

北信瑞丰丰利混合型证券投资基金 2018 年第 2 季度报告

2018 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：北京银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 7 月 19 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 7 月 17 日 复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

北信瑞丰丰利混合型证券投资基金（以下简称“北信瑞丰丰利”）根据《北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，由北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后转型而来。自 2018 年 6 月 27 日起，“北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金”转型为“北信瑞丰丰利混合型证券投资基金”，并自该日起《北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金基金合同》失效且《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金合同》同时生效。

本报告中财务资料未经审计。

自 2018 年 6 月 27 日起原北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金转型为北信瑞丰丰利混合型证券投资基金。原北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金本报告期自 2018 年 4 月 1 日起至 2018 年 6 月 26 日止，北信瑞丰丰利混合型证券投资基金本报告期自 2018 年 6 月 27 日（基金合同生效日）起至 2018 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

转型后：

基金简称	北信瑞丰丰利
交易代码	002745
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 6 月 27 日
报告期末基金份额总额	76,139,669.47 份
投资目标	本基金主要投资于股票等权益类资产和债券等固定收益类金融工具，通过科学的资产配置与严谨的风险管理，力争超越业绩比较基准、实现基金资产持续稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略

	<p>本基金采用自上而下的策略，通过对宏观经济基本面（包括经济运行周期、财政及货币政策、产业政策等）的分析判断，和对流动性水平（包括资金面供需情况、证券市场估值水平等）的深入研究，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，并据此对本基金资产在股票、债券、现金之间的投资比例进行动态调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金的股票投资策略包括行业配置策略和个股投资策略。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>对于固定收益类资产的选择，本基金将以价值分析为主线，在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，并主要通过类属配置与债券选择两个层次进行投资管理。在类属配置层次，结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。在券种选择上，本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，重点选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，旨在通过股指期货实现基金的套期保值。</p> <p>5、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，立足于无风险套利，尽量减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*20%+中债总财富指数收益率*80%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。
基金管理人	北信瑞丰基金管理有限公司
基金托管人	北京银行股份有限公司

转型前：

基金简称	北信瑞丰丰利保本
交易代码	002745
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 6 月 21 日
报告期末基金份额总额	93,444,368.84 份
投资目标	本基金通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理，在严格控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金运用恒定比例组合保险策略（Constant Proportion Portfolio Insurance，以下简称 CPPI 策略），动态调整稳健资产与风险资产在基金组合中的投资比例，以确保本基金在保本周期到期时的本金安全，并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。具体而言，本基金的投资策略包括大类资产配置策略、稳健资产投资策略和风险资产投资策略。
业绩比较基准	两年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的低风险品种，其预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。
基金管理人	北信瑞丰基金管理有限公司
基金托管人	北京银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018 年 6 月 27 日 — 2018 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	26,487.97
2. 本期利润	37,466.00
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0005
4. 期末基金资产净值	78,836,855.04
5. 期末基金份额净值	1.0354

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、所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、报告期自 2018 年 6 月 27 日至 2018 年 6 月 30 日止。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年4月1日—2018年6月26日）
1. 本期已实现收益	1,207,241.05
2. 本期利润	1,666,981.56
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0060
4. 期末基金资产净值	96,709,752.81
5. 期末基金份额净值	1.0350

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、所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、报告期自 2018 年 4 月 1 日至 2018 年 6 月 26 日止。

3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 本报告期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

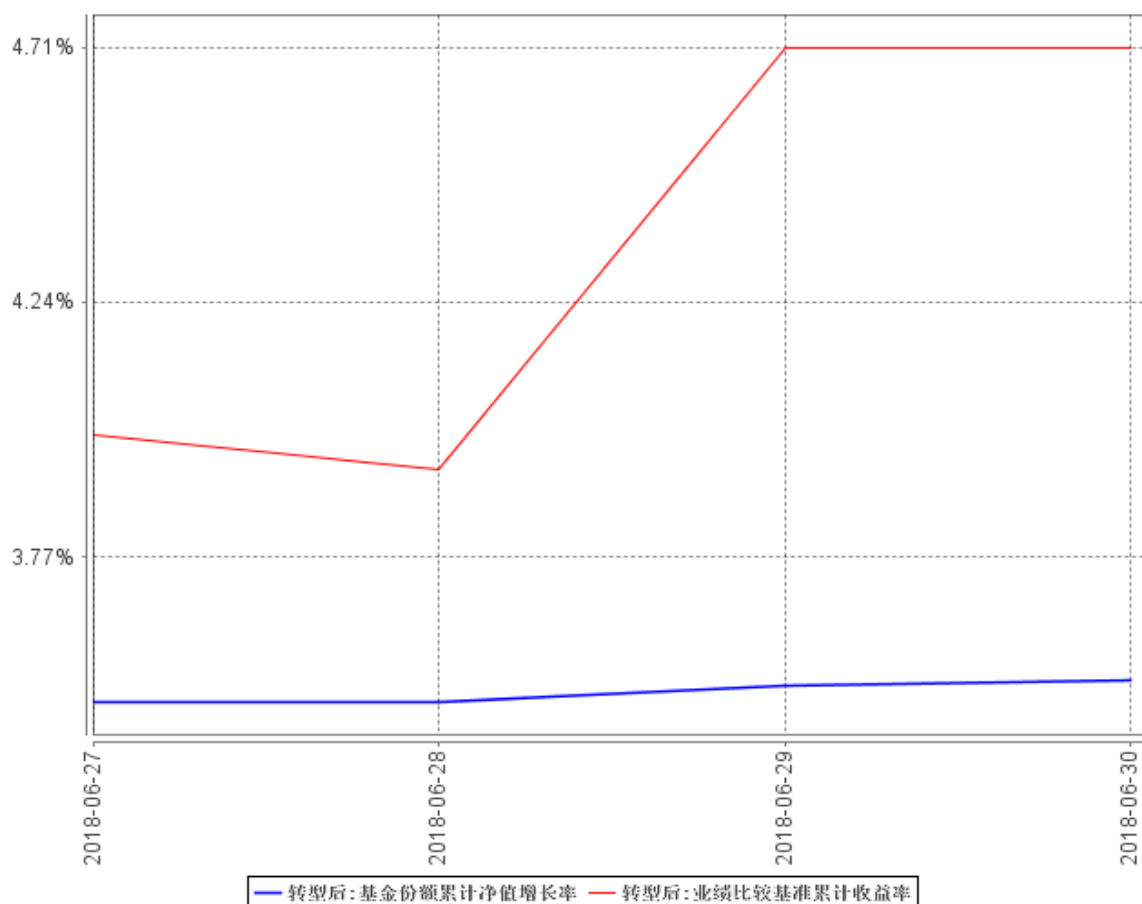
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标准 差④	①—③	②—④
过去三个月	0.04%	0.01%	0.35%	0.46%	-0.31%	-0.45%

注：1、本基金由北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金转型而来并与 2018 年 6 月 27 日起合同生效，因此上表报告期间的起始日为 2018 年 6 月 27 日。截止本报告期末本基金合同生效未满一个季度。

2、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*20%+中债总财富指数收益率*80%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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：1、本基金由北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金转型而来并与 2018 年 6 月 27 日起合同生效，因此上表报告期间的起始日为 2018 年 6 月 27 日。截止本报告期末本基金合同生效未满一个季度。

2、本基金建仓期为自基金合同生效日起的六个月。截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 本报告期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	净值增长率 ①	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	0.58%	0.04%	0.52%	0.01%	0.06%	0.03%

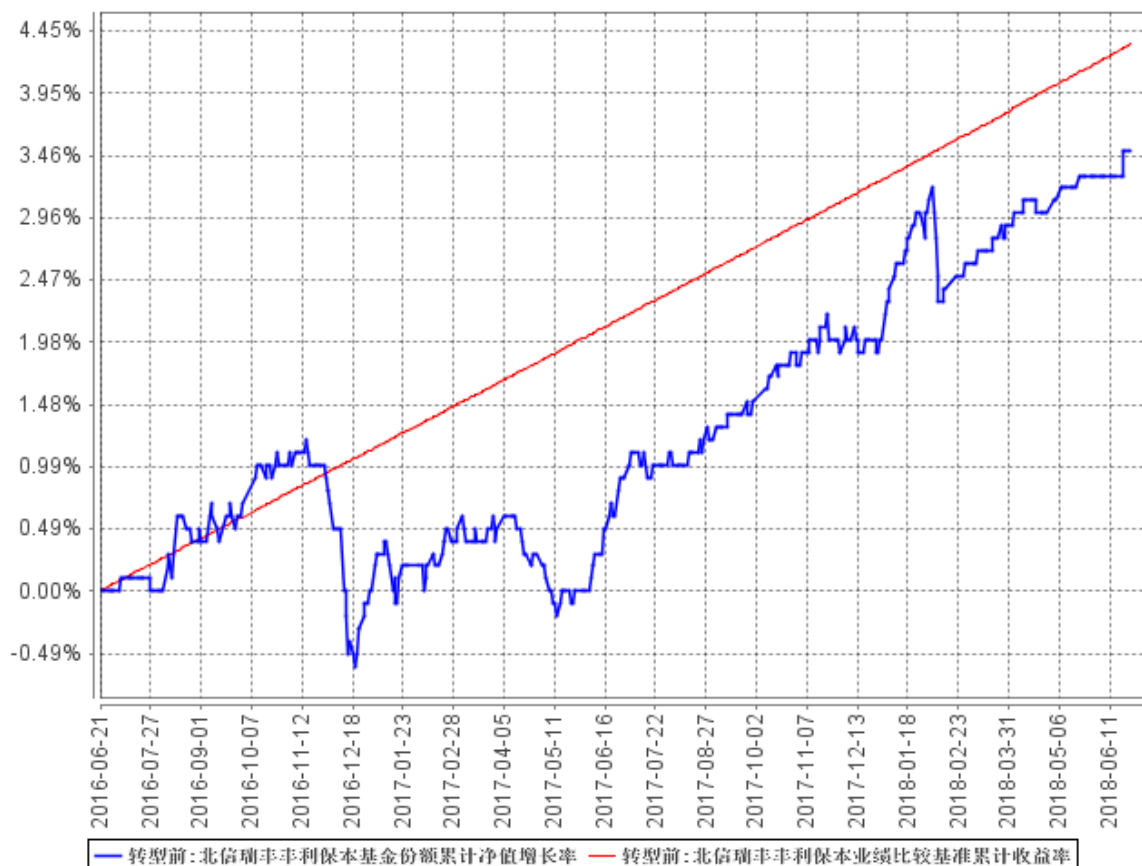
注：根据《北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，2018 年 6 月 21 日为本基金的第一个保本周期到期日。

在本基金保本周期到期期间，即自 2018 年 6 月 21 日（含）起至 2018 年 6 月 26 日（含）止本基金接受赎回、转换转出申请，不接受申购和转换转入申请。自 2018 年 6 月 27 日，“北信瑞丰丰

利保本混合型证券投资基金”转型为“北信瑞丰丰利混合型证券投资基金”，因此上表报告期间的结束日为 2018 年 6 月 26 日。本基金转型前以两年期银行定期存款税后收益率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

北信瑞丰丰利保本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：根据《北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，2018 年 6 月 21 日为本基金的第一个保本周期到期日。

在本基金保本周期到期期间，即自 2018 年 6 月 21 日（含）起至 2018 年 6 月 26 日（含）止本基金接受赎回、转换转出申请，不接受申购和转换转入申请。自 2018 年 6 月 27 日，“北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金”转型为“北信瑞丰丰利混合型证券投资基金”，因此上表报告期间的结束日为 2018 年 6 月 26 日。

3.3 其他指标

注：无

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑猛	基金经理	2017年6月15日	-	8	CFA、FRM 持证人,南开大学理学学士,北京大学工程硕士。2010年7月至2012年8月在国家开发银行天津市分行,任一级业务员(副科级);2012年9月至2014年10月在国网英大保险资产管理公司(原英大财险投资部),担任固定收益投资经理;2014年11月至2016年8月,在中国工商银行总行,资产管理部固定收益处,担任投资经理。现任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理。
董鏊洋	基金经理	2018年4月4日	-	7	英国圣安德鲁斯金融管理硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。2011年至2015年曾任联合资信评估有限公司高级分析师,从事中国债券市场工商企业信用评级工作。2015年9月加入北信瑞丰基金管理有限公司,曾任研究员、基金经理助理。

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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑猛	基金经理	2017 年 6 月 15 日	-	8	CFA、FRM 持证人,南开大学理学学士,北京大学工程硕士。2010 年 7 月至 2012 年 8 月在国家开发银行天津市分行,任一级业务员(副科级);2012 年 9 月至 2014 年 10 月在国网英大保险资产管理公司(原英大财险投资部),担任固定收益投资经理;2014 年 11 月至 2016 年 8 月,在中国工商银行总行,资产管理部固定收益处,担任投资经理。现任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理。
董臻洋	基金经理	2018 年 4 月 4 日	-	7	英国圣安德鲁斯金融管理硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。2011 年至 2015 年曾任联合资信评估有限公司高级分析师,从事中国债券市场工商企业信用评级工作。2015 年 9 月加入北信瑞丰基金管理有限公司,曾任研究员、基金经理助理。

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

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合

同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、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 公平交易专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

债市方面，二季度中国债券市场逐步走出小牛市格局，在震荡中为基金投资者带来了较为丰厚的回报。海外方面，中美双方就贸易问题展开多轮谈判、磋商，全球避险情绪升温，债券市场有所受益；国内方面，中国二季度经济数据较一季度有所滑坡，预期差向着有利于债券市场的方向进行调整；此外，“稳健中性”的货币政策也在国内、外两方面调整过程中，有所微调：4月以来中国央行开展了两次定向降准，边际宽松的货币市场情况进一步增强了债券投资者的信心。

股市方面，受中美贸易战及监管去杠杆双向挤压，二季度权益市场总体大幅下跌。由于美国贸易战直接指明针对中国制造 2025 计划，以及对中兴通讯公司的制裁及巨额罚款，电子元器件及通讯板块受到冲击最大，而估值相对较合理、成长性良好的旅游、医药、食品饮料等板块体现出一定抗跌性。放眼未来，各大股指及权重板块诸如金融、地产、煤炭等估值已逼近历史低位。

但当前市场情绪较为脆弱，总体风险偏好仍未见上升，未来人民币兑美元汇率也可能进一步快速贬值，加之贸易战的不确定性对市场从业绩和心理预期等多个层面造成扰动，因此不能以当前估值的绝对水平较低而断言股指见底。在存量博弈甚至减量博弈的市场大环境下，市场总体承压格局尚在，短期的反弹在时间和空间上都有逐渐收敛的趋势，个股仍需业绩提振因子。

2018 年二季度，本基金保本期到期。在保本期内，我们本着保本的投资策略，持续进行稳健的债券投资。通过合理控制债券组合久期，动态调整可转债品种。保障组合的流动性和收益率的稳定性在波动中寻找高性价比的债券产品，以期为投资者提供稳定的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0354 元，累计份额净值 1.0354 元；自基金转型以来，基金份额净值增长率为 0.04%，同期业绩比较基准收益率为 0.35%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注：无。

§5 投资组合报告

转型后：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,132,940.50	50.63
	其中：债券	40,132,940.50	50.63
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	31,500,000.00	39.74
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,859,698.94	7.39
8	其他资产	1,782,284.51	2.25
9	合计	79,274,923.95	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告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

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,006,000.00	25.38
	其中：政策性金融债	20,006,000.00	25.38
4	企业债券	20,126,940.50	25.53
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,132,940.50	50.91

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	122789	11 象屿债	200,000	20,008,000.00	25.38
2	170410	17 农发 10	200,000	20,006,000.00	25.38
3	122366	14 武钢债	1,190	118,940.50	0.15

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有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。

5.11.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选证券库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	38,003.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,744,280.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,782,284.51

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

转型前：**5.1 报告期末基金资产组合情况**

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,002,000.00	19.47
	其中：债券	40,002,000.00	19.47
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	38,600,000.00	18.79
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	125,091,126.57	60.89
8	其他资产	1,740,941.47	0.85
9	合计	205,434,068.04	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告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

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,992,000.00	20.67
	其中：政策性金融债	19,992,000.00	20.67
4	企业债券	20,010,000.00	20.69
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,002,000.00	41.36

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	122789	11 象屿债	200,000	20,010,000.00	20.69
2	170410	17 农发 10	200,000	19,992,000.00	20.67

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有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。

5.11.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选证券库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	38,003.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,702,937.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,740,941.47

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2018年6月27日）基金份	93,444,368.84
------------------------	---------------

额总额	
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份 额	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回 份额	17,304,699.37
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)	-
报告期期末基金份额总额	76,139,669.47

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§ 6 开放式基金份额变动(转型前)

单位:份

报告期期初基金份额总额	291,693,931.28
报告期期间基金总申购份额	69,489.73
减:报告期期间基金总赎回份额	198,319,052.17
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-” 填列)	-
报告期期末基金份额总额	93,444,368.84

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型后)

基金管理人持有本基金份额变动情况(转型后)

注:本报告期内,本公司未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细(转型后)

注:本报告期内,本公司未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

注：本报告期内，本公司未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

注：本报告期内，本公司未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人于 2018 年 6 月 15 日于《证券时报》及《中国证券报》发布了《关于修订北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金基金合同的公告》，按照本基金基金合同的约定，自 2018 年 6 月 22 日起，本基金转型为非避险策略基金，即北信瑞丰丰利混合型证券投资基金。本基金转型后，基金托管人及基金登记机构不变；基金代码亦保持不变，仍为“002745”；基金名称、基金投资、基金费率、分红方式等将按照由本基金管理人根据《基金合同》的约定拟定的《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金合同》的相关条款执行。

§9 备查文件目录

备查文件目录

- 1、原北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金转型为北信瑞丰丰利混合型证券投资基金的相关公告
- 2、《北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金招募说明书》。
- 4、《北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金托管协议》。
- 5、《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金合同》。
- 6、《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金托管协议》。
- 7、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站 www.bxrfund.com。

9.3 查阅方式

投资者可以在开放时间内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，也可登陆基金管理人网站 www.bxrfund.com 查阅。

北信瑞丰基金管理有限公司
2018 年 7 月 19 日