北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金
2018 年半年度报告

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

送出日期：2018 年 8 月 29 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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 27 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 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....2

1.1 重要提示.....2

1.2 目录.....3

§2 基金简介.....6

2.1 基金基本情况.....6

2.2 基金产品说明.....6

2.3 基金管理人和基金托管人.....6

2.4 信息披露方式.....7

2.5 其他相关资料.....7

§3 主要财务指标和基金净值表现.....8

3.1 主要会计数据和财务指标.....8

3.2 基金净值表现.....8

3.3 其他指标.....9

§4 管理人报告.....10

4.1 基金管理人及基金经理情况.....10

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....10

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....11

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....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.....13

§5 托管人报告.....14

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....14

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....14

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....14

§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....15

6.1 资产负债表.....15

6.2 利润表.....16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....17
6.4 报表附注.....18
§7 投资组合报告.....36
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.....39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....41
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....42
7.12 投资组合报告附注.....42
§8 基金份额持有人信息.....44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....44
§9 开放式基金份额变动.....45
§10 重大事件揭示.....46
10.1 基金份额持有人大会决议.....46
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.....46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....46
10.4 基金投资策略的改变.....46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....46
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.....46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....46
10.8 其他重大事件.....48
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....50

11.1 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 50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....50
§12 备查文件目录.....51
12.1 备查文件目录.....51
12.2 存放地点.....51
12.3 查阅方式.....51

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	北信瑞丰平安中国主题灵活配置
基金主代码	001154
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 5 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
报告期末基金份额总额	61,695,865.94 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，重点投资于可以代表未来平安中国发展趋势的上市公司，包括国防安全类的航天、航空、航海、核能、高端装备行业，信息安全类的通信、软件、芯片电子等行业，社会安全的安防监控类行业，以及其他涉及平安中国范畴的行业如能源安全、粮食安全、生态安全等。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。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	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭亚	刘晔
	联系电话	010-68619341	010-66223586
	电子邮箱	service@bxrfund.com	liuyel@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		4000617297	95526
传真		010-68619300	010-66226045

注册地址	北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号	北京市西城区金融大街甲 17 号首层
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	北京市西城区金融大街丙 17 号
邮政编码	100048	100033
法定代表人	周瑞明	张东宁

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bxrfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人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(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-21,769,959.79
本期利润	-14,261,663.57
加权平均基金份额本期利润	-0.2236
本期加权平均净值利润率	-26.01%
本期基金份额净值增长率	-22.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-18,205,129.97
期末可供分配基金份额利润	-0.2951
期末基金资产净值	47,073,642.91
期末基金份额净值	0.763
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-23.70%

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。

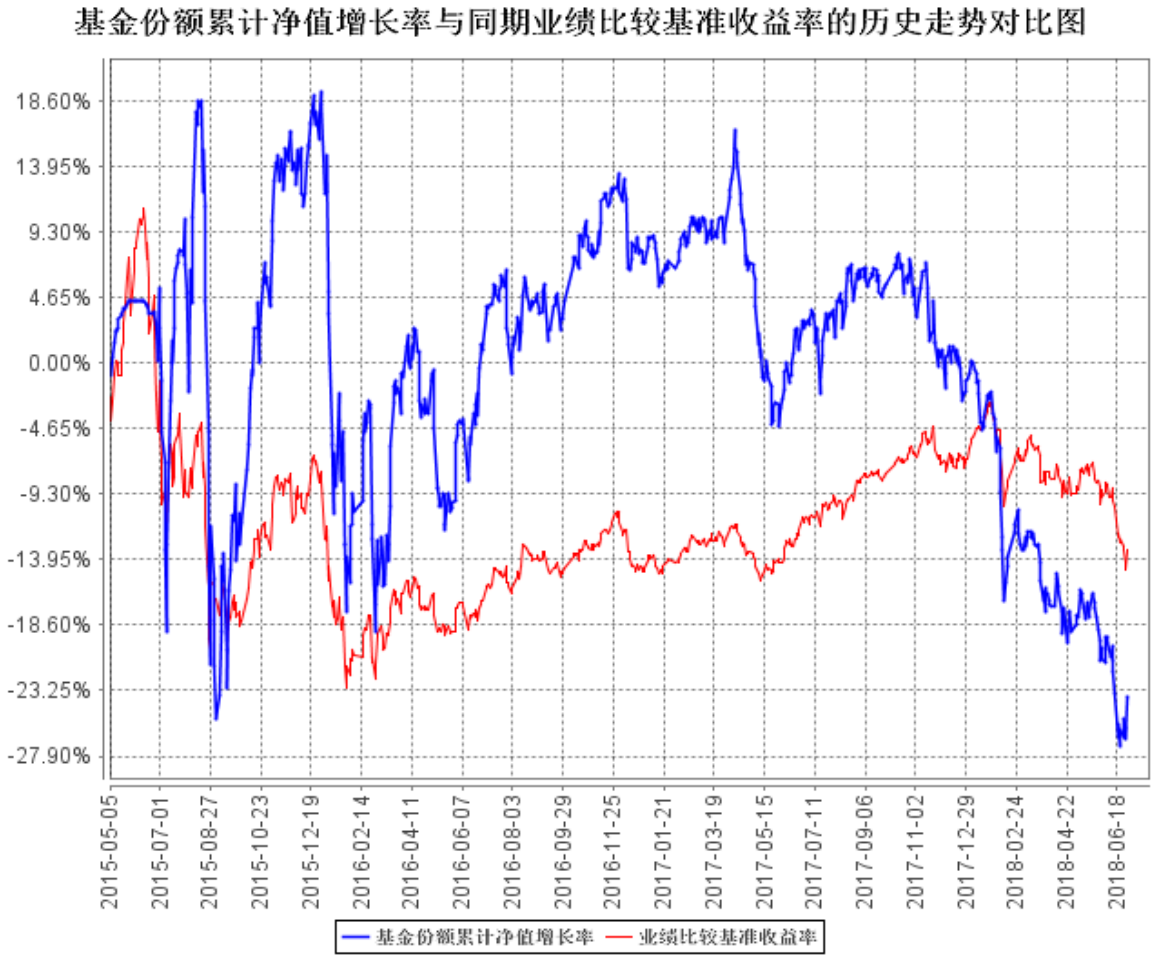
3.2 基金净值表现

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	-4.39%	1.77%	-4.65%	0.83%	0.26%	0.94%
过去三个月	-8.84%	1.36%	-6.05%	0.69%	-2.79%	0.67%
过去六个月	-22.85%	1.30%	-6.90%	0.70%	-15.95%	0.60%
过去一年	-25.71%	1.16%	-2.54%	0.57%	-23.17%	0.59%
过去三年	-27.54%	2.02%	-12.09%	0.93%	-15.45%	1.09%
自基金合同生效起至今	-23.70%	1.98%	-13.23%	1.00%	-10.47%	0.98%

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



注：本基金基金合同于 2015 年 5 月 5 日生效，基金成立当年净值增长率以实际存续期计算；报告期内本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。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，公司共有 16 只公募产品，保有 140 只专户产品，资产管理规模超过 370 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		
于军华	基金经理	2015 年 5 月 5 日	-	8	中国人民大学世界经济学硕士毕业。原国家信息中心经济咨询中心汽车行业高级项目分析师，宏源证券研究所汽车行业分析师，擅长公司基本面分析，2014 年 4 月加入北信瑞丰基金管理有限公司投资研究部，负责权益类产品的研究。
庞琳琳	基金经理	2018 年 4 月 4 日	-	11	毕业于中国人民大学商学院,管理学硕士。历任西南证券研发中心军工、机械行业研究员;宏源证券研究所机械行业组长;西南证券研发中心机械、军工、环保行业负责人。现任北信瑞丰基金管理有限公司投资研究部研究总监。

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。

4.3.2 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。

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

上半年宏观经济运行呈现以下特征：坚决彻底执行去杠杆任务，供给侧改革持续进行，高新技术产业投资不断提升，中美贸易摩擦不断升温；总体来说，宏观经济比较有韧性。

年初以来 A 股市场呈现震荡格局。1 月底以来市场出现持续性下跌，结构上消费股体现较强的相对收益。

报告期内，本基金深入研究中国核心资产类股票以及相关国防军工股票，通过自下而上潜心挖掘估值合理、成长确定性强、成长空间大、行业前景明朗的公司。

4.4.2 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 0.763 元；本报告期基金份额净值增长率为-22.85%，业绩比较基准收益率为-6.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年影响宏观的因素很多，短期和长期的、国内的和国外的。1、国外角度：中美贸易摩擦具有长期性和日益严峻性；美国加息预期年内由三次提升到四次。2、国内角度：经济增长由追求速度到追求效率和质量，经济结构调整是大方向；去杠杆持续且坚决，信用紧缩；经济增速韧性较强，硬着陆风险非常小。

展望下半年：1、内外扰动因素较大，尤其中美贸易摩擦和国内去杠杆带来的情绪面的影响要远远大于对经济基本面的实际冲击，但市场这一轮快速下跌已经反映了极为悲观的预期，对这些风险已经反映得较为充分，中长期看并不悲观；2、要更加重视国内政策动向，未来政府将加大新经济的支持力度（无论是政策还是资金）；3、长期坚定看好新科技（产业升级：包括云计算、自主可控、医药生物、高端装备、国防军工等）和新消费（消费升级：包括文体娱、食品饮料、家电轻工用品等）。

本基金会在主题范围内深入研究中国核心资产类股票以及相关国防军工股票，通过自下而上潜心挖掘估值合理、成长确定性强、成长空间大、行业前景明朗的公司。

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[2017]13 号公告《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、[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》（2017 年 9 月 5 日废止）等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设有基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、研究人员、市场人员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题；提议基金估值调整的相关方案并进行校验；根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案。

基金运营部根据基金估值工作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。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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）。

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

本基金在 2018 年 5 月 29 日（含）至 6 月 30 日期间资产净值低于伍仟万元。

§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，本基金托管人在托管北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真地复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、收益分配情况、投资组合报告的内容（“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内），保证复核内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

§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：北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日： 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	6,145,582.65	6,489,985.10
结算备付金		129,305.94	126,548.27
存出保证金		59,269.69	52,822.56
交易性金融资产	6.4.7.2	40,205,271.72	58,238,119.05
其中：股票投资		40,205,271.72	58,238,119.05
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	-	-
应收证券清算款		779,999.39	173,783.87
应收利息	6.4.7.5	1,514.81	1,474.14
应收股利		-	-
应收申购款		44,487.14	4,236.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		47,365,431.34	65,086,969.42
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2018 年 6 月 30 日**	**上年度末 2017 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	265,590.58
应付赎回款		38,812.02	58,667.87
应付管理人报酬		58,494.01	83,417.13
应付托管费		9,748.96	13,902.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	65,673.05	53,742.81
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	119,060.39	250,023.54
负债合计		291,788.43	725,344.80
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	61,695,865.94	65,099,415.75
未分配利润	6.4.7.10	-14,622,223.03	-737,791.13
所有者权益合计		47,073,642.91	64,361,624.62
负债和所有者权益总计		47,365,431.34	65,086,969.42

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.763 元，基金份额总额 61,695,865.94 份。

6.2 利润表

会计主体：北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-13,336,255.73	-2,068,566.18
1.利息收入		24,790.92	65,898.03
其中：存款利息收入	6.4.7.11	24,790.92	65,898.03
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-20,889,129.18	-6,791,976.57
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-21,119,473.64	-7,064,019.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-	-
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	230,344.46	272,043.15
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,508,296.22	4,631,239.04
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	19,786.31	26,273.32
减：二、费用		925,407.84	1,494,261.52
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	407,481.15	782,477.55

2．托管费	6.4.10.2.2	67,913.45	130,412.87
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.4.7.19	321,129.31	442,626.10
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		-	-
7．其他费用	6.4.7.20	128,883.93	138,745.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,261,663.57	-3,562,827.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,261,663.57	-3,562,827.70

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	65,099,415.75	-737,791.13	64,361,624.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-14,261,663.57	-14,261,663.57
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）	-3,403,549.81	377,231.67	-3,026,318.14
其中：1.基金申购款	7,401,385.25	-1,179,402.51	6,221,982.74
2.基金赎回款	-10,804,935.06	1,556,634.18	-9,248,300.88
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）	61,695,865.94	-14,622,223.03	47,073,642.91
项目	**上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	107,763,181.17	7,754,489.94	115,517,671.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,562,827.70	-3,562,827.70
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）	-17,083,730.61	-1,760,128.88	-18,843,859.49
其中：1.基金申购款	6,637,895.68	470,219.41	7,108,115.09
2.基金赎回款	-23,721,626.29	-2,230,348.29	-25,951,974.58
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）	90,679,450.56	2,431,533.36	93,110,983.92

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	朱彦	姜晴
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

北信瑞丰平安中国主题灵活配置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 343 号《关于准予北信瑞丰平安中国主题灵活配置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《北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型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 368,252,274.33 元，业经中喜会计师事务所(特殊普通合伙)中喜验字(2015)第 0164 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 368,382,707.92 份基金份额，其中认购资金利息折合 130,433.59 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，基金托管人为北京银行股份有限公司(以下简称“北京银行”

)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金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，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平安中国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 X 60% + 中证综合债券指数收益率 X 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》、《北信瑞丰平安中国主题灵活配置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、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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

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[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》、[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)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。对证券投资基金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)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(3)存款利息收入不征收增值税。

(4)国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(5)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，股票的股息、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。

(6)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。

(7)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。

(8)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	6,145,582.65
定期存款	-
其他存款	-
合计：	6,145,582.65

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		41,950,518.05	40,205,271.72	-1,745,246.33
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		41,950,518.05	40,205,271.72	-1,745,246.33

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本期末本基金无衍生金融资产/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

注：本期末本基金无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本期末本基金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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,429.91
应收结算备付金利息	58.20
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
其他	26.70
合计	1,514.81

6.4.7.6 其他资产

注：本期末本基金无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	65,673.05
银行间市场应付交易费用	-
合计	65,673.05

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
预提费用	119,012.93
应付赎回费	47.46
合计	119,060.39

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	65,099,415.75	65,099,415.75
本期申购	7,401,385.25	7,401,385.25

本期赎回(以"-"号填列)	-10,804,935.06	-10,804,935.06
本期末	61,695,865.94	61,695,865.94

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

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	2,866,230.27	-3,604,021.40	-737,791.13
本期利润	-21,769,959.79	7,508,296.22	-14,261,663.57
本期基金份额交易产生的变动数	698,599.55	-321,367.88	377,231.67
其中：基金申购款	-1,390,825.98	211,423.47	-1,179,402.51
基金赎回款	2,089,425.53	-532,791.35	1,556,634.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-18,205,129.97	3,582,906.94	-14,622,223.03

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	22,827.71
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	1,557.86
其他	405.35
合计	24,790.92

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	121,204,677.87
减：卖出股票成本总额	142,324,151.51
买卖股票差价收入	-21,119,473.64

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

注：本基金本报告期无债券投资。

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：本基金本报告期无贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具投资。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	230,344.46
基金投资产生的股利收益	-
合计	230,344.46

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	7,508,296.22
——股票投资	7,508,296.22
——基金投资	
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	7,508,296.22

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	19,785.90

基金转换费收入	0.41
合计	19,786.31

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	321,129.31
银行间市场交易费用	-
合计	321,129.31

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
信息披露费	99,177.14
审计费用	19,835.79
账户维护费	9,000.00
银行费用	671.00
其他	200.00
合计	128,883.93

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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：本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
北京银行股份有限公司（“北京银行”）	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。

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：本基金本报告期及上年度可比期间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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	407,481.15	782,477.55
其中：支付销售机构的客户维护费	178,607.53	344,607.37

注：1.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。

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产里列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	67,913.45	130,412.87

注：1、支付基金托管行北京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：本基金本报告期及上年度可比期间无关联方销售服务费。

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：本基金本报告期及上年度可比期间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：本基金本报告期及上年度可比期间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：本基金本报告期末及上年度可比期间末无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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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
北京银行	6,145,582.65	22,827.71	10,825,147.55	61,275.18

注：本基金的银行存款由基金托管行北京银行保管，按约定利率计息。

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：本基金本报告期及上年度可比期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未进行利润分配。

6.4.12 期末（ 2018 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：本期末本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本期末本基金无因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：本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。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资和基金投资等。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。本基金通过相对灵活的资产配置，重点投资于可以代表未来平安中国发展趋势的上市公司，包括国防安全类的航天、航空、航海、核能、高端装备行业，信息安全类的通信、软件、芯片电子等行业，社会安全的安防监控类行业，以及其他涉及平安中国范畴的行业如能源安全、粮食安全、生态安全等。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。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行北京银行，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。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。(2017 年 6 月 30 日：同)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购

交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。

本基金持有及承担的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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,145,582.65	-	-	-	6,145,582.65
结算备付金	129,305.94	-	-	-	129,305.94
存出保证金	59,269.69	-	-	-	59,269.69
交易性金融资产	-	-	-	40,205,271.72	40,205,271.72
应收证券清算款	-	-	-	779,999.39	779,999.39
应收利息	-	-	-	1,514.81	1,514.81
应收申购款	-	-	-	44,487.14	44,487.14
资产总计	6,334,158.28	-	-	41,031,273.06	47,365,431.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	38,812.02	38,812.02
应付管理人报酬	-	-	-	58,494.01	58,494.01
应付托管费	-	-	-	9,748.96	9,748.96
应付交易费用	-	-	-	65,673.05	65,673.05

其他负债	-	-	-	119,060.39	119,060.39
负债总计	-	-	-	291,788.43	291,788.43
利率敏感度缺口	6,334,158.28	-	-	40,739,484.63	47,073,642.91
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,489,985.10	-	-	-	6,489,985.10
结算备付金	126,548.27	-	-	-	126,548.27
存出保证金	52,822.56	-	-	-	52,822.56
交易性金融资产	-	-	-	58,238,119.05	58,238,119.05
应收证券清算款	-	-	-	173,783.87	173,783.87
应收利息	-	-	-	1,474.14	1,474.14
应收申购款	-	-	-	4,236.43	4,236.43
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,669,355.93	-	-	58,417,613.49	65,086,969.42
负债					
应付证券清算款	-	-	-	265,590.58	265,590.58
应付赎回款	-	-	-	58,667.87	58,667.87
应付管理人报酬	-	-	-	83,417.13	83,417.13
应付托管费	-	-	-	13,902.87	13,902.87
应付交易费用	-	-	-	53,742.81	53,742.81
其他负债	-	-	-	250,023.54	250,023.54
负债总计	-	-	-	725,344.80	725,344.80
利率敏感度缺口	6,669,355.93	-	-	57,692,268.69	64,361,624.62

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017 年 12 月 31 日：同)。

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，因此无重大外汇风险。

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平安中国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%；资产支持证券投资比例不得超过基金资产净值的 20%。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	40,205,271.72	85.41	58,238,119.05	90.49
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	40,205,271.72	85.41	58,238,119.05	90.49

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2018 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2017 年 12 月 31 日 ）
	1.业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	2,395,052.13	3,121,538.79
	2.业绩比较基准(附注	-2,395,052.13	-3,121,538.79

	6.4.1)下降 5%		

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：本基金未采用风险价值法管理风险。

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 2018 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 40,205,271.72 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额(2017 年 6 月 30 日：属于第一层次的余额为 77,494,594.98 元，属于第二层次的余额为 6,993,639.79 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、交易不活跃期间及限售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。

(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 2018 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。(2017 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。

(2)增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发　教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

(3)除公允价值和增值税外，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	40,205,271.72	84.88
	其中：股票	40,205,271.72	84.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	6,274,888.59	13.25
8	其他各项资产	885,271.03	1.87
9	合计	47,365,431.34	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	64,900.00	0.14
C	制造业	22,057,584.72	46.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	458,986.00	0.98
F	批发和零售业	1,569,522.00	3.33
G	交通运输、仓储和邮政业	337,500.00	0.72
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,458,928.00	17.97
J	金融业	2,807,061.00	5.96
K	房地产业	930,000.00	1.98
L	租赁和商务服务业	1,094,970.00	2.33
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,019,520.00	2.17
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	1,406,300.00	2.99
S	综合	-	-
	合计	40,205,271.72	85.41

注：以上行业分类以 2018 年 06 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投资组合。

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	300271	华宇软件	120,000	2,121,600.00	4.51
2	000977	浪潮信息	68,100	1,624,185.00	3.45
3	000681	视觉中国	49,000	1,406,300.00	2.99
4	600271	航天信息	55,500	1,402,485.00	2.98
5	002439	启明星辰	62,000	1,315,640.00	2.79
6	300413	快乐购	31,300	1,187,522.00	2.52
7	000768	中航飞机	74,000	1,157,360.00	2.46
8	600760	中航沈飞	31,000	1,117,240.00	2.37
9	600893	航发动力	50,000	1,116,000.00	2.37
10	601888	中国国旅	17,000	1,094,970.00	2.33
11	300424	航新科技	53,800	1,044,796.00	2.22
12	600967	内蒙一机	80,300	1,023,022.00	2.17
13	002159	三特索道	54,000	1,019,520.00	2.17
14	600038	中直股份	25,000	999,750.00	2.12
15	601939	建设银行	151,100	989,705.00	2.10
16	600036	招商银行	37,400	988,856.00	2.10
17	600276	恒瑞医药	13,000	984,880.00	2.09
18	603019	中科曙光	21,300	977,031.00	2.08

19	600309	万华化学	21,000	953,820.00	2.03
20	300159	新研股份	130,000	920,400.00	1.96
21	600030	中信证券	50,000	828,500.00	1.76
22	002368	太极股份	27,500	799,425.00	1.70
23	300059	东方财富	60,000	790,800.00	1.68
24	000661	长春高新	3,400	774,180.00	1.64
25	000538	云南白药	7,000	748,720.00	1.59
26	002572	索菲亚	23,000	740,140.00	1.57
27	002153	石基信息	25,000	725,000.00	1.54
28	603839	安正时尚	39,740	719,691.40	1.53
29	002410	广联达	25,000	693,250.00	1.47
30	300253	卫宁健康	55,700	690,123.00	1.47
31	600315	上海家化	15,300	606,339.00	1.29
32	600779	水井坊	10,000	552,300.00	1.17
33	600048	保利地产	45,000	549,000.00	1.17
34	300383	光环新网	40,000	536,400.00	1.14
35	600498	烽火通信	20,000	497,000.00	1.06
36	600887	伊利股份	16,700	465,930.00	0.99
37	601117	中国化学	68,200	458,986.00	0.98
38	000333	美的集团	8,000	417,760.00	0.89
39	600845	宝信软件	15,000	395,250.00	0.84
40	600703	三安光电	20,000	384,400.00	0.82
41	601933	永辉超市	50,000	382,000.00	0.81
42	001979	招商蛇口	20,000	381,000.00	0.81
43	600562	国睿科技	22,100	379,015.00	0.81
44	600879	航天电子	51,000	358,530.00	0.76
45	000651	格力电器	7,600	358,340.00	0.76
46	603833	欧派家居	2,800	357,084.00	0.76
47	300054	鼎龙股份	40,000	348,800.00	0.74
48	002352	顺丰控股	7,500	337,500.00	0.72
49	600855	航天长峰	28,100	329,894.00	0.70
50	603986	兆易创新	2,500	271,300.00	0.58
51	002042	华孚时尚	33,628	250,192.32	0.53
52	300571	平治信息	3,000	204,600.00	0.43
53	300523	辰安科技	3,000	186,840.00	0.40
54	000725	京东方Ａ	50,000	177,000.00	0.38
55	600028	中国石化	10,000	64,900.00	0.14

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	600887	伊利股份	2,952,263.00	4.59
2	300159	新研股份	2,905,636.00	4.51
3	600048	保利地产	2,676,424.00	4.16
4	600038	中直股份	2,542,034.44	3.95
5	300271	华宇软件	2,520,713.00	3.92
6	601318	中国平安	2,457,169.00	3.82
7	001979	招商蛇口	2,305,978.00	3.58
8	000651	格力电器	2,284,180.89	3.55
9	600019	宝钢股份	2,223,946.00	3.46
10	600036	招商银行	2,134,848.61	3.32
11	000725	京东方Ａ	2,076,528.00	3.23
12	600028	中国石化	2,057,379.00	3.20
13	000001	平安银行	1,957,800.00	3.04
14	000002	万　科Ａ	1,941,536.00	3.02
15	601988	中国银行	1,870,632.50	2.91
16	601006	大秦铁路	1,853,274.00	2.88
17	601668	中国建筑	1,830,965.00	2.84
18	600383	金地集团	1,803,929.00	2.80
19	002572	索菲亚	1,796,009.00	2.79
20	002439	启明星辰	1,744,487.00	2.71
21	000333	美的集团	1,735,119.00	2.70
22	601288	农业银行	1,727,600.00	2.68
23	600030	中信证券	1,700,054.00	2.64
24	000977	浪潮信息	1,689,936.00	2.63
25	000768	中航飞机	1,638,464.00	2.55
26	600690	青岛海尔	1,630,399.00	2.53
27	601398	工商银行	1,615,900.00	2.51
28	600271	航天信息	1,612,861.00	2.51
29	601088	中国神华	1,531,552.00	2.38
30	600309	万华化学	1,517,644.00	2.36

31	300145	中金环境	1,517,625.00	2.36
32	300059	东方财富	1,504,165.00	2.34
33	600893	航发动力	1,501,064.00	2.33
34	000681	视觉中国	1,475,254.00	2.29
35	600967	内蒙一机	1,472,849.00	2.29
36	600760	中航沈飞	1,409,094.00	2.19
37	600703	三安光电	1,408,450.00	2.19
38	002159	三特索道	1,379,289.00	2.14
39	600570	恒生电子	1,368,048.00	2.13
40	601888	中国国旅	1,359,604.89	2.11
41	600585	海螺水泥	1,300,021.00	2.02

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	603678	火炬电子	3,951,974.00	6.14
2	600967	内蒙一机	3,777,819.00	5.87
3	300424	航新科技	3,040,558.00	4.72
4	002414	高德红外	2,955,613.00	4.59
5	002544	杰赛科技	2,912,591.40	4.53
6	600038	中直股份	2,836,836.51	4.41
7	300342	天银机电	2,797,201.70	4.35
8	600893	航发动力	2,768,933.00	4.30
9	300065	海兰信	2,500,817.73	3.89
10	600760	中航沈飞	2,259,869.00	3.51
11	002465	海格通信	2,214,617.20	3.44
12	600887	伊利股份	2,189,250.00	3.40
13	601318	中国平安	2,112,780.00	3.28
14	601989	中国重工	2,071,542.00	3.22
15	600019	宝钢股份	1,983,750.00	3.08
16	600028	中国石化	1,962,160.00	3.05
17	600150	*ST 船舶	1,883,362.00	2.93
18	000651	格力电器	1,746,009.00	2.71
19	600685	中船防务	1,743,177.56	2.71
20	600372	中航电子	1,735,308.40	2.70

21	600990	四创电子	1,722,627.36	2.68
22	600855	航天长峰	1,623,622.00	2.52
23	000002	万　科Ａ	1,622,700.00	2.52
24	601006	大秦铁路	1,611,888.00	2.50
25	600048	保利地产	1,598,430.00	2.48
26	601668	中国建筑	1,593,700.00	2.48
27	600879	航天电子	1,559,302.00	2.42
28	601288	农业银行	1,545,100.00	2.40
29	601988	中国银行	1,534,200.00	2.38
30	001979	招商蛇口	1,518,183.00	2.36
31	000001	平安银行	1,507,891.00	2.34
32	300159	新研股份	1,505,639.00	2.34
33	300145	中金环境	1,474,241.00	2.29
34	600482	中国动力	1,442,827.00	2.24
35	600501	航天晨光	1,419,417.00	2.21
36	600118	中国卫星	1,415,380.10	2.20
37	600690	青岛海尔	1,405,868.00	2.18
38	601398	工商银行	1,403,200.00	2.18
39	600585	海螺水泥	1,325,400.00	2.06
40	600383	金地集团	1,301,540.00	2.02
41	000725	京东方Ａ	1,294,112.00	2.01

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	116,783,007.96
卖出股票收入（成交）总额	121,204,677.87

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：本基金本报告期末未投资股指期货，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	59,269.69
2	应收证券清算款	779,999.39
3	应收股利	-
4	应收利息	1,514.81
5	应收申购款	44,487.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	885,271.03

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：本基金报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 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。

§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
1,781	34,641.14	1,000.00	0.00%	61,694,865.94	100.00%

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	171,189.79	0.28%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2015 年 5 月 5 日 ）基金份额总额	368,382,707.92
本报告期期初基金份额总额	65,099,415.75
本报告期基金总申购份额	7,401,385.25
减:本报告期基金总赎回份额	10,804,935.06
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	61,695,865.94

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：本报告期基金管理人无重大人事变动。

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。

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 19,835.79 元。

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	
国联证券	2	179,591,001.75	75.46%	131,334.70	73.45%	-
东吴证券	1	34,535,199.68	14.51%	25,255.34	14.12%	-
中信建投	2	23,861,484.40	10.03%	22,222.15	12.43%	-
联储证券	1	-	-	-	-	-

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，本基金无新增交易单元。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
国联证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-

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，本基金无新增交易单元。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	北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报	2018 年 1 月 19 日
2	北信瑞丰基金关于旗下部分基金在华信证券开通基金转换并参加转换费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报	2018 年 1 月 29 日
3	北信瑞丰基金管理有限公司关于增加中泰证券股份有限公司为基金代销机构公告	中国证券报、证券时报	2018 年 3 月 15 日
4	北信瑞丰基金管理有限公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为基金代销机构公告	中国证券报、证券时报	2018 年 3 月 27 日
5	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加工商银行申购费率优惠的公告	中国证券报、证券时报	2018 年 3 月 30 日
6	北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告	中国证券报、证券时报	2018 年 3 月 31 日
7	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	2018 年 4 月 9 日
8	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下基金转换业务资金交收日调整的公告	中国证券报、证券时报	2018 年 4 月 19 日
9	北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报	2018 年 4 月 20 日
10	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下基金转换业务资金交收日调整的公告	中国证券报、证券时报	2018 年 5 月 16 日
11	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与银河证券费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报	2018 年 5 月 21 日
12	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下基金新增珠海盈米财富管理	中国证券报、证券时报	2018 年 6 月 6 日

	有限公司为基金代销机构和参与费率优惠活动的公告		
13	北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)	中国证券报、证券时报	2018 年 6 月 15 日
14	北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要	中国证券报、证券时报	2018 年 6 月 15 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 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平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金的文件。

2、北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同。

3、北信瑞丰平安中国主题灵活配置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

2018 年 8 月 29 日