

# 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 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 月 27 日

## § 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 2017 年 03 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。

本报告中财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 5 月 17 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	北信瑞丰外延增长主题灵活配置
基金主代码	002123
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 5 月 17 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	19,618,933.69 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极灵活的资产配置，采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，重点投资于外延增长主题的上市公司，优中选优，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金经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。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	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，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	郭亚	郭明
	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

## 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>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2016 年 5 月 17 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	3,388,748.90
本期利润	2,930,967.16
加权平均基金份额本期利润	0.0913
本期基金份额净值增长率	5.80%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0580
期末基金资产净值	20,756,713.37
期末基金份额净值	1.058

注：1、本基金基金合同自 2016 年 5 月 17 日起生效，至 2016 年 12 月 31 日未满 12 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

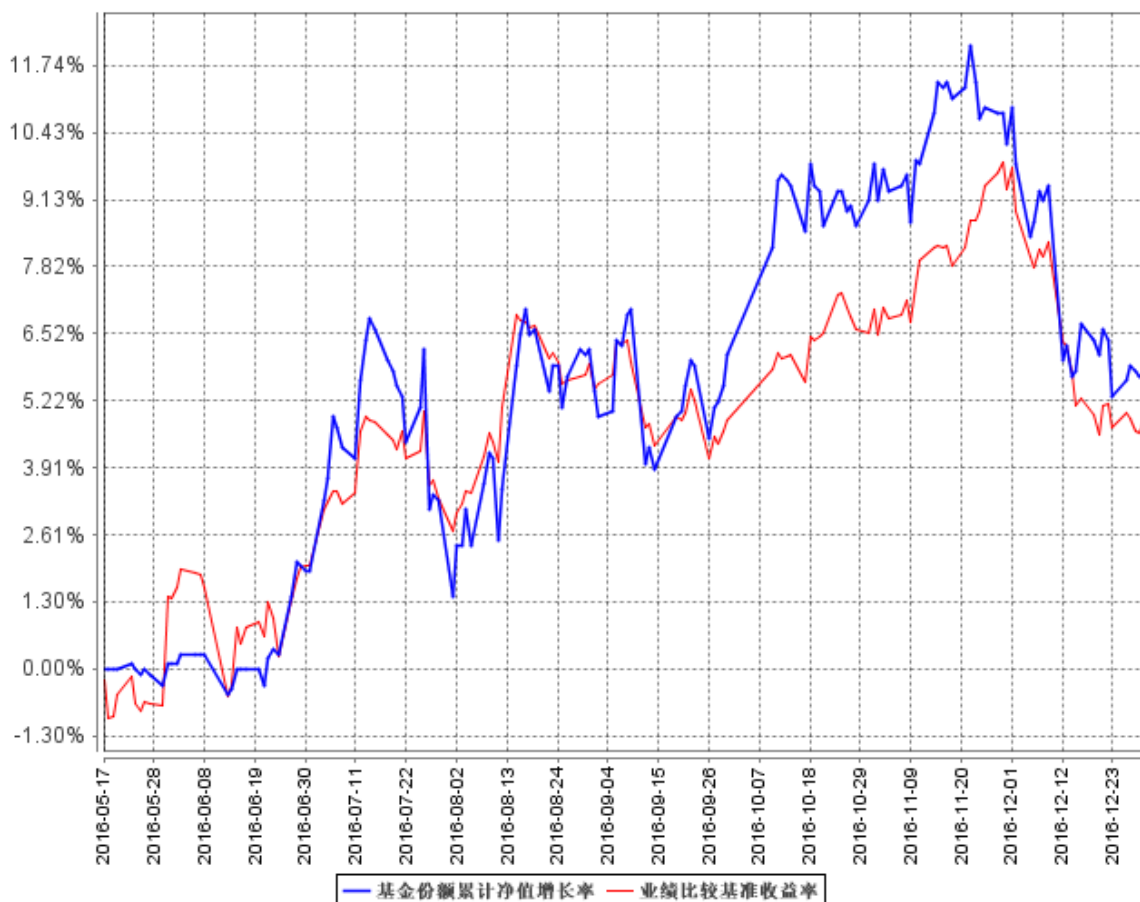
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-0.28%	0.72%	0.01%	0.44%	-0.29%	0.28%
过去六个月	3.83%	0.82%	2.77%	0.47%	1.06%	0.35%
自基金合同生效起至今	5.80%	0.74%	4.86%	0.52%	0.94%	0.22%

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

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

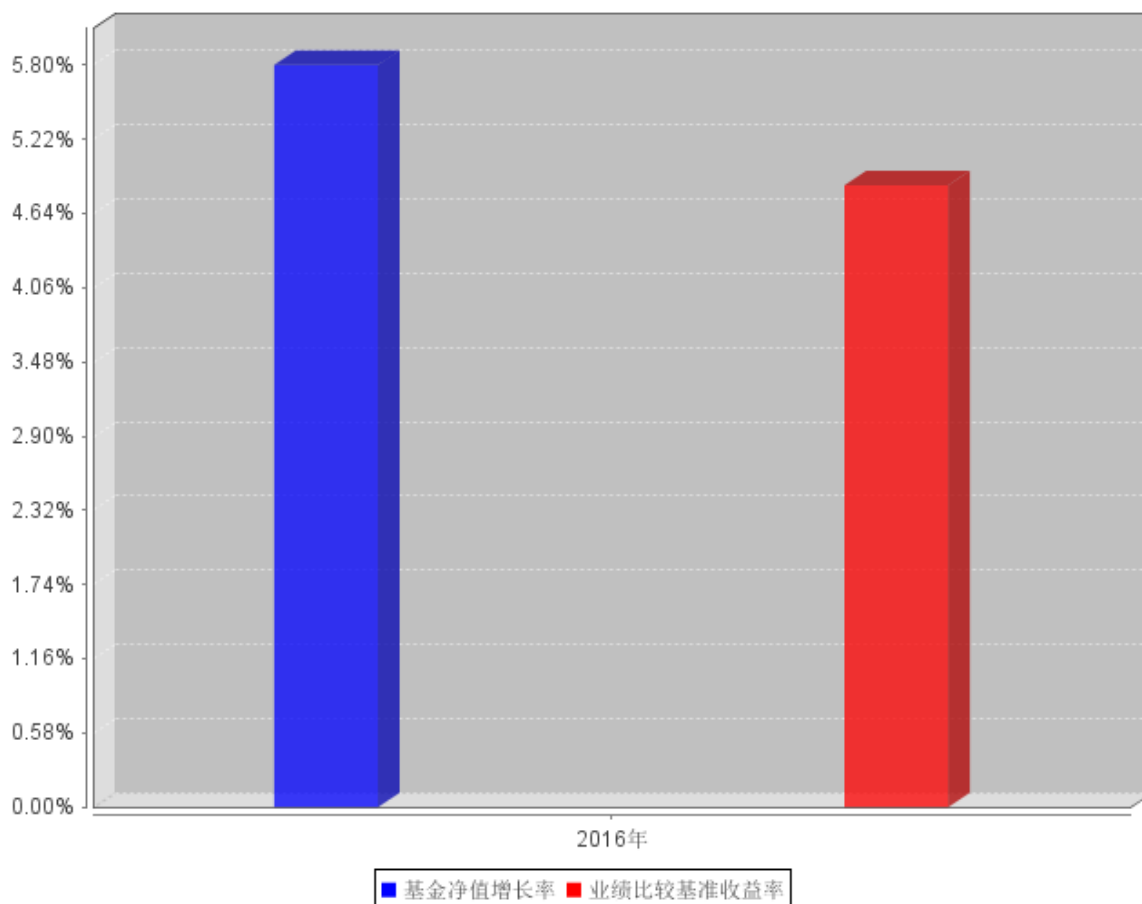
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同自 2016 年 5 月 17 日起生效，至 2016 年 12 月 31 日未满 12 个月。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2016 年 05 月 17 日生效，基金成立当年净值增长率以实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自 2016 年 5 月 17 日成立以来未实施利润分配。

## § 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。公司结合基金行业特点改善公司治理结构，积极推进股权激励，并在专户业务及子公司各业务条线进行事业部制改革。北信瑞丰基金着力打造具有高水准的投研团队，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，拥有丰富的管理经验和证券投资实战经验。

截至报告期末，公司共成立 11 只公募产品，保有 125 只专户产品，资产管理规模超过 300

亿元。

#### 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		
吴洋	基金经理	2016 年 5 月 17 日	-	7	吴洋先生，国籍：中国，学历：中国银行研究生部金融学硕士，曾就职于渤海证券研究所，宏源证券研究所以及新华基金，从事行业研究工作；于 2015 年 8 月加入北信瑞丰基金，任基金经理。

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遵规守信情况的说明

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《北信瑞丰基金管理有限公司公平交易管理办法》。公司通过 IT 系统和人工监控等方式保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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



### 4.3.3 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。

## 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

2016 年，市场经历了年初的熔断暴跌后，逐步企稳并呈现二八分化。在供给侧改革、股权转让、保险举牌、国企改革等逻辑推动下，以蓝筹股为核心的上证指数走势较强，而以成长股为主的中小创更多受扩容、减持压力等因素影响表现弱势。本基金 5 月成立，我们采取了相对稳健的策略，在市场波动中精选符合本基金投资目标的个股逐步建仓，得益于仓位控制和精选个股，同期业绩优于比较基准的表现。

对于经济形势，我们一贯对中国经济的长期增长持有的乐观判断，中国经济增长的内生动力非常强，现有技术和人口约束下的空间仍很大，现在的问题是转型过程中必然会遇到的问题，GDP 增速的下降并不可怕，甚至不是坏事。但是这些都有一个前提，那就是坚持以经济发展和改善人民生活水平为中心，坚持市场经济的基本制度和理念，由市场决定资源初次配置，政府从社会公平的角度参与收入的再分配。在这些方面到目前还没看到改变我们乐观判断的理由，相反，随十九大召开的逐步临近，在深化改革等方面的乐观因素会逐步增多。

### 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 5.80%，波动率 0.74%，业绩比较基准收益率 4.86%，波动率 0.52%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，短期谨慎、中长期乐观是我们对 A 股市场的基本判断。2017 年市场大概率仍维持震荡走势，但底部会逐步抬升，逐渐走出慢牛行情。14 年开始，宽松流动性支撑下的牛市背景并没有发生根本变化，居民财富配置逐渐转向资本市场，而且活跃的资本市场对解决企业高负债、促进投资，促进经济转型等都有重要意义。但经济活动中的各种风险因素仍在积聚，经济再次探底的风险仍在，通胀风险增加，金融风险逐渐暴露，地产调控政策加剧短期经济下行压力，美联储加息和流动性拐点预期，以及人民币汇率贬值预期对市场影响加大，短期仍将维持震荡格局。

本基金是外延增长主题基金，主要投资对象是有并购重组行为或者并购重组预期的上市公司，目前市场上并购重组行为相应标的仍有明显的超额收益，如股权转让和国企改革等，一级市场壳资源价格也居高不下。我们会保持积极进取的仓位，并严格坚持我们的选股理念，注重自下而上选股，深度挖掘公司及行业基本面，选择战略明确、管理优良、外延预期确定、安全边际高的上市公司进行投资。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人开展了基金管理公司内控自查、基金从业人员证券投资行为自查等多项内控自查工作，制定或修订了《北信瑞丰基金管理有限公司基金资产关联交易管理办法》、《公司从业人员证券投资管理制度》等内部制度，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；针对新出台的法律法规和监管要求，积极组织了多项法律法规、职业道德培训，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况；完成各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，顺应“放松管制、加强监管”的监管形势，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理公司于本报告期内成立估值小组，成员由总经理、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，在采用估值政策和程序时，充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和独立性，通过估值委员会、参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对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，北信瑞丰外延增长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外延增长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。

### 5.3 托管人对本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外延增长主题灵活配置混合型发起式证券投资基金 2016 年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 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计了后附的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的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表和 2016 年 05 月 17 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注，并出具了普华永道中天审字(2017)第 21130 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
-----	-----	-------------------------

<b>资产：</b>		
银行存款		1,899,542.42
结算备付金		392,469.48
存出保证金		34,832.96
交易性金融资产		16,555,520.00
其中：股票投资		16,555,520.00
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		-
买入返售金融资产		-
应收证券清算款		2,346,633.47
应收利息		556.80
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		21,229,555.13
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016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		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		27,122.73
应付托管费		4,520.45
应付销售服务费		-
应付交易费用		301,198.58
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		140,000.00
负债合计		472,841.76
<b>所有者权益：</b>		
实收基金		19,618,933.69
未分配利润		1,137,779.68
所有者权益合计		20,756,713.37
负债和所有者权益总计		21,229,555.13

注：1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.058 元，基金份额总额 19,618,933.69 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2016 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2016 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 5 月 17 日(基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		3,973,521.41
1. 利息收入		134,422.37
其中：存款利息收入		39,705.82
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		94,716.55
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,194,644.99
其中：股票投资收益		4,120,136.99
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		74,508.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-457,781.74
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		102,235.79
<b>减：二、费用</b>		1,042,554.25
1. 管理人报酬		311,758.73
2. 托管费		51,959.79
3. 销售服务费		-
4. 交易费用		537,250.27
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用		141,585.46
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,930,967.16
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,930,967.16
-------------------	--	--------------

注：本基金基金合同自 2016 年 05 月 17 日起生效，至 2016 年 12 月 31 日未满 12 个月。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2016 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 5 月 17 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 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）	51,488,976.23	-	51,488,976.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,930,967.16	2,930,967.16
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）	-31,870,042.54	-1,793,187.48	-33,663,230.02
其中：1. 基金申购款	413,452.91	27,385.86	440,838.77
2. 基金赎回款	-32,283,495.45	-1,820,573.34	-34,104,068.79
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）	19,618,933.69	1,137,779.68	20,756,713.37

注：本基金基金合同自 2016 年 05 月 17 日起生效，至 2016 年 12 月 31 日未满 12 个月。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>朱彦</u>	<u>朱彦</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

### 7.4 报表附注

#### 7.4.1 基金基本情况

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（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 2531 号《关于准予北信瑞丰外延

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《北信瑞丰外延增长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。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 51,486,428.66 元，业经中喜会计师事务所(特殊普通合伙)中喜验字(2016)第 0218 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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基金合同》于 2016 年 5 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 51,488,976.23 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,547.57 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《北信瑞丰外延增长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，本基金投资范围限于国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金持有的股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，80%以上的非现金基金资产投资于外延增长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%。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%。

本财务报表由本基金的基金管理人北信瑞丰基金管理有限公司于 2017 年 03 月 21 日批准报出。

#### 7.4.2 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》、《北信瑞丰外延增长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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 5 月 17

日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 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、债券投资资产支持证券投资和权证投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

##### 7.4.4.4 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或资产支持证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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和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。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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。

#### 7.4.4.10 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。

#### 7.4.4.11 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。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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。

（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。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 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。

### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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，对国债、地方政府债以及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，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。

## 7.4.7 关联方关系

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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易，无上年度可比期间。

##### 7.4.8.1 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，无上年度可比期间。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年5月17日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	311,758.73
其中：支付销售机构的客户维护费	157,883.23

注：支付基金管理人北信瑞丰基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50%/当年天数。

###### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年5月17日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	51,959.79

注：支付基金托管行中国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。

###### 7.4.8.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

**7.4.8.3 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，无上年度可比期间。

**7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.8.4.1 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	
	2016年5月17日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
基金合同生效日(2016年5月17日)持有的基金份额	9,999,291.66	
期初持有的基金份额	9,999,291.66	
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	9,999,291.66	
期末持有的基金份额占基金总份额比例	50.97%	

**7.4.8.4.2 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，无上年度可比期间。

**7.4.8.5 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5月17日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,899,542.42	29,684.71

注：1. 本基金的银行存款由基金托管行中国工商银行保管，按约定利率计息。

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金在承销期内未参与关联方承销证券，无上年度可比期间。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

注：本报告期间本基金未发生其他需要说明的关联交易事项，无上年度可比期间。

注：本基金本报告期内未实施利润分配。

## 7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金报告期末未持有因认购新发/增发的流通受限证券。

### 7.4.9.2 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
300450	先导智能	2016 年 11 月 15 日	重大资产重组	33.99	2017 年 2 月 8 日	33.00	29,200	949,970.06	992,508.00	-
002745	木林森	2016 年 7 月 15 日	重大资产重组	36.49	未知	未知	20,000	681,020.00	729,800.00	-
600406	国电南瑞	2016 年 12 月 28 日	重大事项未公告	16.63	未知	未知	13,000	218,320.00	216,190.00	-
002727	一心堂	2016 年 12 月 28 日	重大事项	21.20	2017 年 1 月 5 日	21.66	10,000	233,741.74	212,000.00	-
002685	华东重机	2016 年 12 月 19 日	重大资产重组	9.99	未知	未知	17,000	193,433.16	169,830.00	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 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。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 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。

#### 7.4.9.3.2 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。

## 7.4.10 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 12 月 31 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 14,235,192.00 元，属于第二层次的余额为 2,320,328.00 元，无属于第三层次的余额。

(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)、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。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(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 12 月 31 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	16,555,520.00	77.98
	其中：股票	16,555,520.00	77.98



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	2,292,011.90	10.80
7	其他各项资产	2,382,023.23	11.22
8	合计	21,229,555.13	100.00

注：本基金基金合同自 2016 年 05 月 17 日起生效，至 2016 年 12 月 31 日未满 12 个月。

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	424,000.00	2.04
B	采矿业	368,495.00	1.78
C	制造业	10,829,813.00	52.17
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	857,800.00	4.13
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	2,429,582.00	11.71
J	金融业	228,600.00	1.10
K	房地产业	278,630.00	1.34
L	租赁和商务服务业	401,820.00	1.94
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	135,050.00	0.65
R	文化、体育和娱乐业	601,730.00	2.90

S	综合	-	-
	合计	16,555,520.00	79.76

注：以上行业分类以 2016 年 12 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

## 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本报告期末本基金未持有按行业分类的沪港通投资股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000971	高升控股	60,000	1,419,000.00	6.84
2	300450	先导智能	29,200	992,508.00	4.78
3	002745	木林森	20,000	729,800.00	3.52
4	002250	联化科技	35,000	566,300.00	2.73
5	300282	汇冠股份	16,000	471,200.00	2.27
6	600557	康缘药业	27,000	457,110.00	2.20
7	002332	仙琚制药	33,000	424,710.00	2.05
8	600267	海正药业	32,000	420,800.00	2.03
9	002343	慈文传媒	9,000	406,530.00	1.96
10	002183	怡亚通	37,000	401,820.00	1.94

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站 [www.bxrfund.com](http://www.bxrfund.com) 的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	000971	高升控股	7,711,748.07	37.15
2	300410	正业科技	6,865,801.52	33.08
3	002183	怡亚通	5,725,159.15	27.58
4	002332	仙琚制药	4,811,356.00	23.18
5	600557	康缘药业	4,261,867.26	20.53
6	002657	中科金财	3,500,850.00	16.87
7	002343	慈文传媒	3,460,725.61	16.67
8	002551	尚荣医疗	3,321,728.20	16.00

9	600267	海正药业	3,180,591.00	15.32
10	002250	联化科技	2,841,419.00	13.69
11	002727	一心堂	2,750,347.20	13.25
12	002439	启明星辰	2,528,696.00	12.18
13	002318	久立特材	2,456,080.16	11.83
14	600889	南京化纤	2,448,377.00	11.80
15	000028	国药一致	2,371,205.00	11.42
16	002411	必康股份	2,114,316.00	10.19
17	600597	光明乳业	2,114,286.00	10.19
18	002074	国轩高科	2,039,189.00	9.82
19	002146	荣盛发展	2,033,015.02	9.79
20	600829	人民同泰	1,983,700.00	9.56
21	000060	中金岭南	1,940,850.00	9.35
22	002044	美年健康	1,805,549.48	8.70
23	000536	华映科技	1,769,721.81	8.53
24	300383	光环新网	1,734,930.40	8.36
25	300285	国瓷材料	1,716,901.00	8.27
26	300450	先导智能	1,684,357.00	8.11
27	600399	抚顺特钢	1,674,578.00	8.07
28	002102	冠福股份	1,649,428.58	7.95
29	300026	红日药业	1,628,891.00	7.85
30	600196	复星医药	1,623,293.90	7.82
31	002603	以岭药业	1,550,838.00	7.47
32	600999	招商证券	1,545,132.00	7.44
33	002373	千方科技	1,530,413.32	7.37
34	601555	东吴证券	1,526,300.00	7.35
35	600383	金地集团	1,523,938.00	7.34
36	600415	小商品城	1,467,381.83	7.07
37	600309	万华化学	1,456,700.00	7.02
38	300199	翰宇药业	1,454,986.52	7.01
39	000650	仁和药业	1,447,995.00	6.98
40	000959	首钢股份	1,417,029.28	6.83
41	300136	信维通信	1,356,384.92	6.53
42	300282	汇冠股份	1,352,976.16	6.52
43	002468	申通快递	1,351,079.00	6.51
44	601339	百隆东方	1,349,173.99	6.50

45	603077	和邦生物	1,271,468.00	6.13
46	601607	上海医药	1,268,591.00	6.11
47	002470	金正大	1,264,450.00	6.09
48	603000	人民网	1,257,558.00	6.06
49	300159	新研股份	1,256,110.00	6.05
50	002481	双塔食品	1,255,542.00	6.05
51	002500	山西证券	1,224,827.89	5.90
52	002273	水晶光电	1,211,175.00	5.84
53	300017	网宿科技	1,184,631.88	5.71
54	600104	上汽集团	1,145,016.32	5.52
55	600446	金证股份	1,120,906.00	5.40
56	600432	*ST 吉恩	1,113,700.00	5.37
57	600570	恒生电子	1,105,970.00	5.33
58	000002	万科A	1,074,616.00	5.18
59	300251	光线传媒	1,060,104.00	5.11
60	002643	万润股份	1,048,184.24	5.05
61	600782	新钢股份	1,043,300.00	5.03
62	000960	锡业股份	1,023,922.66	4.93
63	002612	朗姿股份	1,020,000.00	4.91
64	000776	广发证券	1,007,100.00	4.85
65	600422	昆药集团	1,000,036.00	4.82
66	300371	汇中股份	980,806.00	4.73
67	600872	中炬高新	977,853.00	4.71
68	002004	华邦健康	970,401.00	4.68
69	300183	东软载波	969,455.00	4.67
70	600466	蓝光发展	960,072.00	4.63
71	300463	迈克生物	939,943.00	4.53
72	600185	格力地产	930,500.00	4.48
73	600681	百川能源	911,200.00	4.39
74	601211	国泰君安	879,501.00	4.24
75	000596	古井贡酒	864,000.00	4.16
76	000651	格力电器	861,910.00	4.15
77	600005	武钢股份	861,000.00	4.15
78	000926	福星股份	856,454.00	4.13
79	600621	华鑫股份	854,357.00	4.12
80	300069	金利华电	852,790.00	4.11

81	002292	奥飞娱乐	838,000.00	4.04
82	000532	力合股份	834,532.00	4.02
83	300181	佐力药业	821,718.34	3.96
84	603398	邦宝益智	809,317.00	3.90
85	002037	久联发展	797,306.00	3.84
86	300233	金城医药	784,026.00	3.78
87	603066	音飞储存	777,634.00	3.75
88	000401	冀东水泥	773,461.00	3.73
89	002673	西部证券	773,400.00	3.73
90	603108	润达医疗	770,796.00	3.71
91	601688	华泰证券	766,788.00	3.69
92	000333	美的集团	764,661.00	3.68
93	000768	中航飞机	750,298.00	3.61
94	601169	北京银行	743,100.00	3.58
95	000848	承德露露	740,253.00	3.57
96	300357	我武生物	737,947.00	3.56
97	300170	汉得信息	727,985.00	3.51
98	603010	万盛股份	724,899.40	3.49
99	600028	中国石化	703,400.00	3.39
100	002124	天邦股份	702,207.20	3.38
101	000726	鲁泰A	699,315.00	3.37
102	002745	木林森	681,020.00	3.28
103	601588	北辰实业	660,000.00	3.18
104	300259	新天科技	659,077.00	3.18
105	600271	航天信息	656,024.00	3.16
106	600056	中国医药	647,241.00	3.12
107	002185	华天科技	634,968.00	3.06
108	300134	大富科技	634,000.00	3.05
109	000875	吉电股份	632,800.00	3.05
110	002467	二六三	631,995.00	3.04
111	300418	昆仑万维	629,164.15	3.03
112	002007	华兰生物	623,120.30	3.00
113	603868	飞科电器	622,174.00	3.00
114	002155	湖南黄金	613,884.00	2.96
115	000063	中兴通讯	604,386.00	2.91
116	600839	四川长虹	599,300.00	2.89

117	000516	国际医学	596,456.50	2.87
118	000937	冀中能源	592,498.64	2.85
119	601198	东兴证券	588,050.00	2.83
120	000751	锌业股份	583,500.00	2.81
121	001979	招商蛇口	577,153.00	2.78
122	002366	台海核电	570,500.00	2.75
123	601186	中国铁建	569,400.00	2.74
124	000793	华闻传媒	564,000.00	2.72
125	300347	泰格医药	562,162.18	2.71
126	000709	河钢股份	556,900.00	2.68
127	600804	鹏博士	555,700.00	2.68
128	002782	可立克	553,937.00	2.67
129	600740	山西焦化	553,051.00	2.66
130	600094	大名城	541,500.00	2.61
131	002193	山东如意	540,460.00	2.60
132	300005	探路者	537,806.00	2.59
133	300455	康拓红外	536,994.00	2.59
134	600108	亚盛集团	534,745.00	2.58
135	600598	北大荒	532,849.00	2.57
136	002290	禾盛新材	532,600.00	2.57
137	600019	宝钢股份	522,100.00	2.52
138	000410	沈阳机床	514,297.00	2.48
139	000620	新华联	508,250.00	2.45
140	300054	鼎龙股份	505,203.00	2.43
141	600970	中材国际	489,900.00	2.36
142	000725	京东方 A	487,800.00	2.35
143	300511	雪榕生物	484,558.00	2.33
144	002142	宁波银行	484,310.19	2.33
145	002606	大连电瓷	482,388.00	2.32
146	002642	荣之联	481,850.00	2.32
147	300097	智云股份	478,165.30	2.30
148	600409	三友化工	475,800.00	2.29
149	000869	张裕 A	465,600.00	2.24
150	002544	杰赛科技	465,300.00	2.24
151	300113	顺网科技	462,945.00	2.23
152	002685	华东重机	432,380.00	2.08

153	600018	上港集团	428,600.00	2.06
154	000429	粤高速 A	425,634.00	2.05
155	601699	潞安环能	424,500.00	2.05

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。

#### 8.4.2 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	300410	正业科技	7,171,223.82	34.55
2	000971	高升控股	6,562,731.48	31.62
3	002183	怡亚通	5,072,035.40	24.44
4	002332	仙琚制药	4,694,267.78	22.62
5	600557	康缘药业	4,129,344.17	19.89
6	002551	尚荣医疗	3,491,137.31	16.82
7	002657	中科金财	3,432,139.50	16.54
8	600267	海正药业	3,097,302.00	14.92
9	002343	慈文传媒	2,961,046.54	14.27
10	002727	一心堂	2,746,938.99	13.23
11	002318	久立特材	2,555,274.00	12.31
12	002250	联化科技	2,552,170.26	12.30
13	600889	南京化纤	2,441,450.33	11.76
14	002439	启明星辰	2,428,362.07	11.70
15	600597	光明乳业	2,257,980.00	10.88
16	002411	必康股份	2,144,847.00	10.33
17	002146	荣盛发展	2,088,290.00	10.06
18	000028	国药一致	2,076,433.00	10.00
19	600829	人民同泰	2,061,461.27	9.93
20	000060	中金岭南	2,020,941.50	9.74
21	002074	国轩高科	1,941,807.99	9.36
22	002044	美年健康	1,783,090.00	8.59
23	002102	冠福股份	1,779,671.00	8.57
24	000536	华映科技	1,773,850.00	8.55
25	300383	光环新网	1,735,183.00	8.36
26	300285	国瓷材料	1,734,648.00	8.36
27	600383	金地集团	1,669,356.99	8.04
28	300026	红日药业	1,664,334.58	8.02
29	600399	抚顺特钢	1,652,250.00	7.96

30	000959	首钢股份	1,589,172.00	7.66
31	600309	万华化学	1,587,572.00	7.65
32	601555	东吴证券	1,585,369.00	7.64
33	002603	以岭药业	1,576,217.14	7.59
34	600999	招商证券	1,562,755.00	7.53
35	002373	千方科技	1,510,698.00	7.28
36	600415	小商品城	1,509,400.00	7.27
37	300199	翰宇药业	1,487,027.48	7.16
38	000650	仁和药业	1,431,880.00	6.90
39	600196	复星医药	1,332,900.17	6.42
40	002468	申通快递	1,320,092.00	6.36
41	603077	和邦生物	1,308,112.00	6.30
42	002470	金正大	1,298,150.00	6.25
43	300136	信维通信	1,287,269.45	6.20
44	601607	上海医药	1,255,786.68	6.05
45	603000	人民网	1,250,053.00	6.02
46	002481	双塔食品	1,133,402.00	5.46
47	600570	恒生电子	1,126,848.00	5.43
48	002273	水晶光电	1,124,479.00	5.42
49	002500	山西证券	1,106,490.00	5.33
50	600446	金证股份	1,097,724.00	5.29
51	600782	新钢股份	1,091,688.00	5.26
52	000002	万科A	1,088,360.00	5.24
53	601339	百隆东方	1,081,118.00	5.21
54	000960	锡业股份	1,081,012.00	5.21
55	600422	昆药集团	1,052,929.00	5.07
56	600872	中炬高新	1,049,999.27	5.06
57	000776	广发证券	1,029,600.00	4.96
58	002612	朗姿股份	1,008,349.00	4.86
59	300371	汇中股份	1,006,020.00	4.85
60	300183	东软载波	997,053.00	4.80
61	600432	*ST 吉恩	979,600.00	4.72
62	300069	金利华电	979,050.00	4.72
63	600185	格力地产	970,600.00	4.68
64	300463	迈克生物	964,980.00	4.65
65	600466	蓝光发展	953,560.00	4.59
66	300282	汇冠股份	934,634.16	4.50
67	300159	新研股份	925,034.00	4.46



68	000596	古井贡酒	915,792.06	4.41
69	600621	华鑫股份	913,497.00	4.40
70	601211	国泰君安	911,450.00	4.39
71	002292	奥飞娱乐	908,266.00	4.38
72	000532	力合股份	901,554.00	4.34
73	600681	百川能源	893,617.00	4.31
74	002643	万润股份	868,967.00	4.19
75	000926	福星股份	849,541.45	4.09
76	600005	武钢股份	845,605.80	4.07
77	300251	光线传媒	840,200.00	4.05
78	603066	音飞储存	826,961.00	3.98
79	603108	润达医疗	813,857.00	3.92
80	600104	上汽集团	812,562.44	3.91
81	603398	邦宝益智	801,729.00	3.86
82	601688	华泰证券	793,508.16	3.82
83	000333	美的集团	780,103.00	3.76
84	002673	西部证券	778,765.00	3.75
85	000848	承德露露	778,630.00	3.75
86	300450	先导智能	768,690.00	3.70
87	603010	万盛股份	761,852.60	3.67
88	300017	网宿科技	754,023.20	3.63
89	300357	我武生物	752,604.00	3.63
90	601169	北京银行	746,800.00	3.60
91	600028	中国石化	728,100.00	3.51
92	000401	冀东水泥	719,012.00	3.46
93	300170	汉得信息	717,101.00	3.45
94	000768	中航飞机	713,529.00	3.44
95	002124	天邦股份	701,400.00	3.38
96	000726	鲁泰A	700,680.66	3.38
97	002004	华邦健康	669,960.00	3.23
98	000516	国际医学	668,000.00	3.22
99	600056	中国医药	659,600.00	3.18
100	000875	吉电股份	658,050.00	3.17
101	002007	华兰生物	652,754.00	3.14
102	002193	山东如意	649,891.00	3.13
103	300259	新天科技	633,554.00	3.05
104	300134	大富科技	633,402.00	3.05
105	600271	航天信息	629,888.00	3.03

106	601588	北辰实业	626,250.00	3.02
107	002185	华天科技	624,300.00	3.01
108	002155	湖南黄金	614,023.00	2.96
109	300233	金城医药	613,882.00	2.96
110	603868	飞科电器	608,204.00	2.93
111	000651	格力电器	605,989.00	2.92
112	002467	二六三	603,746.00	2.91
113	601198	东兴证券	599,977.00	2.89
114	600839	四川长虹	599,200.00	2.89
115	000793	华闻传媒	593,290.00	2.86
116	002782	可立克	588,724.00	2.84
117	300005	探路者	568,183.49	2.74
118	600019	宝钢股份	560,300.00	2.70
119	000751	锌业股份	559,061.00	2.69
120	000709	河钢股份	549,800.00	2.65
121	601186	中国铁建	549,000.00	2.64
122	600804	鹏博士	547,900.00	2.64
123	300455	康拓红外	547,323.00	2.64
124	600740	山西焦化	538,134.98	2.59
125	002366	台海核电	536,042.00	2.58
126	002290	禾盛新材	523,943.00	2.52
127	002037	久联发展	521,508.00	2.51
128	600970	中材国际	520,800.00	2.51
129	600094	大名城	507,580.00	2.45
130	000410	沈阳机床	502,373.98	2.42
131	000620	新华联	494,150.00	2.38
132	300054	鼎龙股份	492,046.00	2.37
133	002142	宁波银行	483,626.65	2.33
134	600409	三友化工	481,200.00	2.32
135	002642	荣之联	481,161.00	2.32
136	300181	佐力药业	473,711.00	2.28
137	002606	大连电瓷	472,687.00	2.28
138	300097	智云股份	470,000.00	2.26
139	002544	杰赛科技	461,250.00	2.22
140	000869	张裕A	456,948.00	2.20
141	300481	濮阳惠成	455,677.00	2.20
142	300113	顺网科技	449,733.34	2.17
143	300511	雪榕生物	438,778.00	2.11

144	300347	泰格医药	438,313.84	2.11
145	000429	粤高速 A	434,100.00	2.09
146	601699	潞安环能	431,300.00	2.08
147	000937	冀中能源	429,400.00	2.07
148	600018	上港集团	424,700.00	2.05

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。

### 8.4.3 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	212,406,505.21
卖出股票收入（成交）总额	199,513,340.46

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。

### 8.5 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。

### 8.6 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。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1 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。**

**8.12.2 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。**

### 8.12.3 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	34,832.96
2	应收证券清算款	2,346,633.47
3	应收股利	-
4	应收利息	556.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,382,023.23

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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	300450	先导智能	992,508.00	4.78	重大资产重组
2	002745	木林森	729,800.00	3.52	重大资产重组

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
130	150,914.87	9,999,291.66	50.97%	9,619,642.03	49.03%

### 9.2 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	6,917.13	0.04%

### 9.3 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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 9.4 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	9,999,291.66	50.97	9,999,291.66	50.97	3 年
基金管理人高级管 理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-

合计	9,999,291.66	50.97	9,999,291.66	50.97	-
----	--------------	-------	--------------	-------	---

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年5月17日）基金份额总额	51,488,976.23
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	413,452.91
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	32,283,495.45
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	19,618,933.69

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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，2016 年 7 月 14 日起，郭亚女士担任公司督察长职务。

基金托管人：本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 40,000.00 元。

**11.6 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。

**11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****11.7.1 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	168,071,998.73	40.81%	122,910.97	40.81%	新增
山西证券	2	157,421,150.46	38.22%	115,121.87	38.22%	新增
方正证券	2	76,423,482.07	18.56%	55,888.46	18.56%	新增
川财证券	2	9,951,334.24	2.42%	7,277.28	2.42%	新增

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
- ii 公司财务状况良好。
- iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。
- iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。
- v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

- ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本基金合同于 2016 年 05 月 17 日正式生效。本报告期内，本基金新增信达证券、方正证券、川财证券、山西证券各 2 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。

**11.7.2 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	-	-	38,300,000.00	3.45%	-	-
山西证券	-	-	1,032,000,000.00	92.90%	-	-
方正证券	-	-	33,500,000.00	3.02%	-	-
川财证券	-	-	7,100,000.00	0.64%	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

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

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本基金合同于 2016 年 05 月 17 日正式生效。本报告期内，本基金新增信达证券、方正证券、川财证券、山西证券各 2 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。

北信瑞丰基金管理有限公司  
2017 年 3 月 27 日