：

对于证券交易所上市的股票和债券，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、现金流量折现法等估值技术进行估值。

### **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**

本报告期内本基金无会计政策变更。

#### **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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]101号《关于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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于2016年5月1日前，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。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。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 2016年6月30日
活期存款	5,305,254.30
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-

其他存款	-
合计：	5,305,254.30

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	35,163,500.89	35,712,608.49	549,107.60
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	35,163,500.89	35,712,608.49	549,107.60

#### 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 2016年6月30日
应收活期存款利息	2,760.25
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	1,255.90
应收债券利息	-
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	155.60
合计	4,171.75

#### 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 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,832,598.02
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,832,598.02

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	649.68
预提费用	334,370.62
合计	335,020.30

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	111,016,298.78	111,016,298.78
本期申购	23,125,752.40	23,125,752.40
本期赎回(以“-”号填列)	-71,346,917.66	-71,346,917.66
- 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	62,795,133.52	62,795,133.52



注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34,266,051.60	-3,415,148.05	30,850,903.55
本期利润	-43,960,532.93	3,164,979.87	-40,795,553.06
本期基金份额交易产生的变动数	-13,989,006.54	13,421,035.66	-567,970.88
其中：基金申购款	-4,588,419.51	2,514,839.54	-2,073,579.97
基金赎回款	-9,400,587.03	10,906,196.12	1,505,609.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-23,683,487.87	13,170,867.48	-10,512,620.39

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	32,331.69
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	21,108.58
其他	2,180.88
合计	55,621.15

#### 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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	1,704,100,334.24
减：卖出股票成本总额	1,743,557,385.21
买卖股票差价收入	-39,457,050.97

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

注：本基金本报告期无债券投资收益—买卖债券差价收入。

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期无债券投资收益—赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无债券投资收益—申购差价收入。

**6.4.7.13.5 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****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无贵金属投资。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具投资。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

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
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	58,413.47
基金投资产生的股利收益	-

合计	58,413.47
----	-----------

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	3,164,979.87
——股票投资	3,164,979.87
——债券投资	-
——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	3,164,979.87

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	411,119.45
转换费收入	305.47
合计	411,424.92

注：1. 本基金的投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于 30 日但少于 90 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 75% 归入基金财产；对于持有期长于 90 日但小于 180 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 50% 归入基金财产；对于持有期长于 180 日但小于 730 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 25% 归入基金财产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中对持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于 30 日但少于 90 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 75% 归入基金财产；对于持有期长于 90 日但少于 180 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 50% 归入基金财产；对于持有期长于 180 日但小于 730 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 25% 归入基金财产。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	4,370,947.10
银行间市场交易费用	-
合计	4,370,947.10

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	14,918.54
信息披露费	99,452.08
银行费用	1,440.68
帐户维护费	4,500.00
其他	-
合计	120,311.30

**6.4.7.21 分部报告**

注：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。

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

注：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**

注：截至报表批准报出日，本基金未存在资产负债表日后发生的利润分配、基金拆分、基金转型等非调整事项。

**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**

注：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（“北信瑞丰”	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

基金”)	
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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

注：本基金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股票交易。

#### 6.4.10.1.2 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债券交易。

#### 6.4.10.1.3 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回购交易。

#### 6.4.10.1.4 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权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期末支付关联方佣金。

### 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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	469,172.88	3,148,534.67
其中：支付销售机构的客户维护费	222,926.06	2,035,860.08

注：支付基金管理人北信瑞丰基金管理有限公司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 X1.5% / 当年天数。

**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
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	78,195.57	524,755.85

注：1、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**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
基金合同生效日（2014年12月24日）持有的基金份额	9,999,200.00	9,999,200.00
期初持有的基金份额	14,653,762.38	9,999,200.00
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	14,653,762.38	9,999,200.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	23.34%	12.27%

**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：本基金本报告期及上年度可比期间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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	5,305,254.30	32,331.69	10,284,796.65	127,199.38

注：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**

注：本报告期间本基金未发生利润分配。

**6.4.12 期末（2016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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	467	3,964.83	3,964.83	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	362	3,638.10	3,638.10	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	624	3,619.20	3,619.20	-

注：本基金截至2016年06月30日止持有以上因新股流通限售而尚未上市流通的股票，该类股票将在经交易所批准后上市流通。

**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
002289	*ST	2016	筹划	28.85	-	-	100,000	2,664,743.00	2,885,000.00	-

	宇顺	年 4 月 29 日	重大 事项							
600330	天通 股份	2016 年 5 月 21 日	筹划 重大 事项	15.91	-	-	150,000	2,057,807.50	2,386,500.00	-
600497	驰宏 锌锗	2016 年 6 月 13 日	筹划 重大 事项	9.97	2016 年 7 月 11 日	10.97	130,000	1,345,178.00	1,296,100.00	-
601611	中国 核建	2016 年 6 月 30 日	临时 停牌	20.92	2016 年 7 月 1 日	23.01	1,512	5,246.64	31,631.04	-
603919	金徽 酒	2016 年 6 月 6 日	筹划 重大 事项	30.90	2016 年 7 月 5 日	33.99	864	9,452.16	26,697.60	-

注：本基金截至 2016 年 06 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，该类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

注：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

注：本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 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

本基金为混合型的证券投资基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过相对灵活的资产配置，重点投资于有独特商业模式、深刻影响人们生活方式的快速成长的互联网公司，为互联网建设提供基础设施的软件、硬件设备等行业的公司，以及使用互联网技术、互联网工具、互联网思维带动传统产业升级改造的优质上市公司，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期、稳定增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险管理委员会，根据公司总体战略负责拟订公司风险战略和风险管理政策，并对其实施情况及效果进行监督和评价，指



导公司的风险管理和内控制度建设；对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估；监督公司的财务状况，审计公司的财务报表，评估公司的财务表现，保证公司的财务运作符合法律的要求和通行的会计标准。在业务操作层面，监察稽核部承担其他风险的管理职责，负责在各业务部门一线风险控制的基础上实施风险再控制。

本基金的基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，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**

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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与银行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；在银行间同业市场进行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风险管理流程，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。

##### **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**

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### **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。

除 6.4.13.4.1.1 中列示的卖出回购金融资产款外，本基金所承担的其他金融负债的合同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。

#### 6.4.13.4 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 2016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	5,305,254.30	-	-	-	-	-	5,305,254.30
结算备付金	2,790,816.32	-	-	-	-	-	2,790,816.32
存出保证金	345,712.64	-	-	-	-	-	345,712.64
交易性金融资产	-	-	-	-	-	35,712,608.49	35,712,608.49

应收证券清算款						15,729,464.63	15,729,464.63
应收利息						4,171.75	4,171.75
应收申购款						294,320.90	294,320.90
资产总计	8,441,783.26					51,740,565.77	60,182,349.03
负债							
应付证券清算款						4,108,800.02	4,108,800.02
应付赎回款						543,928.22	543,928.22
应付管理人报酬						68,133.71	68,133.71
应付托管费						11,355.63	11,355.63
应付交易费用						2,832,598.02	2,832,598.02
其他负债						335,020.30	335,020.30
负债总计						7,899,835.90	7,899,835.90
利率敏感度缺口	8,441,783.26					43,840,729.87	52,282,513.13
上年度末 2015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	3,404,354.29						3,404,354.29
结算备付金	2,563,720.72						2,563,720.72
存出保证金	226,923.98						226,923.98
交易性金融资产						-113,367,196.30	113,367,196.30
买入返售金融资产	15,000,000.00						15,000,000.00
应收证券清算款						9,762,327.43	9,762,327.43
应收利息						8,772.18	8,772.18
应收申购款						16,235.74	16,235.74
其他资产							
资产总计	21,194,998.99					-123,154,531.65	144,349,530.64
负债							
应付证券清算款						742,452.67	742,452.67
应付赎回款						470,989.91	470,989.91
应付管理人报酬						147,404.48	147,404.48
应付托管费						24,567.44	24,567.44
应付交易费用						876,430.95	876,430.95
其他负债						220,482.86	220,482.86
负债总计						2,482,328.31	2,482,328.31
利率敏感度缺口	21,194,998.99					-120,672,203.34	141,867,202.33

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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：本期末，在影子价格监控机制有效的前提下，若市场利率上升或下降 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会发生重大变动。

#### 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。本基金投资组合中股票占基金资产的 0%-95%，其中 80%以上的非现金投资于无限互联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%。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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) 各层次金融工具公允价值

于 2016 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次的余额为 29,086,679.85 元，属于第二层次的余额为 6,625,928.64 元，无属于第

三层次的余额(2015年6月30日：第一层级的余额为79,064,547.50元，属于第二层级的余额为13,394,896.00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和债券，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)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券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，确定相关股票和债券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，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2016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(2015年6月30日：同)。

(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。

## § 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	35,712,608.49	59.34
	其中：股票	35,712,608.49	59.34
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	8,096,070.62	13.45
7	其他各项资产	16,373,669.92	27.21
8	合计	60,182,349.03	100.00

注：由于四舍五入的原因报告期末基金资产组合各项目公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,296,100.00	2.48
C	制造业	16,128,603.94	30.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	31,631.04	0.06
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	3,704,860.45	7.09
J	金融业	14,544,300.00	27.82
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	7,113.06	0.01
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	35,712,608.49	68.31

注：以上行业分类以 2016 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

## 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票。

## 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	002289	*ST 宇顺	100,000	2,885,000.00	5.52
2	000712	锦龙股份	120,000	2,491,200.00	4.76
3	600330	天通股份	150,000	2,386,500.00	4.56
4	300352	北信源	120,000	2,240,400.00	4.29
5	300327	中颖电子	40,000	2,137,200.00	4.09
6	002673	西部证券	80,000	2,068,800.00	3.96
7	600061	国投安信	100,000	1,782,000.00	3.41
8	300097	智云股份	35,000	1,751,750.00	3.35
9	300177	中海达	100,000	1,516,000.00	2.90
10	300349	金卡股份	35,000	1,505,000.00	2.88
11	300431	暴风集团	20,000	1,450,000.00	2.77
12	000783	长江证券	120,000	1,392,000.00	2.66
13	002500	山西证券	80,000	1,324,800.00	2.53
14	600497	驰宏锌锗	130,000	1,296,100.00	2.48
15	002736	国信证券	70,000	1,207,500.00	2.31
16	000563	陕国投 A	200,000	1,098,000.00	2.10
17	603806	福斯特	20,000	1,043,800.00	2.00
18	600291	西水股份	50,000	993,500.00	1.90
19	300263	隆华节能	80,000	894,400.00	1.71
20	600705	中航资本	150,000	882,000.00	1.69
21	600884	杉杉股份	50,000	860,500.00	1.65
22	601788	光大证券	50,000	847,000.00	1.62
23	000776	广发证券	50,000	838,000.00	1.60
24	601099	太平洋	100,000	613,000.00	1.17
25	603737	三棵树	292	33,895.36	0.06
26	601611	中国核建	1,512	31,631.04	0.06
27	603919	金徽酒	864	26,697.60	0.05
28	300515	三德科技	569	26,669.03	0.05
29	603131	上海沪工	429	26,040.30	0.05
30	002799	环球印务	432	18,852.48	0.04
31	300518	盛讯达	231	10,822.35	0.02

32	002802	洪汇新材	583	8,791.64	0.02
33	603909	合诚股份	387	7,113.06	0.01
34	603958	哈森股份	443	6,423.50	0.01
35	603016	新宏泰	467	3,964.83	0.01
36	300520	科大国创	362	3,638.10	0.01
37	002805	丰元股份	624	3,619.20	0.01

## 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初基金资产净值 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	002268	卫士通	38,544,457.36	27.17
2	002464	金利科技	30,734,970.22	21.66
3	000829	天音控股	23,756,261.87	16.75
4	300031	宝通科技	23,055,321.62	16.25
5	002624	完美环球	22,359,422.90	15.76
6	600410	华胜天成	21,917,273.07	15.45
7	300059	东方财富	21,321,318.63	15.03
8	300431	暴风集团	20,686,757.22	14.58
9	002368	太极股份	19,631,184.38	13.84
10	600570	恒生电子	18,674,466.74	13.16
11	000810	创维数字	18,075,291.99	12.74
12	002587	奥拓电子	17,923,909.66	12.63
13	000938	紫光股份	17,878,993.25	12.60
14	002727	一心堂	17,857,111.12	12.59
15	002400	省广股份	16,601,896.16	11.70
16	000733	振华科技	15,315,256.64	10.80
17	300346	南大光电	15,250,101.20	10.75
18	300051	三五互联	15,148,609.21	10.68
19	600804	鹏博士	14,870,654.40	10.48
20	002443	金洲管道	14,566,166.35	10.27
21	002168	深圳惠程	13,888,351.37	9.79
22	300127	银河磁体	13,452,365.36	9.48
23	300096	易联众	12,897,097.62	9.09



24	600206	有研新材	12,441,621.35	8.77
25	002445	中南文化	12,381,735.79	8.73
26	600986	科达股份	11,795,099.99	8.31
27	601519	大智慧	11,782,235.11	8.31
28	300312	邦讯技术	11,704,430.73	8.25
29	000158	常山股份	11,691,590.03	8.24
30	002285	世联行	11,566,080.99	8.15
31	300211	亿通科技	11,086,705.37	7.81
32	300295	三六五网	11,076,789.00	7.81
33	600715	文投控股	10,825,793.05	7.63
34	300076	GQY 视讯	10,665,862.41	7.52
35	300373	扬杰科技	10,566,782.13	7.45
36	300296	利亚德	10,022,235.30	7.06
37	601198	东兴证券	9,997,859.28	7.05
38	300017	网宿科技	9,928,519.58	7.00
39	300088	长信科技	9,805,657.16	6.91
40	300046	台基股份	9,703,862.89	6.84
41	300327	中颖电子	9,659,979.62	6.81
42	002431	棕榈股份	9,657,165.48	6.81
43	300097	智云股份	9,489,663.95	6.69
44	600885	宏发股份	9,470,406.65	6.68
45	600289	亿阳信通	9,348,516.00	6.59
46	600360	华微电子	9,310,778.40	6.56
47	002574	明牌珠宝	9,269,041.26	6.53
48	300333	兆日科技	9,209,989.21	6.49
49	002056	横店东磁	8,989,867.89	6.34
50	000779	三毛派神	8,952,972.87	6.31
51	000889	茂业通信	8,663,498.56	6.11
52	002395	双象股份	8,626,019.30	6.08
53	600257	大湖股份	8,338,853.86	5.88
54	600837	海通证券	8,219,933.00	5.79
55	002517	恺英网络	7,988,005.11	5.63
56	002229	鸿博股份	7,941,205.49	5.60
57	002093	国脉科技	7,930,552.00	5.59
58	000558	莱茵体育	7,772,217.12	5.48
59	600109	国金证券	7,771,214.52	5.48

60	000802	北京文化	7,628,280.62	5.38
61	600306	*ST 商城	7,618,565.10	5.37
62	600158	中体产业	7,497,840.84	5.29
63	300128	锦富新材	7,497,225.42	5.28
64	300410	正业科技	7,410,581.00	5.22
65	002209	达意隆	7,397,267.46	5.21
66	300496	中科创达	7,327,916.62	5.17
67	300275	梅安森	7,158,249.48	5.05
68	000712	锦龙股份	7,116,150.88	5.02
69	000971	高升控股	7,075,000.00	4.99
70	300198	纳川股份	7,015,439.88	4.95
71	300340	科恒股份	6,893,437.78	4.86
72	600602	云赛智联	6,860,352.63	4.84
73	002316	键桥通讯	6,574,029.39	4.63
74	600622	嘉宝集团	6,457,526.65	4.55
75	300033	同花顺	6,432,958.00	4.53
76	000679	大连友谊	6,419,919.78	4.53
77	300365	恒华科技	6,351,680.32	4.48
78	600705	中航资本	6,261,870.00	4.41
79	002148	北纬通信	6,255,032.81	4.41
80	002537	海立美达	6,232,419.88	4.39
81	300101	振芯科技	6,107,430.21	4.31
82	600536	中国软件	5,953,560.72	4.20
83	300113	顺网科技	5,839,709.82	4.12
84	300494	盛天网络	5,764,361.00	4.06
85	300263	隆华节能	5,702,301.69	4.02
86	300352	北信源	5,685,494.03	4.01
87	002348	高乐股份	5,675,858.73	4.00
88	000892	星美联合	5,631,317.19	3.97
89	300049	福瑞股份	5,476,832.52	3.86
90	600775	南京熊猫	5,457,791.04	3.85
91	002396	星网锐捷	5,455,931.92	3.85
92	600030	中信证券	5,454,000.00	3.84
93	002245	澳洋顺昌	5,328,453.00	3.76
94	002131	利欧股份	5,289,877.00	3.73
95	600571	信雅达	5,150,293.00	3.63

96	300130	新国都	5,143,912.00	3.63
97	300242	明家联合	5,141,879.44	3.62
98	600748	上实发展	5,123,107.76	3.61
99	002600	江粉磁材	5,069,309.44	3.57
100	600330	天通股份	4,982,572.75	3.51
101	603000	人民网	4,955,971.00	3.49
102	002335	科华恒盛	4,917,295.70	3.47
103	300183	东软载波	4,898,547.43	3.45
104	002533	金杯电工	4,808,770.25	3.39
105	300063	天龙集团	4,777,596.83	3.37
106	600884	杉杉股份	4,704,169.00	3.32
107	002045	国光电器	4,662,254.81	3.29
108	600113	浙江东日	4,641,669.00	3.27
109	002484	江海股份	4,635,263.26	3.27
110	000970	中科三环	4,583,660.00	3.23
111	002362	汉王科技	4,531,872.95	3.19
112	300364	中文在线	4,512,085.00	3.18
113	300150	世纪瑞尔	4,430,683.04	3.12
114	600203	福日电子	4,427,781.14	3.12
115	002364	中恒电气	4,416,445.30	3.11
116	300018	中元股份	4,413,576.36	3.11
117	002426	胜利精密	4,395,719.75	3.10
118	300078	思创医惠	4,384,982.55	3.09
119	600552	凯盛科技	4,337,855.60	3.06
120	300114	中航电测	4,302,948.25	3.03
121	300315	掌趣科技	4,221,044.00	2.98
122	002777	久远银海	4,211,778.50	2.97
123	300213	佳讯飞鸿	4,187,136.23	2.95
124	000681	视觉中国	4,165,885.05	2.94
125	600637	东方明珠	4,154,143.21	2.93
126	300162	雷曼股份	4,139,632.00	2.92
127	600138	中青旅	4,136,219.75	2.92
128	002551	尚荣医疗	4,126,890.00	2.91
129	002502	骅威文化	4,095,981.30	2.89
130	002411	必康股份	4,091,837.00	2.88
131	603012	创力集团	4,063,427.40	2.86

132	300264	佳创视讯	4,010,747.80	2.83
133	300253	卫宁健康	3,973,566.59	2.80
134	002165	红宝丽	3,964,441.01	2.79
135	300331	苏大维格	3,947,692.00	2.78
136	603806	福斯特	3,927,697.00	2.77
137	300224	正海磁材	3,915,554.10	2.76
138	300102	乾照光电	3,914,275.64	2.76
139	300316	晶盛机电	3,906,357.80	2.75
140	600259	广晟有色	3,841,470.50	2.71
141	002319	乐通股份	3,764,796.25	2.65
142	000835	长城动漫	3,743,568.55	2.64
143	603598	引力传媒	3,743,556.40	2.64
144	300467	迅游科技	3,676,013.00	2.59
145	300252	金信诺	3,643,994.00	2.57
146	002421	达实智能	3,619,226.00	2.55
147	600332	白云山	3,609,046.87	2.54
148	000909	数源科技	3,603,947.70	2.54
149	603883	老百姓	3,602,663.65	2.54
150	300336	新文化	3,575,878.61	2.52
151	300459	浙江金科	3,549,071.00	2.50
152	002425	凯撒股份	3,530,335.69	2.49
153	600358	国旅联合	3,498,170.50	2.47
154	002605	姚记扑克	3,438,993.30	2.42
155	600455	博通股份	3,438,000.00	2.42
156	601118	海南橡胶	3,423,638.36	2.41
157	300380	安硕信息	3,403,155.00	2.40
158	300175	朗源股份	3,379,697.60	2.38
159	601318	中国平安	3,350,154.73	2.36
160	002185	华天科技	3,341,706.07	2.36
161	600520	*ST中发	3,310,721.86	2.33
162	002339	积成电子	3,289,057.64	2.32
163	600460	士兰微	3,254,433.44	2.29
164	002232	启明信息	3,189,247.00	2.25
165	002072	凯瑞德	3,164,618.00	2.23
166	300025	华星创业	3,152,702.00	2.22
167	600105	永鼎股份	3,119,523.94	2.20

168	300212	易华录	3,035,866.00	2.14
169	000969	安泰科技	3,029,037.39	2.14
170	002322	理工环科	3,009,917.60	2.12
171	000700	模塑科技	2,987,470.40	2.11
172	600703	三安光电	2,971,435.00	2.09
173	002441	众业达	2,922,108.00	2.06
174	002649	博彦科技	2,918,768.00	2.06
175	300061	康耐特	2,908,941.22	2.05
176	300379	东方通	2,897,422.63	2.04
177	000667	美好集团	2,889,262.00	2.04
178	600271	航天信息	2,875,700.00	2.03
179	300093	金刚玻璃	2,871,352.10	2.02
180	002123	荣信股份	2,867,212.00	2.02
181	002057	中钢天源	2,856,358.00	2.01
182	600392	盛和资源	2,849,083.50	2.01

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 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	002268	卫士通	38,003,701.07	26.79
2	002464	金利科技	30,516,102.86	21.51
3	002624	完美环球	23,416,685.65	16.51
4	300031	宝通科技	23,203,889.71	16.36
5	000829	天音控股	23,045,469.16	16.24
6	600570	恒生电子	21,853,854.03	15.40
7	600410	华胜天成	21,496,614.34	15.15
8	300059	东方财富	21,259,968.76	14.99
9	300431	暴风集团	19,357,252.77	13.64
10	002587	奥拓电子	18,545,838.98	13.07
11	000810	创维数字	18,148,899.02	12.79
12	000938	紫光股份	17,804,575.14	12.55
13	002368	太极股份	17,696,624.70	12.47
14	002727	一心堂	16,991,828.20	11.98
15	002285	世联行	16,973,610.24	11.96
16	600804	鹏博士	16,811,191.22	11.85

17	002400	省广股份	16,603,740.72	11.70
18	000733	振华科技	15,657,417.20	11.04
19	300346	南大光电	15,449,646.42	10.89
20	300051	三五互联	15,318,285.08	10.80
21	002443	金洲管道	14,662,549.60	10.34
22	002168	深圳惠程	14,344,498.78	10.11
23	300096	易联众	14,265,506.42	10.06
24	300127	银河磁体	14,249,848.71	10.04
25	600206	有研新材	12,667,949.85	8.93
26	300312	邦讯技术	12,077,339.33	8.51
27	002445	中南文化	12,039,941.95	8.49
28	601519	大智慧	11,876,198.58	8.37
29	000158	常山股份	11,828,567.62	8.34
30	600986	科达股份	11,786,926.82	8.31
31	300295	三六五网	11,771,933.84	8.30
32	300211	亿通科技	11,120,016.13	7.84
33	300373	扬杰科技	11,097,828.04	7.82
34	600715	文投控股	10,801,056.61	7.61
35	600109	国金证券	10,572,277.09	7.45
36	300076	GQY 视讯	10,359,663.80	7.30
37	300017	网宿科技	10,233,576.54	7.21
38	002431	棕榈股份	9,962,916.35	7.02
39	601198	东兴证券	9,905,615.00	6.98
40	300296	利亚德	9,800,005.09	6.91
41	600289	亿阳信通	9,619,604.96	6.78
42	300088	长信科技	9,490,606.72	6.69
43	300046	台基股份	9,480,173.88	6.68
44	600360	华微电子	9,477,587.76	6.68
45	000779	三毛派神	9,301,894.50	6.56
46	002056	横店东磁	9,245,443.66	6.52
47	600885	宏发股份	9,169,072.00	6.46
48	002574	明牌珠宝	9,133,756.57	6.44
49	002395	双象股份	8,925,910.18	6.29
50	300333	兆日科技	8,840,184.68	6.23
51	002229	鸿博股份	8,275,263.69	5.83
52	600536	中国软件	8,128,094.95	5.73
53	600257	大湖股份	8,106,526.10	5.71
54	600837	海通证券	8,078,819.87	5.69

55	002517	恺英网络	8,072,290.00	5.69
56	000889	茂业通信	8,017,674.83	5.65
57	300128	锦富新材	7,938,174.55	5.60
58	300097	智云股份	7,907,359.80	5.57
59	300496	中科创达	7,903,974.03	5.57
60	002093	国脉科技	7,828,982.63	5.52
61	000558	莱茵体育	7,805,672.38	5.50
62	002316	键桥通讯	7,615,487.45	5.37
63	300327	中颖电子	7,557,820.00	5.33
64	002373	千方科技	7,519,231.65	5.30
65	000802	北京文化	7,475,552.49	5.27
66	300410	正业科技	7,408,191.58	5.22
67	000971	高升控股	7,359,362.18	5.19
68	002209	达意隆	7,329,163.00	5.17
69	300340	科恒股份	7,181,599.12	5.06
70	600158	中体产业	7,156,528.64	5.04
71	300198	纳川股份	7,058,760.00	4.98
72	300275	梅安森	7,045,907.40	4.97
73	600602	云赛智联	6,962,744.79	4.91
74	300364	中文在线	6,672,752.50	4.70
75	000063	中兴通讯	6,573,213.13	4.63
76	300365	恒华科技	6,565,135.93	4.63
77	600622	嘉宝集团	6,560,449.84	4.62
78	300033	同花顺	6,508,095.26	4.59
79	002148	北纬通信	6,431,604.90	4.53
80	300101	振芯科技	6,408,036.64	4.52
81	000679	大连友谊	6,349,938.00	4.48
82	002348	高乐股份	6,162,877.36	4.34
83	002024	苏宁云商	6,157,583.06	4.34
84	600306	*ST 商城	6,093,459.88	4.30
85	002230	科大讯飞	5,905,917.00	4.16
86	600881	亚泰集团	5,857,036.26	4.13
87	002131	利欧股份	5,764,320.70	4.06
88	300113	顺网科技	5,718,886.21	4.03
89	000892	星美联合	5,637,590.96	3.97
90	002396	星网锐捷	5,558,585.50	3.92
91	002245	澳洋顺昌	5,482,510.00	3.86
92	300049	福瑞股份	5,406,677.08	3.81

93	600030	中信证券	5,373,664.10	3.79
94	300155	安居宝	5,363,190.42	3.78
95	300183	东软载波	5,354,620.21	3.77
96	002537	海立美达	5,319,630.00	3.75
97	600705	中航资本	5,267,746.00	3.71
98	002600	江粉磁材	5,264,636.38	3.71
99	300130	新国都	5,255,330.32	3.70
100	600775	南京熊猫	5,244,918.00	3.70
101	300212	易华录	5,237,540.36	3.69
102	600037	歌华有线	5,216,456.25	3.68
103	603000	人民网	5,155,671.91	3.63
104	300242	明家联合	5,124,798.70	3.61
105	600016	民生银行	5,108,000.00	3.60
106	600571	信雅达	5,101,052.46	3.60
107	300494	盛天网络	5,026,550.10	3.54
108	600748	上实发展	4,964,858.69	3.50
109	002335	科华恒盛	4,925,614.02	3.47
110	002655	共达电声	4,864,552.00	3.43
111	300263	隆华节能	4,738,776.63	3.34
112	300168	万达信息	4,712,779.00	3.32
113	300063	天龙集团	4,701,891.12	3.31
114	000970	中科三环	4,695,056.99	3.31
115	002045	国光电器	4,666,417.40	3.29
116	002185	华天科技	4,614,430.00	3.25
117	002484	江海股份	4,576,388.20	3.23
118	002533	金杯电工	4,568,346.00	3.22
119	002362	汉王科技	4,552,132.20	3.21
120	600637	东方明珠	4,547,708.00	3.21
121	600113	浙江东日	4,519,387.00	3.19
122	000712	锦龙股份	4,491,051.78	3.17
123	300078	思创医惠	4,489,202.85	3.16
124	600203	福日电子	4,445,877.98	3.13
125	002364	中恒电气	4,442,492.00	3.13
126	600552	凯盛科技	4,423,957.62	3.12
127	002426	胜利精密	4,390,698.00	3.09
128	300018	中元股份	4,340,247.32	3.06
129	300150	世纪瑞尔	4,315,485.00	3.04
130	002502	骅威文化	4,264,925.54	3.01



131	300315	掌趣科技	4,238,262.00	2.99
132	300114	中航电测	4,217,314.50	2.97
133	000681	视觉中国	4,195,735.00	2.96
134	002551	尚荣医疗	4,148,187.44	2.92
135	300253	卫宁健康	4,116,442.90	2.90
136	603012	创力集团	4,115,288.00	2.90
137	300264	佳创视讯	4,113,014.24	2.90
138	300316	晶盛机电	4,106,259.00	2.89
139	600138	中青旅	4,074,338.20	2.87
140	002411	必康股份	4,066,816.00	2.87
141	002165	红宝丽	4,026,818.00	2.84
142	300224	正海磁材	3,992,983.07	2.81
143	300045	华力创通	3,989,261.00	2.81
144	300102	乾照光电	3,972,700.13	2.80
145	300162	雷曼股份	3,929,981.00	2.77
146	300213	佳讯飞鸿	3,910,858.63	2.76
147	002319	乐通股份	3,877,848.00	2.73
148	002777	久远银海	3,837,472.52	2.70
149	600259	广晟有色	3,743,814.20	2.64
150	002421	达实智能	3,742,135.00	2.64
151	600332	白云山	3,719,244.89	2.62
152	000835	长城动漫	3,699,313.50	2.61
153	603598	引力传媒	3,694,231.75	2.60
154	300459	浙江金科	3,682,824.28	2.60
155	300331	苏大维格	3,680,297.00	2.59
156	600884	杉杉股份	3,644,535.00	2.57
157	600358	国旅联合	3,627,095.88	2.56
158	002605	姚记扑克	3,562,044.00	2.51
159	000909	数源科技	3,554,724.04	2.51
160	603883	老百姓	3,541,408.20	2.50
161	300336	新文化	3,524,820.00	2.48
162	300252	金信诺	3,520,173.12	2.48
163	300352	北信源	3,507,655.20	2.47
164	002425	凯撒股份	3,457,241.00	2.44
165	600460	士兰微	3,405,320.52	2.40
166	600520	*ST中发	3,402,855.92	2.40
167	601118	海南橡胶	3,396,226.27	2.39
168	002232	启明信息	3,357,430.01	2.37

169	300175	朗源股份	3,342,909.00	2.36
170	300380	安硕信息	3,332,312.00	2.35
171	600105	永鼎股份	3,299,709.00	2.33
172	601318	中国平安	3,261,225.00	2.30
173	002339	积成电子	3,187,730.00	2.25
174	002072	凯瑞德	3,153,030.00	2.22
175	600455	博通股份	3,129,550.25	2.21
176	300020	银江股份	3,121,227.76	2.20
177	300467	迅游科技	3,110,094.23	2.19
178	000969	安泰科技	3,086,515.76	2.18
179	300025	华星创业	3,082,426.30	2.17
180	600392	盛和资源	3,078,244.00	2.17
181	002649	博彦科技	3,069,421.07	2.16
182	300379	东方通	3,013,681.15	2.12
183	300061	康耐特	3,013,392.00	2.12
184	000673	当代东方	3,008,712.00	2.12
185	600588	用友网络	2,988,973.70	2.11
186	600703	三安光电	2,955,863.00	2.08
187	000700	模塑科技	2,955,635.28	2.08
188	600330	天通股份	2,946,195.88	2.08
189	002123	荣信股份	2,924,172.00	2.06
190	603806	福斯特	2,922,269.65	2.06
191	002322	理工环科	2,910,690.28	2.05
192	002057	中钢天源	2,893,494.20	2.04
193	600271	航天信息	2,893,487.48	2.04
194	000667	美好集团	2,876,600.00	2.03
195	300093	金刚玻璃	2,839,050.00	2.00

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	1,662,737,817.53
卖出股票收入（成交）总额	1,704,100,334.24

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 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

注：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	345,712.64
2	应收证券清算款	15,729,464.63
3	应收股利	-
4	应收利息	4,171.75
5	应收申购款	294,320.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,373,669.92

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002289	*ST 宇顺	2,885,000.00	5.52	筹划重大事项
2	600330	天通股份	2,386,500.00	4.56	筹划重大事项

注：本基金截至 2016 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，该类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。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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
1,478	42,486.56	14,653,762.38	23.34%	48,141,371.14	76.66%

**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	1,548,003.84	2.47%

**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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**8.4 发起式基金发起资金持有份额情况**

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	14,653,762.38	23.34	9,999,200.00	15.92	3年
基金管理人高级管理人员	1,293,552.19	2.06	1,293,552.19	2.06	3年
基金经理等人员	254,451.65	0.41	254,451.65	0.41	3年
基金管理人股东	0.00	0.00	0.00	0.00	3年
其他	-	-	0.00	-	
合计	16,201,766.22	25.81	11,547,203.84	18.39	

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2014年12月24日）基金份额总额	659,565,513.19
本报告期期初基金份额总额	111,016,298.78
本报告期基金总申购份额	23,125,752.40
减：本报告期基金总赎回份额	71,346,917.66
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	62,795,133.52
-------------	---------------

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：张洪水先生因个人原因自 2016 年 6 月 2 日起不再担任公司督察长职务，张洪水先生离任后，暂由总经理朱彦先生代为履行督察长职务直至新聘任督察长入职。

### 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	
川财证券	2	1,206,059,888.93	35.82%	881,993.16	37.24%	-
中信建投证券	2	583,856,686.29	17.34%	543,747.50	22.96%	新增 1 个交易单元

中信证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	542,123,235.12	16.10%	396,453.28	16.74%	新增 2 个交易单元
山西证券	2	19,917,913.17	0.59%	14,565.97	0.62%	-
招商证券	2	-	-	-	-	新增 1 个交易单元
国都证券	2	6,043,661.00	0.18%	4,419.68	0.19%	新增 1 个交易单元
联讯证券	2	701,847,582.79	20.85%	302,708.70	12.78%	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	306,723,096.22	9.11%	224,306.83	9.47%	-

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，本基金新增信达证券 2 个交易单元，新增中信建投证券、招商证券、国都证券各 1 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
川财证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	122,900,000.00	100.00%	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

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本报告期内，本基金新增信达证券 2 个交易单元，新增中信建投证券、招商证券、国都证券各 1 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	北信瑞丰基金管理有限公司关于调整基金经理的公告	中国证券报、证券时报	2016 年 1 月 20 日
2	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 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报	2016 年 1 月 21 日
3	北信瑞丰无限互联主题灵活配置	中国证券报、证券时报	2016 年 2 月 17 日



	混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要	报	
4	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 2015 年年度报告	中国证券报、证券时报	2016 年 3 月 31 日
5	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 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报	2016 年 4 月 22 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无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金的文件。
- 2、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基金合同。
- 3、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  
2016 年 8 月 26 日