

# 北信瑞丰稳定增强偏债混合型证券投资基金 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 19 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 4 月 13 日（基金合同生效日）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.....	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.....	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.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40

7.12 投资组合报告附注.....	40
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
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.....	41
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>41</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
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.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	44
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>45</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>45</b>
12.1 备查文件目录.....	45
12.2 存放地点.....	45
12.3 查阅方式.....	45

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	北信瑞丰稳定增强偏债混合型证券投资基金
基金简称	北信瑞丰稳定增强偏债
基金主代码	002194
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 13 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	187,034,198.80 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于企业债、短期融资券等信用债品种以及股票等权益资产，采用多种投资策略，在严格管理风险和保障必要流动性的前提下，实现长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据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。在严格控制投资组合风险的前提下，动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例，力图规避市场风险，提高配置效率。
业绩比较基准	30%×沪深 300 指数收益率+70%×中证全债指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期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。

### 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
	联系电话	010-68619390
	电子邮箱	service@bxrfund.com
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	《证券时报》《中国证券报》
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 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(2016 年 4 月 13 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	614,206.20
本期利润	854,926.41
加权平均基金份额本期利润	0.0039
本期加权平均净值利润率	0.39%
本期基金份额净值增长率	0.40%
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	557,053.91
期末可供分配基金份额利润	0.0030
期末基金资产净值	187,829,853.14
期末基金份额净值	1.004
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	0.40%

注：1、本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 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

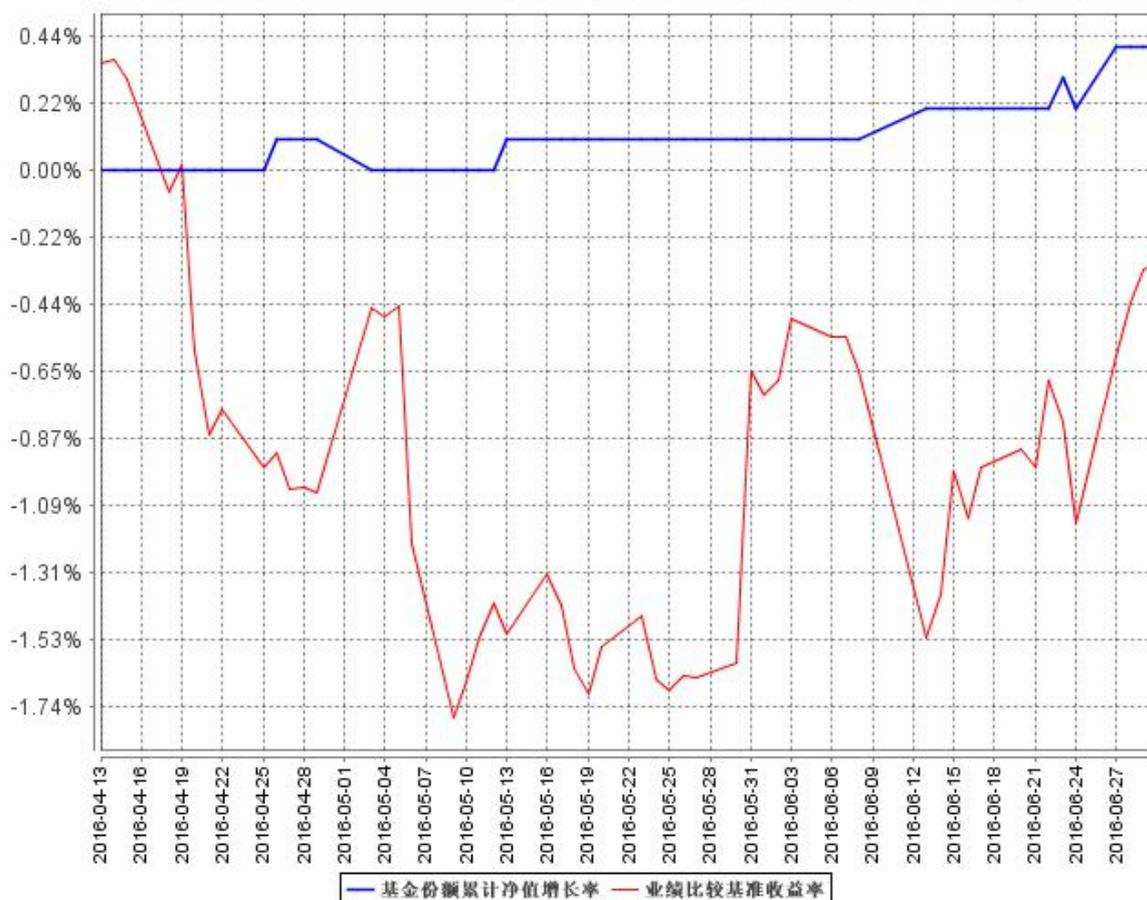
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.30%	0.06%	0.36%	0.29%	-0.06%	-0.23%
自基金合同生效起至今	0.40%	0.04%	-0.30%	0.30%	0.70%	-0.26%

注：本基金的业绩比较基准为 30%×沪深 300 指数收益率+70%×中证全债指数收益率。本基金是混合型基金，基金的投资组合比例为基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的比例不超过 30%，债券等固定收益类金融工具占基金资产的比例不低于 70%，每个交易日日终保持不低于基金资产净值的 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。因此，30%×沪深 300 指数收益率+70%×中证全债指数收益率适合作为本基金的业绩比较基准。

### 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 2016 年 4 月 13 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 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		
李富强	基金经理	2016 年 5 月 9 日	-	7	李富强先生，北京大学经济学院毕业，获经济学硕士学位，特许金融分析师（CFA）。曾就职于中国银行间市场交易商协会、中国人民银行金融市场司。2014 年 1 月加入北信瑞丰基金管理有限公司，曾任北信瑞丰基金管理有限公司投资研究部高级研究员、债券专户投资经理。现任北信瑞丰宜投宝货币市场基金基金经理、北信瑞丰现金添利货币市场基金基金经理、北信瑞丰新成长混合基金基金经理、北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金基金经理、北信瑞丰稳定增强偏债混合基金基金经理、北信瑞丰丰利保本混合基金基金经理。
王靖	基金经理	2016 年 4 月 13 日	2016 年 6 月 16 日	9	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），9 年证券或基金从业资历。曾就职于毕马威华振会计师事务所、华夏基金管理有限公司基金

					<p>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。并荣获 2015 年度开放式债券型金牛奖。</p>
--	--	--	--	--	---

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、《北信瑞丰稳定增强偏债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

经过多年的较快增长，中国经济进入相对“平稳”的发展周期，即权威人士所指出的“L 型走势”。由于今年一季度经济数据开局良好，引发了市场的乐观情绪，然而在权威人士讲话后，市场投资者得以向反向思考。风险偏好在海外脱欧、信用事件频发等一系列因素带动下震荡走高。随后二季度经济数据超预期向好，然而我们也观察到投资增速不容乐观、基建投资独木难支、外贸形势严峻，未来中国经济稳增长发展依旧承压。回顾上半年，债券市场方面，中国人民银行通过公开市场操作维持了银行间市场流动性的相对稳定，期间美国加息预期多次扰动市场情绪，6 月份英国确认脱欧，宽松预期持续，利率债并无趋势性机会；信用债方面，4 与月份信用风险事件发酵，引起信用债市场巨幅震荡，供给需求大幅减少，随后随着市场情绪恢复，信用债估值逐步回归；股票市场方面，上半年走势趋弱，熔断机制、权威人士讲话、四行业跨界定增叫停、A 股未纳入 MSCI、英国脱欧推动股价波动中向下调整。

上半年，我们基本完成了基金建仓，对于固定收益产品，在宏观分析、行业研判、公司研究的基础上审慎遴选合适债券进行作为底仓，配以足量高流动性资产进行流动性增强及波段操作。对于权益类产品，积极配置低估值股票，保障基金稳健收益，为后续打新提供条件；同时兼顾在风险可控的前提下考虑主题轮动的可能性，为投资者争取增强收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金净值增长率为 0.40%，波动率 0.04%，业绩比较基准收益率 0.30%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前海外及国内宏观经济环境仍处于调整期：美国为首的发达经济体经济复苏进程不及预期、英国脱欧影响持续发酵、地区贸易保护主义抬头、地缘政治趋于复杂化；国内经济结构性矛盾仍

较突出，经济对房地产及基建投资依赖较大，民间投资增速占比持续下降，债务杠杆继续较快上升，区域分化明显。未来，我们认为海外不安定因素仍将持续影响，国内政府将继续实施改革政策以增强金融行业信心，货币政策将相对稳健。而在下半年，金融体系内应该不会有系统性风险产生，点状信用风险事件仍将持续。

我们认为下半年中国经济仍承压，债券市场宽松预期仍是海外及国内市场的主旋律，债券牛市态势可期；短期内若无重大改革利好，股票市场仍将维持底部徘徊，趋势性机会难现。未来，宽松格局下债券资产配置有利于我们帮助投资者赚取稳健收益，同时随着本基金打新的开启，权益资产能够增强基金收益。

#### 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稳定增强偏债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，北信瑞丰稳定增强偏债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稳定增强偏债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稳定增强偏债混合型证券投资基金 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：北信瑞丰稳定增强偏债混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	8,411,821.09
结算备付金		1,190,476.19
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	69,696,430.00
其中：股票投资		9,089,430.00
基金投资		-
债券投资		60,607,000.00
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	110,000,240.00
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	458,172.03
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		189,757,139.31
<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>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		1,376,424.12
应付赎回款		329,844.58
应付管理人报酬		114,577.19
应付托管费		32,736.34
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	16,217.59
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	57,486.35
负债合计		1,927,286.17
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.4.7.9	187,034,198.80
未分配利润	6.4.7.10	795,654.34
所有者权益合计		187,829,853.14
负债和所有者权益总计		189,757,139.31

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额总额 187,034,198.80 份，基金份额净值 1.004 元。

2、本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 年 6 月 30 日未满六个月。

## 6.2 利润表

会计主体：北信瑞丰稳定增强偏债混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年4月13日(基金合同生效日)至 2016年6月30日
<b>一、收入</b>		1,348,026.76
1.利息收入		826,027.86
其中：存款利息收入	6.4.7.11	128,445.41
债券利息收入		94,137.90
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		603,444.55
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		100,962.70
其中：股票投资收益	6.4.7.12	47,719.08
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	47,523.62
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	5,720.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	240,720.21
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	180,315.99
<b>减：二、费用</b>		493,100.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	323,492.26
2. 托管费	6.4.10.2.2	92,426.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	15,311.60
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	61,870.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		854,926.41
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		854,926.41

注：本基金成立于2016年04月13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：北信瑞丰稳定增强偏债混合型证券投资基金

本报告期：2016年4月13日(基金合同生效日)至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月13日(基金合同生效日)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)	234,996,546.29	-	234,996,546.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	854,926.41	854,926.41
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)	-47,962,347.49	-59,272.07	-48,021,619.56
其中：1.基金申购款	55,321.63	65.43	55,387.06
2.基金赎回款	-48,017,669.12	-59,337.50	-48,077,006.62
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)	187,034,198.80	795,654.34	187,829,853.14

注：本基金成立于 2016 年 04 月 13 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：

<u>朱彦</u>	<u>郭亚</u>	<u>孟曦</u>
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

北信瑞丰稳定增强偏债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 2645 号《关于准予北信瑞丰稳定增强偏债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《北信瑞丰稳定增强偏债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 2016 年 3 月 4 日至 2016 年 4 月 8 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 234,880,130.44 元，业经中喜会计师事务所(特殊普通合伙)中喜验字(2016)第 0162 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《北信瑞丰稳定增强偏债混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 4 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 234,996,546.29 份基金份额，其中认购资金利息折合 116,415.85 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《北信瑞丰稳定增强偏债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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类金融工具，以及债券等固定收益类金融工具（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金等）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相关规定）。本基金股票等权益类资产占基金资产的比例不超过 30%，债券等固定收益类金融工具占基金资产的比例不低于 70%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。30%×沪深 300 指数收益率+70%×中证全债指数收益率。

#### 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》、《北信瑞丰稳定增强偏债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 2016 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2016 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 4 月 13 日（基金合同生效日）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

##### 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。本基金本报告期为 2016 年 04 月 13 日（基金合同生效日）至 2016 年 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;(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	8,411,821.09
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	8,411,821.09

注：本基金基金合同自2016年4月13日起生效，至2016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 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	9,065,439.36	9,089,430.00	23,990.64
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	60,390,270.43	60,607,000.00
	合计	60,390,270.43	60,607,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	69,455,709.79	69,696,430.00	240,720.21

注：本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 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

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	30,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	80,000,240.00	-
合计	110,000,240.00	-

注：本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 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 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	8,332.90
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	535.70
应收债券利息	411,532.85

应收买入返售证券利息	37,770.58
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	458,172.03

注：本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：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	9,775.59
银行间市场应付交易费用	6,442.00
合计	16,217.59

注：本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 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 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	414.38
预提费用	57,071.97
合计	57,486.35

注：本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 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 2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	234,996,546.29	234,996,546.29
本期申购	55,321.63	55,321.63
本期赎回(以“-”号填列)	-48,017,669.12	-48,017,669.12
- 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	187,034,198.80	187,034,198.80
-----	----------------	----------------

注：1、本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 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 2016 年 3 月 04 日至 2016 年 4 月 8 日期间公开募集，基金合同生效日的基金份额总额为 234,996,546.29 份基金份额，其中认购资金利息折合 116,415.85 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	614,206.20	240,720.21	854,926.41
本期基金份额交易产生的变动数	-57,152.29	-2,119.78	-59,272.07
其中：基金申购款	64.65	0.78	65.43
基金赎回款	-57,216.94	-2,120.56	-59,337.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	557,053.91	238,600.43	795,654.34

注：本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 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 2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	123,890.35
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	4,555.06
其他	-
合计	128,445.41

注：本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 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 2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,174,982.72
减：卖出股票成本总额	2,127,263.64

买卖股票差价收入	47,719.08
----------	-----------

注：本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 年 6 月 30 日未满六个月。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月13日(基金合同生效日)至2016年 6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	80,452,433.48
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	79,988,124.60
减：应收利息总额	416,785.26
买卖债券差价收入	47,523.62

注：本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 6.4.7.13.2 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。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期间无贵金属投资收益。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期间无衍生工具收益。

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月13日(基金合同生效日)至2016年6 月30日
股票投资产生的股利收益	5,720.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,720.00

注：本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 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 2016年4月13日(基金合同生效日)至2016 年6月30日

1. 交易性金融资产	240,720.21
——股票投资	23,990.64
——债券投资	216,729.57
——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	240,720.21

注：本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 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 2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	180,315.99
合计	180,315.99

注：1、本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 年 6 月 30 日未满六个月。

2、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。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	13,136.60
银行间市场交易费用	2,175.00
合计	15,311.60

注：本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 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 2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2016
----	--------------------------------------

	年 6 月 30 日
审计费用	15,018.69
信息披露费	42,053.28
汇划手续费	4,798.18
合计	61,870.15

注：本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 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

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：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 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

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
----	----	---------

	2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)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管理费	323,492.26	-
其中:支付销售机构的客户维护费	205,160.21	-

注: 1、本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效, 无上年度可比期间。

2、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 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。

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 2016 年 4 月 13 日(基金合同生效日)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托管费	92,426.34	-

注: 1、本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效, 无上年度可比期间。

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 0.20% 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 X 0.20% / 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

注: 报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**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**

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 2016年4月13日(基金合同生效日) 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	8,411,821.09	123,890.35	-	-

注：1、本基金基金合同自2016年4月13日起生效，无上年度可比期间。

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：本基金本期间无利润分配。

**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**

注：本基金截至2016年6月30日止未持有新股流通受限股票。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：本基金期末未持有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**

注：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**

注：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。本基金投资于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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类金融工具，以及债券等固定收益类金融工具（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金等）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相关规定）。本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的比例不超过 30%，债券等固定收益类金融工具占基金资产的比例不低于 70%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	30,004,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	30,004,000.00	-

注：1、以上按短期信用评级的债券投资中不包括国债、政策性金融债及央行票据等。

2、本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	30,603,000.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	30,603,000.00	-

注：1、以上按长期信用评级的债券投资中不包括国债、政策性金融债及央行票据等。

2、本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 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。

#### 6.4.13.4 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。

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，因此存在相应的利率风险。

##### 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	8,411,821.09	-	-	-	-	-	8,411,821.09
结算备付金	1,190,476.19	-	-	-	-	-	1,190,476.19
交易性金融资产	-	-30,004,000.00	20,099,000.00	10,504,000.00	9,089,430.00	-	69,696,430.00
买入返售金融资产	110,000,240.00	-	-	-	-	-	110,000,240.00
应收利息	-	-	-	-	-	458,172.03	458,172.03
其他资产	-	-	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	119,602,537.28	-30,004,000.00	20,099,000.00	10,504,000.00	9,547,602.03	-	189,757,139.31
负债							

应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,376,424.12	1,376,424.12
应付赎回款	-	-	-	-	-	329,844.58	329,844.58
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	114,577.19	114,577.19
应付托管费	-	-	-	-	-	32,736.34	32,736.34
应付交易费用	-	-	-	-	-	16,217.59	16,217.59
其他负债	-	-	-	-	-	57,486.35	57,486.35
负债总计	-	-	-	-	-	1,927,286.17	1,927,286.17
利率敏感度缺口	119,602,537.28	-30,004,000.00	20,099,000.00	10,504,000.00	7,620,315.86		187,829,853.14

注：1、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。

2、本基金基金合同自 2016 年 4 月 13 日起生效，至 2016 年 6 月 30 日未满六个月。

#### 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。

本基金持有的股票投资占基金资产的比例为 0% - 30%；债券等固定收益类金融工具占基金资产的比例不低于 70%；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) 各层级金融工具公允价值

于 2016 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 9,089,430.00 元，属于第二层级的余额为 60,607,000.00 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。

##### (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	9,089,430.00	4.79
	其中：股票	9,089,430.00	4.79
2	固定收益投资	60,607,000.00	31.94
	其中：债券	60,607,000.00	31.94
	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	110,000,240.00	57.97
	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	9,602,297.28	5.06
7	其他各项资产	458,172.03	0.24
8	合计	189,757,139.31	100.00

注：本基金合同生效日期为 2016 年 04 月 13 日，截止本报告期末本基金成立未满六个月。

### 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	1,777,600.00	0.95
C	制造业	4,712,230.00	2.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	752,000.00	0.40
E	建筑业	896,400.00	0.48
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	951,200.00	0.51
J	金融业	-	-
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	9,089,430.00	4.84

注：以上行业分类以 2016 年 06 月 30 日的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	600271	航天信息	70,000	1,666,000.00	0.89
2	600482	中国动力	50,000	1,638,500.00	0.87
3	600157	永泰能源	280,000	1,103,200.00	0.59
4	601186	中国铁建	90,000	896,400.00	0.48
5	600011	华能国际	100,000	752,000.00	0.40
6	600416	湘电股份	59,000	735,730.00	0.39
7	600489	中金黄金	60,000	674,400.00	0.36
8	600118	中国卫星	20,000	672,000.00	0.36
9	600050	中国联通	100,000	381,000.00	0.20
10	600652	游久游戏	20,000	290,400.00	0.15
11	600289	亿阳信通	20,000	279,800.00	0.15

注：本基金所投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

## 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	600482	中国动力	1,672,400.00	0.89
2	600271	航天信息	1,655,161.00	0.88

3	600118	中国卫星	1,302,900.00	0.69
4	600416	湘电股份	1,179,330.00	0.63
5	600157	永泰能源	1,100,400.00	0.59
6	601186	中国铁建	1,097,100.00	0.58
7	600011	华能国际	731,200.00	0.39
8	600489	中金黄金	689,200.00	0.37
9	600198	大唐电信	428,600.00	0.23
10	600050	中国联通	385,000.00	0.20
11	600289	亿阳信通	282,800.00	0.15
12	600652	游久游戏	282,412.00	0.15
13	601069	西部黄金	224,000.00	0.12
14	600171	上海贝岭	162,200.00	0.09

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	600118	中国卫星	668,393.00	0.36
2	600416	湘电股份	484,867.00	0.26
3	600198	大唐电信	433,646.00	0.23
4	601069	西部黄金	225,000.00	0.12
5	601186	中国铁建	190,600.00	0.10
6	600171	上海贝岭	172,476.72	0.09

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	11,192,703.00
卖出股票收入（成交）总额	2,174,982.72

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	30,004,000.00	15.97
6	中期票据	30,603,000.00	16.29
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	60,607,000.00	32.27

## 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	101554049	15 冀建投 MTN001	100,000	10,504,000.00	5.59
2	101652021	16 中油股 MTN001	100,000	10,074,000.00	5.36
3	101660049	16 赣高速 MTN003	100,000	10,025,000.00	5.34
4	011699960	16 京能洁能 SCP004	100,000	10,009,000.00	5.33
5	041659028	16 北电 CP001	100,000	10,004,000.00	5.33

## 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

注：本基金本报告期内未进行国债期货投资，无相关评价。

## 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	458,172.03
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	458,172.03

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本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**

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止，持有前十名股票中未存在流通受限情况。

**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
1,605	116,532.21	5,463,915.13	2.92%	181,570,283.67	97.08%

**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	20,495.73	0.01%

**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 究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2016年4月13日）基金份额总额	234,996,546.29
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	55,321.63
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	48,017,669.12
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	187,034,198.80

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

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

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

本基金于2016年4月13日成立,在报告期内,基金管理人严格参照《北信瑞丰稳定增强偏债混合型证券投资基金基金合同》及《北信瑞丰稳定增强偏债混合型证券投资基金招募说明书》内所述投资目标、投资范围开展投资,在审慎的前提下遴选优质证券,以期为投资人获取稳健回报。截至目前,本基金已经逐步完成了建仓管理。

### 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	13,367,685.72	100.00%	9,775.59	100.00%	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本报告期内，本基金新增 2 个信达证券交易单元。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
信达证券	-	-	-1,062,000,000.00	100.00%	-	-

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，本基金新增 2 个信达证券交易单元。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	北信瑞丰稳定增强偏债混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、证券时报	2016 年 4 月 14 日
2	北信瑞丰稳定增强偏债混合型基金招募说明书	中国证券报	2016 年 4 月 14 日
3	北信瑞丰稳定增强偏债混合型证券投资基金证券投资基金基金合同	中国证券报	2016 年 4 月 14 日
4	北信瑞丰稳定增强偏债混合型证券投资基金证券投资基金托管协议	中国证券报	2016 年 4 月 14 日
5	北信瑞丰稳定增强偏债混合型证券投资基金代销机构补充公告	中国证券报、证券时报	2016 年 4 月 14 日
6	北信瑞丰稳定增强偏债混合型证券投资基金发售公告	中国证券报	2016 年 4 月 14 日
7	北信瑞丰稳定增强偏债混合型证券投资基金基金合同摘要	中国证券报	2016 年 4 月 14 日
8	北信瑞丰稳定增强偏债基金开放	中国证券报、证券时报	2016 年 5 月 10 日

	日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	报	
9	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 5 月 11 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增强偏债混合型证券投资基金的文件。
- 2、北信瑞丰稳定增强偏债混合型证券投资基金基金合同。
- 3、北信瑞丰稳定增强偏债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  
2016 年 8 月 26 日