

北信瑞丰丰利混合型证券投资基金  
(北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金)

2018 年年度报告

2018 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：北京银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 28 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 2019 年 3 月 25 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。

北信瑞丰丰利混合型证券投资基金根据《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。

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 1 月 1 日至 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 日至 2018 年 12 月 31 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>6</b>
2.1 基金基本情况（转型后）.....	6
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	6
2.2 基金产品说明（转型前）.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现（转型后）.....	10
3.2 基金净值表现（转型前）.....	12
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	14
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>15</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
4.9 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.....	19
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>20</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	20
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.....	20
<b>§6 审计报告（转型后）</b> .....	<b>21</b>
6.1 审计报告基本信息.....	21
6.2 审计报告的基本内容.....	21
<b>§6 审计报告（转型前）</b> .....	<b>24</b>
6.1 审计报告基本信息.....	24
6.2 审计报告的基本内容.....	24
<b>§7 年度财务报表（转型后）</b> .....	<b>27</b>
7.1 资产负债表（转型后）.....	27
7.2 利润表.....	28
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	29
7.4 报表附注.....	30
<b>§7 年度财务报表（转型前）</b> .....	<b>49</b>
7.1 资产负债表（转型前）.....	49

7.2 利润表.....	50
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	51
7.4 报表附注.....	52
<b>§8 投资组合报告（转型后）.....</b>	<b>74</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	74
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	75
8.3 报告期内股票投资组合的重大变动.....	78
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	80
8.5 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.....	80
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	80
8.7 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.....	80
8.8 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.....	80
8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	80
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	81
8.11 投资组合报告附注.....	81
<b>§8 投资组合报告（转型前）.....</b>	<b>83</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	83
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	83
8.3 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.....	83
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	83
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	85
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.....	85
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	85
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.....	86
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.....	86
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	86
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	86
8.12 投资组合报告附注.....	86
<b>§9 基金份额持有人信息（转型后）.....</b>	<b>88</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	88
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	88
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.....	88
<b>§9 基金份额持有人信息（转型前）.....</b>	<b>89</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	89
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	89
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.....	89
<b>§ 10 开放式基金份额变动(转型后).....</b>	<b>90</b>
<b>§ 10 开放式基金份额变动(转型前).....</b>	<b>91</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>92</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	92
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.....	92
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	92
11.4 基金投资策略的改变.....	92
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	92
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.....	92

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后） .....	92
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前） .....	94
11.9 其他重大事件（转型后） .....	95
11.9 其他重大事件（转型前） .....	97
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>99</b>
12.1 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（转型后） .....	99
12.1 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（转型前） .....	99
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	99
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>100</b>
13.1 备查文件目录.....	100
13.2 存放地点.....	100
13.3 查阅方式.....	100

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金
基金简称	北信瑞丰丰利
基金主代码	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
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	25,143,699.36份
基金合同存续期	不定期

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金
基金简称	北信瑞丰丰利保本
基金主代码	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
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	93,444,368.84份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明（转型后）

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	<p>1、资产配置策略</p> <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、</p>

	<p>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。

## 2.2 基金产品说明（转型前）

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。

## 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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
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

注：2018年1月1日至2018年6月26日期间，原北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金的基金保证人为北京中关村科技融资担保有限公司，其办公地址为北京市海淀区中关村南大街12号天作国际中心1号楼A座30层。



### §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

转型后

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2018年6月27日(基金转型日)至2018年12月31日
本期已实现收益	62,319.92
本期利润	214,682.26
加权平均基金份额本期利润	0.0060
本期加权平均净值利润率	0.58%
本期基金份额净值增长率	-0.05%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2018年12月31日
期末可供分配利润	861,096.61
期末可供分配基金份额利润	0.0342
期末基金资产净值	26,012,236.31
期末基金份额净值	1.0345
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2018年12月31日
基金份额累计净值增长率	-0.05%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）；

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、报告期自 2018 年 6 月 27 日至 2018 年 12 月 31 日止。

转型前

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2018年1月1日至 2018年6月26日	2017年	2016年
本期已实现收益	2,704,607.77	3,996,128.38	4,942,971.04
本期利润	4,419,369.05	6,818,880.78	193,574.62
加权平均基金份额本期利润	0.0153	0.0195	0.0005
本期加权平均净值利润率	1.48%	1.93%	0.05%
本期基金份额净值增长率	1.47%	2.00%	0.00%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2018年6月26日	2017年末	2016年末
期末可供分配利润	3,265,383.97	6,077,087.74	124,916.55
期末可供分配基金份额利润	0.0349	0.0199	0.0003

期末基金资产净值	96,709,752.81	311,667,989.08	373,265,578.92
期末基金份额净值	1.035	1.020	1.000
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2018年6月26日	2017年末	2016年末
基金份额累计净值增长率	3.50%	2.00%	0.00%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）；

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、报告期自 2018 年 1 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 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

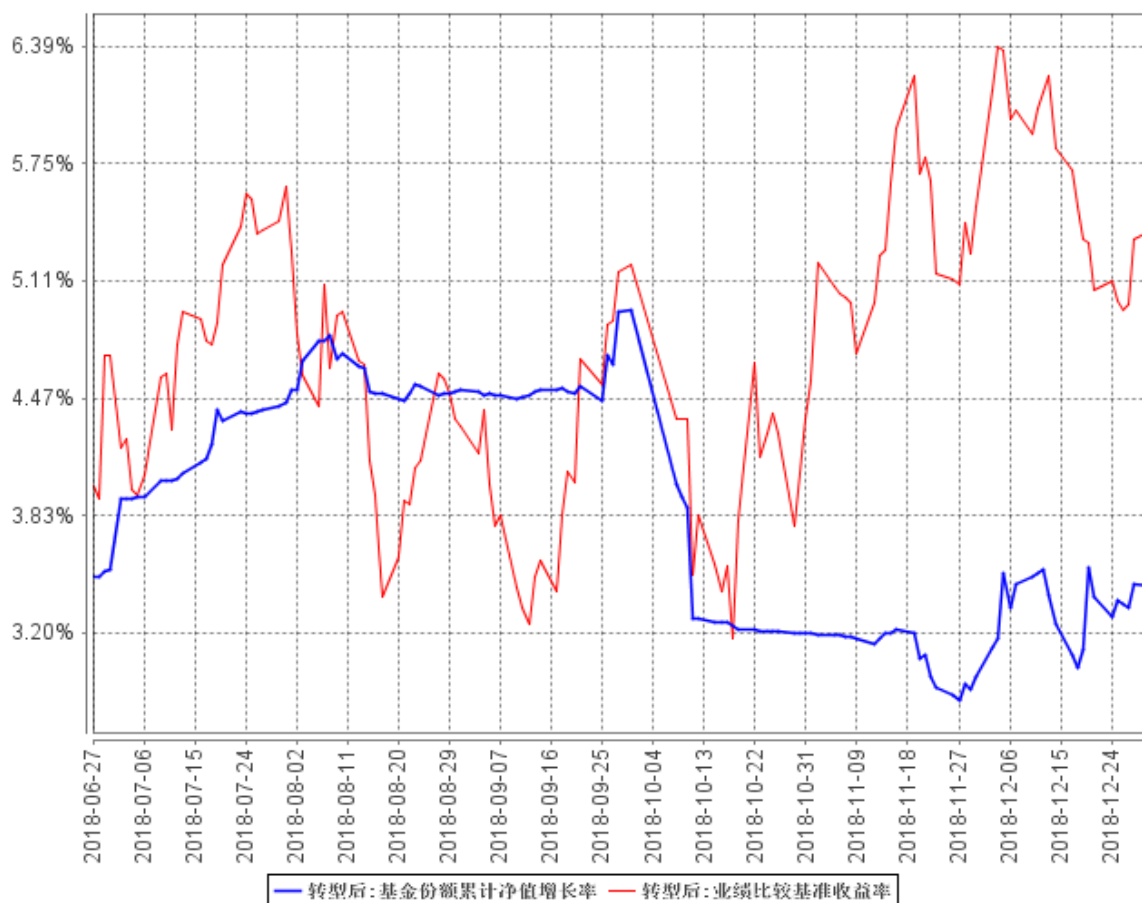
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.43%	0.17%	0.18%	0.32%	-1.61%	-0.15%
过去六个月	-0.09%	0.13%	0.64%	0.29%	-0.73%	-0.16%
自基金合同生效起至今	-0.05%	0.13%	1.00%	0.29%	-1.05%	-0.16%

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年。

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 自基金转型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

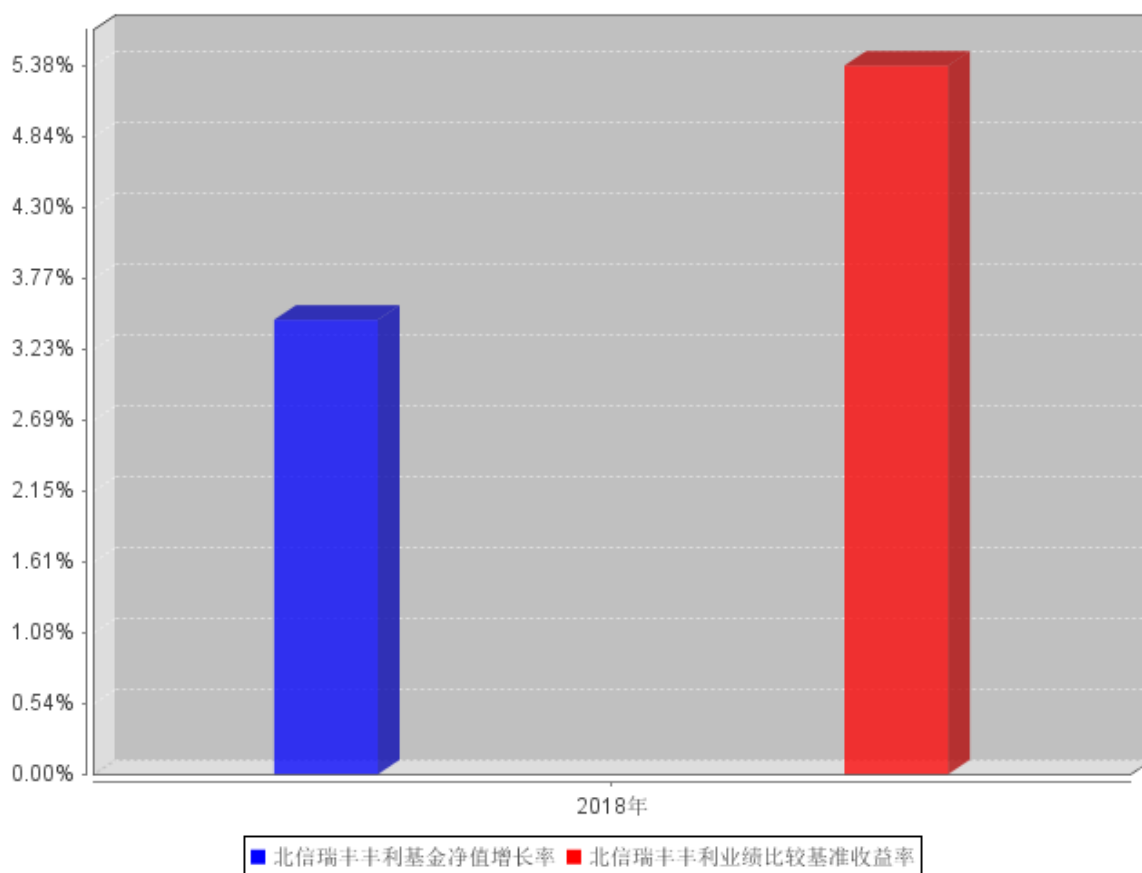
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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年。

### 3.2.3 自基金转型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

北信瑞丰丰利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



## 3.2 基金净值表现（转型前）

### 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	0.58%	0.04%	0.52%	0.01%	0.06%	0.03%
过去六个月	1.47%	0.07%	1.04%	0.01%	0.43%	0.06%
过去一年	2.58%	0.06%	2.11%	0.01%	0.47%	0.05%
自基金合同生效起至今	3.50%	0.08%	4.34%	0.01%	-0.84%	0.07%

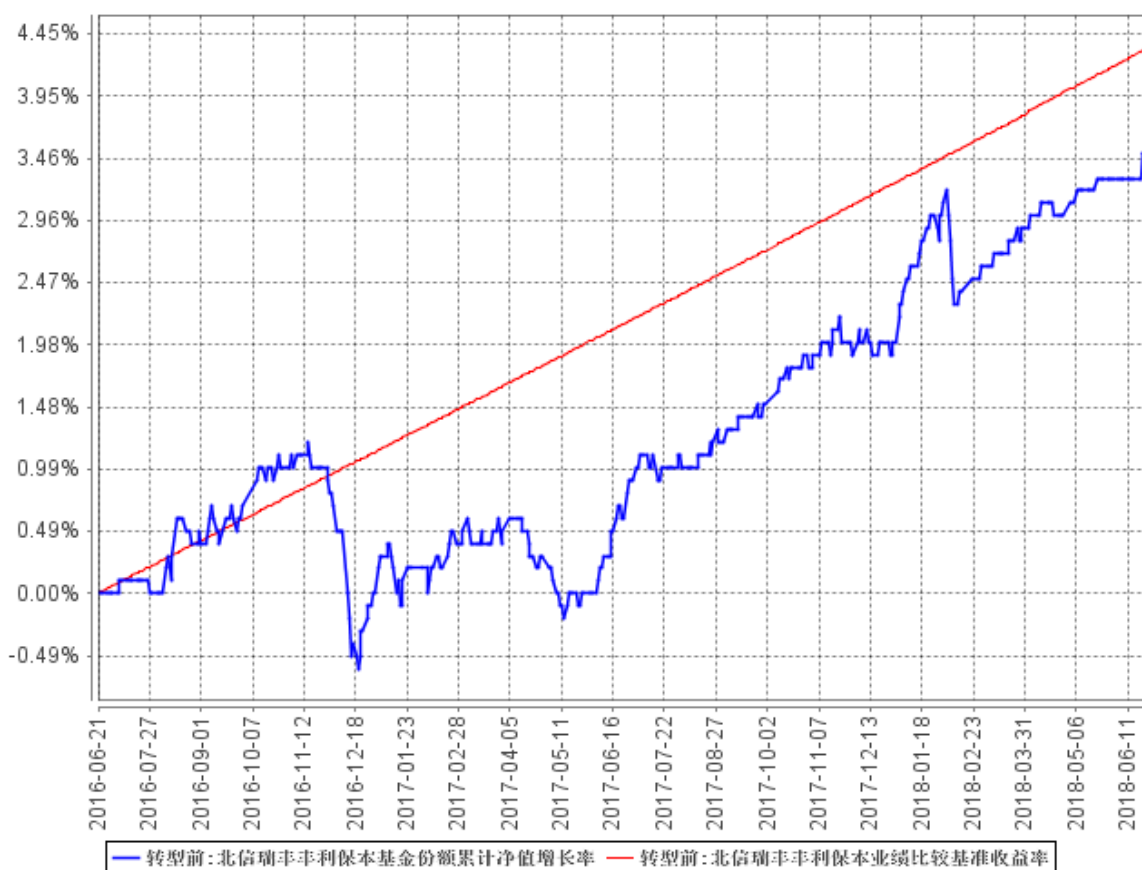
注：根据《北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，2018年6月21日为本基金的第一个保本周期到期日。

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

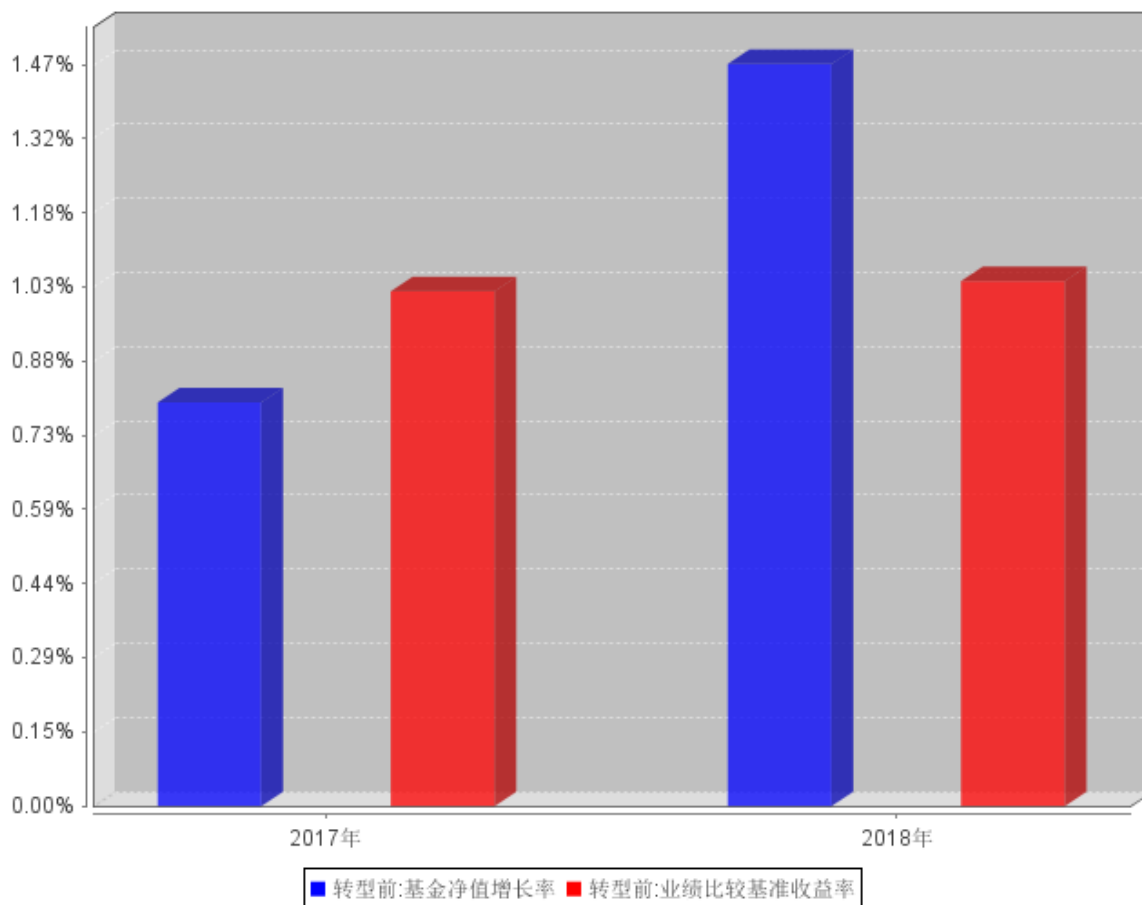
北信瑞丰丰利保本基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

### 3.2.3 过去五年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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

转型前:本基金自2016年6月21日起至2018年6月26日止期间未实施利润分配。

转型后:本基金自2018年6月27日起至2018年12月31日止期间未实施利润分配。

## §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，公司共有 16 只公募产品，保有 119 只专户产品，资产管理规模约 320 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（转型后）

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		
郑猛	基金经理	2017 年 6 月 15 日	-	8	郑猛先生，CFA、FRM 持证人，南开大学理学学士，北京大学硕士。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。
董懿洋	基金经理	2018 年 4 月 4 日	-	7	董懿洋女士，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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
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合规守信情况的说明

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

2018 年中国经济悲观预期升温，叠加中美贸易战不断发酵，作为避险资产的债券市场，表现亮眼，为投资者带来了较好的回报。在国家宏观调控背景下，房地产投资受到限制，基建由于地方政府债务管控难以发力，消费受制于房地产的挤占，进出口受到全球宏观经济形势及贸易壁垒主义影响，拉动经济的三驾马车对经济的带动作用均有所减弱。在中国经济增速缓慢下行的背景下，货币政策稳健中性、有所放松，年内四次降准以及中期借贷便利等操作为银行间市场提供了合理充裕的流动性。受益于以上利多因素，10 年国开中债估值到期收益率大幅下行 118BP。信用债券方面，上半年以民营企业为代表的信用债券发行主体风险事件频发，下半年央行完善普惠金融定向降准优惠政策、扩大 MLF 等工具担保范围、在宏观审慎评估（MPA）中增设小微企业、下调再贷款利率、创设信用风险缓释工具（CRMW）等一系列支持中小微企业发展，信用债券信用利差明显收敛。

2018 年 A 股市场在诸多利空因素的作用下持续下跌，三大股指年度跌幅分别达到了 24.59%、34.42%、28.65% 的跌幅，28 个申万一级行业指数亦无一收涨，行业平均跌幅超 30%。普通股票型基金指数全年下跌 24.4%。从 A 股上市公司来看，虽然整体上市公司家数逐月增加，但 A 股总市值却逐月缩水，其中十二月达到今年以来的最低点，市值全年蒸发 14.59 万亿元。个股方面来看，2018 年 A 股下跌股票数量超过 90%，上涨股票数量仅占 8.8%。

2018 年本基金积极布局利率债券，通过波段交易寻找投资机会，通过久期、仓位动态调整控制产品风险。维持小部分权益仓位，保障组合的流动性和收益率的稳定性，以期为投资者提供稳定的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至转型后报告期末，本基金份额净值为 1.0345 元，本报告期（2018 年 6 月 27 日至 2018 年 12 月 31 日）份额净值增值率为-0.05%，业绩比较基准增长率为 1.00%。截至转型前报告期末，本基金份额净值为 1.035 元，本报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 26 日）份额净值增值率为 1.47%，业绩比较基准增长率为 1.04%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为债券市场仍有长期配置价值。国内方面，中国经济仍处于缓慢下行阶段，2018 年掣肘因素仍未得到有效缓解；海外方面，美国消费数据有所疲软，美加息周期接近尾声。但也需关注，金融数据逐步转暖、央行货币政策全面放松、贸易争端告一段落可能给中国经济增长预期带来的影响。

进入 2019 年初，市场在政策回温及中美贸易摩擦缓和等利好情绪作用下，走出了一波上涨行情，涨幅及成交量均刷新三年来高点。展望全年，随着中美贸易战进入下半场，实质性伤害将会逐步落地，另一方面，经济下行的压力开始由预期转而落实到企业业绩上，这两方面顾虑或将成为股市行情的达摩克里斯之剑，市场中枢有望在反复的洗刷情绪之后逐步抬高。

#### 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）。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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7月12日（含）至12月31日期间资产净值低于伍仟万元，已经连续六十个工作日以上。本基金管理人已按规定向中国证监会进行了报告并提交了解决方案。

## §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）（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关损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人复核了本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 审计报告（转型后）

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 24011 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了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，以下简称“北信瑞丰丰利基金”)的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年 6 月 27 日(基金转型日)至 2018 年 12 月 31 日止期间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。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了北信瑞丰丰利基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 6 月 27 日(基金转型日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于北信瑞丰丰利基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>北信瑞丰丰利基金的基金管理人北信瑞丰基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括中信建投睿溢混合型证券投资基金 2018 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已经执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>北信瑞丰丰利基金的基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估北信瑞丰丰利基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非管理层计划清算北信瑞丰丰利基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督北信瑞丰丰利基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对北信瑞丰丰利基金持</p>

	<p>续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致北信瑞丰丰利基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张勇 郭蕙心
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2019 年 3 月 27 日

## §6 审计报告（转型前）

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 24012 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金(以下简称“北信瑞丰丰利保本基金”)的财务报表,包括 2018 年 6 月 26 日的资产负债表,2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 26 日(基金转型日前日)止期间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。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了北信瑞丰丰利保本基金 2018 年 6 月 26 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 26 日(基金转型日前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于北信瑞丰丰利保本基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>北信瑞丰丰利保本基金的基金管理管理层对其他信息负责。其他信息包括北信瑞丰丰利保本基金 2018 年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已经执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的	北信瑞丰丰利保本基金的基金管理人北信瑞丰基金管理有限公司



责任	<p>(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估北信瑞丰丰利保本基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非管理层计划清算北信瑞丰丰利保本基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督北信瑞丰丰利保本基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。</p>

	<p>同时，根据获取的审计证据，就可能对北信瑞丰丰利保本基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致北信瑞丰丰利保本基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张勇 郭蕙心
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2019 年 3 月 27 日

## §7 年度财务报表（转型后）

### 7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：北信瑞丰丰利混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	1,480,905.69
结算备付金		688,270.25
存出保证金		23,255.18
交易性金融资产	7.4.7.2	13,676,531.00
其中：股票投资		1,457,291.00
基金投资		-
债券投资		12,219,240.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	10,388,135.58
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	186,864.09
应收股利		-
应收申购款		5,259.37
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		26,449,221.16
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		107,467.09
应付管理人报酬		34,121.60
应付托管费		4,549.56
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	13,846.60
应交税费		-
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	277,000.00
负债合计		436,984.85
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	25,143,699.36
未分配利润	7.4.7.10	868,536.95
所有者权益合计		26,012,236.31
负债和所有者权益总计		26,449,221.16

注：1. 报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0345 元，基金份额总额

25,143,699.36 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 6 月 27 日(基金转型日)至 2018 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：北信瑞丰丰利混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 6 月 27 日(基金转型日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2018 年 6 月 27 日(基金转型日)至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		756,874.78
1. 利息收入		601,213.97
其中：存款利息收入	7.4.7.11	40,701.02
债券利息收入		377,638.52
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		182,874.43
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,936.59
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-493,598.58
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	495,966.37
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	568.80
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	152,362.34
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	361.88
<b>减：二、费用</b>		542,192.52
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	282,638.97

2. 托管费	7.4.10.2.2	37,685.21
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.19	32,924.43
5. 利息支出		10,326.45
其中：卖出回购金融资产支出		10,326.45
6. 税金及附加		218.50
7. 其他费用	7.4.7.20	178,398.96
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>214,682.26</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>214,682.26</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：北信瑞丰丰利混合型证券投资基金

本报告期：2018年6月27日(基金转型日)至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月27日(基金转型日)至2018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）	93,444,368.84	3,265,383.97	96,709,752.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	214,682.26	214,682.26
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）	-68,300,669.48	-2,611,529.28	-70,912,198.76
其中：1. 基金申购款	43,519.33	1,545.74	45,065.07
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-68,344,188.81	-2,613,075.02	-70,957,263.83
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）	25,143,699.36	868,536.95	26,012,236.31

注：报表附注为财务报表的组成部分。

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：

\_\_\_\_\_  
朱彦

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
朱彦

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
姜晴

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

北信瑞丰丰利混合型证券投资基金((以下简称“本基金”))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届满后转型而来。根据北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金的基金管理人北信瑞丰基金管理有限公司于 2018 年 6 月 15 日发布《关于北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型相关业务规则的公告》。北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金转型为非保本的混合型证券投资基金,基金名称相应变更为“北信瑞丰丰利混合型证券投资基金”,北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金份额转换为北信瑞丰丰利混合型证券投资基金份额。转型后,基金的托管人、登记机构、基金代码不变。自 2018 年 6 月 27 日起《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金合同》、《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金托管协议》生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。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《北信瑞丰丰利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、股指期货等权益类金融工具,债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)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。本基金持有股票资产占基金资产的 0%-40%;其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款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。权证投资占基金资产净值的比例不超过 3%;每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 20%+中债总财富指数收益率 $\times$ 80%。

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 2019 年 3 月 27 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》、《北信瑞丰丰利混合型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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2018 年 12 月 31 日,本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 6 月 27 日(基金转型日)至 2018 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 6 月 27 日(基金转型日)至 2018 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 2018 年 6 月 27 日(基金转型日)至 2018 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、债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期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、基金投资、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关



资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **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及由基金管理人缴纳的增值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，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值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。

#### 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、债券投资和资产支持证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[2017]13号《中国证监会关于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、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流

通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中债金融估值中心有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的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》、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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(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。

(5)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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	1,480,905.69
定期存款	-
其他存款	-
合计：	1,480,905.69

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,541,276.40	1,457,291.00	-83,985.40	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	2,107,350.00	2,109,240.00	1,890.00
	银行间市场	10,087,425.00	10,110,000.00	22,575.00
	合计	12,194,775.00	12,219,240.00	24,465.00

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	13,736,051.40	13,676,531.00	-59,520.40

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末本基金无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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 2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	10,388,135.58	-
合计	10,388,135.58	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
应收活期存款利息	263.25
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	340.67
应收债券利息	175,672.87
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	10,575.75
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	11.55
合计	186,864.09

#### 7.4.7.6 其他资产

本期末本基金无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	7,118.92

银行间市场应付交易费用	6,727.68
合计	13,846.60

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日
预提费用	277,000.00
应付赎回费	-
合计	277,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年6月27日(基金转型日)至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金转型日	93,444,368.84	93,444,368.84
本期申购	43,519.33	43,519.33
本期赎回(以“-”号填列)	-68,344,188.81	-68,344,188.81
本期末	25,143,699.36	25,143,699.36

注：赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金转型日	3,306,183.54	-40,799.57	3,265,383.97
本期利润	62,319.92	152,362.34	214,682.26
本期基金份额交易产生的变动数	-2,507,406.85	-104,122.43	-2,611,529.28
其中：基金申购款	1,455.51	90.23	1,545.74
基金赎回款	-2,508,862.36	-104,212.66	-2,613,075.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	861,096.61	7,440.34	868,536.95

#### 7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2018年6月27日(基金转型日)至2018年12月31日
活期存款利息收入	33,869.31
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	6,582.80
其他	248.91
合计	40,701.02

**7.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月27日(基金转型日)至2018年 12月31日
卖出股票成交总额	8,958,269.56
减：卖出股票成本总额	9,451,868.14
买卖股票差价收入	-493,598.58

**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月27日至2018年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	263,583,297.97
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	258,475,000.61
减：应收利息总额	4,612,330.99
买卖债券差价收入	495,966.37

**7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益**

期本基金无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

本期本基金无贵金属投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

本期本基金无衍生工具投资收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月27日(基金转型日)至2018年12月 31日
股票投资产生的股利收益	568.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	568.80

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年6月27日(基金转型日)至2018年
------	-------------------------------

	12月31日
1. 交易性金融资产	152,362.34
——股票投资	-83,985.40
——债券投资	236,347.74
——资产支持证券投资	-
——基金投资	
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	152,362.34

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月27日(基金转型日)至2018年 12月31日
基金赎回费收入	68.41
基金转换费收入	293.47
合计	361.88

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月27日(基金转型日)至2018年 12月31日
交易所市场交易费用	25,349.43
银行间市场交易费用	7,575.00
合计	32,924.43

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月27日(基金转型日)至2018年 12月31日
信息披露费	103,014.62
审计费用	52,752.77
账户维护费	18,000.00
银行费用	4,031.57
其他	600.00
合计	178,398.96



## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 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。

## 7.4.9 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”)	基金管理人、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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月27日(基金转型日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	282,638.97
其中：支付销售机构的客户维护费	143,479.52

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。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	
	2018年6月27日(基金转型日)至2018年12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	37,685.21	

注：支付基金托管人北京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 × 0.20% / 当年天数。

**7.4.10.2.3 销售服务费**

本基金无销售服务费。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本期本基金未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本期本基金基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**7.4.10.4.2 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**

本期末，其他关联方未持有本基金。

**7.4.10.5 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6月27日(基金转型日)至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
北京银行	1,480,905.69	33,869.31

注：本基金的活期银行存款由基金托管人北京银行保管，按约定利率计息。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本期本基金未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本期本基金无须作说明的其他关联交易事项。

## 7.4.11 利润分配情况

### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本期本基金未进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末本基金无暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过相对灵活的资产配置，追求实现基金资产的持续稳定增值。

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。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行北京银行，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。

本期末本基金未持有除国债、政策性金融债及央行票据以外的债券投资和资产支持证券投资。

#### 7.4.13.3 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 12 月 31 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。

#### 7.4.13.3.1 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期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上市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%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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 7.4.12。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。

#### 7.4.13.4 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。

### 7.4.13.4.1 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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2018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	1,480,905.69	-	-	-	1,480,905.69
结算备付金	688,270.25	-	-	-	688,270.25
存出保证金	23,255.18	-	-	-	23,255.18
交易性金融资产	2,109,240.00	10,110,000.00	-	-1,457,291.00	13,676,531.00
买入返售金融资产	10,388,135.58	-	-	-	10,388,135.58
应收利息	-	-	-	186,864.09	186,864.09
应收申购款	-	-	-	5,259.37	5,259.37
资产总计	14,689,806.70	10,110,000.00	-	-1,649,414.46	26,449,221.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	107,467.09	107,467.09
应付管理人报酬	-	-	-	34,121.60	34,121.60
应付托管费	-	-	-	4,549.56	4,549.56
应付交易费用	-	-	-	13,846.60	13,846.60
其他负债	-	-	-	277,000.00	277,000.00
负债总计	-	-	-	436,984.85	436,984.85
利率敏感度缺口	14,689,806.70	10,110,000.00	-	-1,212,429.61	26,012,236.31

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 12 月 31 日）
1. 市场利率下降 25 个基点	30,454.15
2. 市场利率上升 25 个基点	-30,190.67

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,457,291.00	5.60
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	1,457,291.00	5.60

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.60%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.14 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 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 1,457,291.00 元，属于第二层次的余额为 12,219,240.00 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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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 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) 其他

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 年度财务报表（转型前）

### 7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金

报告截止日：2018年6月26日(基金转型日前日)

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月26日(基金转 型日前日)	上年度末 2017年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	125,051,451.83	49,760.70
结算备付金		39,674.74	256,248.34
存出保证金		38,003.70	21,719.61
交易性金融资产	7.4.7.2	40,002,000.00	326,935,321.94
其中：股票投资		-	16,869,019.44
基金投资		-	-
债券投资		40,002,000.00	310,066,302.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	38,600,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,702,937.77	5,162,854.89
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		205,434,068.04	332,425,905.48
<b>负债和所有者权益</b>		<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>附注号</b>	<b>2018年6月26日(基金转</b>	<b>2017年12月31日</b>
		<b>型日前日)</b>	
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	20,000,000.00
应付证券清算款		38,600,000.00	-
应付赎回款		69,704,871.24	53,134.60
应付管理人报酬		186,266.55	322,794.84
应付托管费		31,044.41	53,799.15
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	15,719.72	8,190.40

应交税费		65,173.04	-
应付利息		-	19,595.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	121,240.27	300,402.06
负债合计		108,724,315.23	20,757,916.40
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	93,444,368.84	305,590,901.34
未分配利润	7.4.7.10	3,265,383.97	6,077,087.74
所有者权益合计		96,709,752.81	311,667,989.08
负债和所有者权益总计		205,434,068.04	332,425,905.48

注：1. 报告截止日 2018 年 6 月 26 日(基金转型日前日)，基金份额净值 1.035 元，基金份额总额 93,444,368.84 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 26 日(基金转型日前日)。

## 7.2 利润表

会计主体：北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 26 日(基金转型日前日)

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 26 日(基金 转型日前日)	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		6,974,330.90	15,232,331.99
1. 利息收入		7,819,513.82	15,185,818.95
其中：存款利息收入	7.4.7.11	20,964.31	40,763.66
债券利息收入		7,484,086.16	15,086,926.24
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		314,463.35	58,129.05
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,673,100.12	-2,978,759.47
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-96,029.21	-2,127,012.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-2,564,587.11	-1,174,996.09
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-12,483.80	323,249.59
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,714,761.28	2,822,752.40

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	113,155.92	202,520.11
<b>减：二、费用</b>		2,554,961.85	8,413,451.21
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,694,427.08	4,238,724.38
2. 托管费	7.4.10.2.2	282,404.51	706,454.07
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	71,332.02	132,378.28
5. 利息支出		341,365.47	3,025,023.79
其中：卖出回购金融资产支出		341,365.47	3,025,023.79
6. 税金及附加		19,070.30	-
7. 其他费用	7.4.7.20	146,362.47	310,870.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,419,369.05	6,818,880.78
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,419,369.05	6,818,880.78

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月26日(基金转型日前日)

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月26日(基金转型日前日)		
	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）	305,590,901.34	6,077,087.74	311,667,989.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,419,369.05	4,419,369.05
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）	-212,146,532.50	-7,231,072.82	-219,377,605.32
其中：1. 基金申购款	76,157.89	2,275.22	78,433.11
2. 基金赎回款	-212,222,690.39	-7,233,348.04	-219,456,038.43
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	93,444,368.84	3,265,383.97	96,709,752.81

项目	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
金净值)			
一、期初所有者权益（基金净值）	373,140,662.37	124,916.55	373,265,578.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,818,880.78	6,818,880.78
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）	-67,549,761.03	-866,709.59	-68,416,470.62
其中：1. 基金申购款	52,854.57	539.72	53,394.29
2. 基金赎回款	-67,602,615.60	-867,249.31	-68,469,864.91
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）	305,590,901.34	6,077,087.74	311,667,989.08

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>姜晴</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

北信瑞丰丰利保本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[2016]第 846 号《关于准予北信瑞丰丰利保本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《北信瑞丰丰利保本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 388,044,596.75 元,业经中喜会计师事务所(特殊普通合伙)中喜验字(2016)第 0262 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 6 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 388,102,582.12 份基金份额,其中认购资金利息折合 57,985.37 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”),担保人为北京中关村科技融资担保有限公司。

根据《北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为北信瑞丰丰利混合型证券投资基金相关业务规则的公告》,本基金于 2018 年 6 月 27 日转型为混合型证券投资基金,基金名称变更为“北信瑞丰丰利混合型证券投资基金”。《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金合同》、《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金托管协议》自 2018 年 6 月 27 日起生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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,本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行交易的债券、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)、货币市场工具、权证、股指期货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,但需符合中国证监会的相关规定。本基金的基金资产包括稳健资产和风险资产,稳健资产为国内依法发行交易的债券、货币市场工具等,其中债券包括国债、金融债、央行票据、地方政府债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、资产支持证券、债券回购等。风险资产为股票(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、股指期货等。本基金持有的债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于 60%,其中基金应保留不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例不高于 40%。本基金的业绩比较基准为两年期银行定期存款税后收益率。

本基金是保本型基金,保本周期是两年。本基金第一个保本周期到期日,如按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于其保本金额,则基金管理人应补足该差额(即保本赔付差额),并在保本周期到期日后二十个工作日内(含第二十个工作日),将该差额支付给基金份额持有人,保证人对此提供不可撤销的连带责任保证。本基金第一个保本周期由北京中关村科技融资担保有限公司作为保证人。

#### 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》、《北信瑞丰丰利保本混合型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。

根据《北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为北信瑞丰丰利混合型证券投资基金相关业务规则的公告》，本基金于 2018 年 6 月 27 日转型为北信瑞丰丰利混合型证券投资基金，存续期不定，因此本基金本期财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

### 7.4.3 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 26 日(基金转型日前日)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 26 日(基金转型日前日)的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 26 日(基金转型日前日)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。本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 26 日(基金转型日前日)。

#### 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、基金投资、债券投资、资产支持证券投资、贵金属投资和衍生工具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变动计入当期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、基金投资、债券投资、资产支持证券投资、贵金属投资和衍生工具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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 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、债券投资和资产支持证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[2017]13号《中国证监会关于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) 于 2017 年 12 月 28 日前，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。自 2017 年 12 月 28 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中债金融估值中心有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的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》、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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进

项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(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。

(5) 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 26 日(基金转型 日前日)	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	125,051,451.83	49,760.70
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计：	125,051,451.83	49,760.70

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月26日(基金转型日前日)		
	成本	公允价值	估值增值
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	20,266,722.74	20,010,000.00
	银行间市场	19,947,160.00	19,992,000.00
	合计	40,213,882.74	40,002,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	40,213,882.74	40,002,000.00	-211,882.74
项目	上年度末 2017年12月31日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	16,018,792.69	16,869,019.44	850,226.75
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	33,490,376.71	32,047,302.50
	银行间市场	279,352,796.56	278,019,000.00
	合计	312,843,173.27	310,066,302.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	328,861,965.96	326,935,321.94	-1,926,644.02

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末及上年度末，本基金无衍生金融资产或负债。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 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 2018年6月26日(基金转型日前日)	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	38,600,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	38,600,000.00	-
项目	上年度末	

	2017 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末及上年度末，本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 26 日(基金转型日前日)	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	7,214.85	653.44
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	10.74	126.83
应收债券利息	1,695,701.92	5,162,063.84
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	10.26	10.78
合计	1,702,937.77	5,162,854.89

#### 7.4.7.6 其他资产

本期末及上年度末，本基金无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 26 日(基金转型 日前日)	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	8,958.11	2,084.90
银行间市场应付交易费用	6,761.61	6,105.50
合计	15,719.72	8,190.40

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 26 日(基金转型 日前日)	上年度末 2017 年 12 月 31 日
----	-------------------------------------	--------------------------

预提费用	121,232.61	300,000.00
应付赎回费	7.66	402.06
合计	121,240.27	300,402.06

#### 7.4.7.9 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26日(基金转型日前日)	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	305,590,901.34	305,590,901.34
本期申购	76,157.89	76,157.89
本期赎回(以“-”号填列)	-212,222,690.39	-212,222,690.39
本期末	93,444,368.84	93,444,368.84

#### 7.4.7.10 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	7,488,189.12	-1,411,101.38	6,077,087.74
本期利润	2,704,607.77	1,714,761.28	4,419,369.05
本期基金份额交易产生的变动数	-6,886,613.35	-344,459.47	-7,231,072.82
其中：基金申购款	2,385.77	-110.55	2,275.22
基金赎回款	-6,888,999.12	-344,348.92	-7,233,348.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,306,183.54	-40,799.57	3,265,383.97

#### 7.4.7.11 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26日(基金转型日前日)	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
	活期存款利息收入	19,746.21
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	985.57	1,634.97
其他	232.53	709.50
合计	20,964.31	40,763.66

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年6月26日(基金转型)	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年12月31日

	日前日)	
卖出股票成交总额	29,943,974.48	51,953,724.03
减：卖出股票成本总额	30,040,003.69	54,080,737.00
买卖股票差价收入	-96,029.21	-2,127,012.97

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 6月26日(基金转型日前日)	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	612,367,457.19	864,287,446.38
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	600,593,408.33	851,641,714.06
减：应收利息总额	14,338,635.97	13,820,728.41
买卖债券差价收入	-2,564,587.11	-1,174,996.09

##### 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.15 衍生工具收益

本期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

##### 7.4.7.16 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26日(基金转型日前日)	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
股票投资产生的股利收益	-12,483.80	323,249.59
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	-12,483.80	323,249.59

##### 7.4.7.17 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26日(基金转型日前日)	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
------	---	--------------------------------------

1. 交易性金融资产	1,714,761.28	2,822,752.40
——股票投资	-850,226.75	2,432,019.60
——债券投资	2,564,988.03	390,732.80
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资		
——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	1,714,761.28	2,822,752.40

#### 7.4.7.18 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26日(基金转型日前日)	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
基金赎回费收入	113,155.92	202,469.91
基金转换费收入	-	50.20
合计	113,155.92	202,520.11

#### 7.4.7.19 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26日(基金转型日前日)	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
交易所市场交易费用	66,077.02	124,604.53
银行间市场交易费用	5,255.00	7,773.75
合计	71,332.02	132,378.28

#### 7.4.7.20 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26日(基金转型 日前日)	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年12月31日
信息披露费	96,985.38	210,000.00
审计费用	24,247.23	50,000.00
账户维护费	18,000.00	39,000.00
银行费用	6,529.86	10,670.69
其他	600.00	1,200.00
合计	146,362.47	310,870.69



## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 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。

## 7.4.9 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”）	基金管理人、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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期及上年度可比期间，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月26日(基金转型日前日)	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,694,427.08	4,238,724.38
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	898,549.11	2,244,493.08

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 1.20% 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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.20% / 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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月26日(基金转型日前日)		2017年1月1日至2017年12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	282,404.51		706,454.07	

注：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 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期及上年度可比期间，本基金未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期及上年度可比期间，本基金基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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

本期末及上年度末，其他关联方未持有本基金。

#### 7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月26日(基金转型日前日)		2017年1月1日至2017年12月31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	125,051,451.83	19,746.21	49,760.70	38,419.19

注：本基金的活期银行存款由基金托管人北京银行保管，按约定利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期及上年度可比期间，本基金未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本期及上年度可比期间，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本期本基金未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2018年6月26日(基金转型日前日)）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末本基金无暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为保本混合型基金，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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资和资产支持证券等。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。

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。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行北京银行，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。

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。

##### 7.4.13.2.1 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 2018年6月26日(基金转型日前 日)	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	29,799,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	159,813,000.00
合计	-	189,612,000.00

注：以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、同业存单及央行票据等。

**7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本期末及上年度末，本基金无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月26日(基金转型日 前日)	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	48,371,000.00
合计	-	48,371,000.00

**7.4.13.2.4 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 2018年6月26日(基金转型日 前日)	上年度末 2017年12月31日
AAA	-	31,885,690.00
AAA 以下	20,010,000.00	20,303,612.50
未评级	-	-
合计	20,010,000.00	52,189,302.50

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、同业存单及央行票据等。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本期末及上年度末，本基金无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本期末及上年度末，本基金无按长期信用评级列示的同业存单投资。

**7.4.13.3 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 26 日(基金转型日前日)，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 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期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上市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%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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 7.4.12。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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2018年6月26日 (基金转型日前日)	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	125,051,451.83	-	-	-	125,051,451.83
结算备付金	39,674.74	-	-	-	39,674.74
存出保证金	38,003.70	-	-	-	38,003.70
交易性金融资产	40,002,000.00	-	-	-	40,002,000.00
买入返售金融资产	38,600,000.00	-	-	-	38,600,000.00
应收利息	-	-	-	1,702,937.77	1,702,937.77
资产总计	203,731,130.27	-	-	1,702,937.77	205,434,068.04
负债					
应付证券清算款	-	-	-	38,600,000.00	38,600,000.00
应付赎回款	-	-	-	69,704,871.24	69,704,871.24
应付管理人报酬	-	-	-	186,266.55	186,266.55
应付托管费	-	-	-	31,044.41	31,044.41
应付交易费用	-	-	-	15,719.72	15,719.72
应交税费	-	-	-	65,173.04	65,173.04
其他负债	-	-	-	121,240.27	121,240.27
负债总计	-	-	-	108,724,315.23	108,724,315.23
利率敏感度缺口	203,731,130.27	-	-	-107,021,377.46	96,709,752.81

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
<b>资产</b>					
银行存款	49,760.70	-	-	-	49,760.70
结算备付金	256,248.34	-	-	-	256,248.34
存出保证金	21,719.61	-	-	-	21,719.61
交易性金融资产	288,013,000.00	22,053,302.50	-	16,869,019.44	326,935,321.94
应收利息	-	-	-	5,162,854.89	5,162,854.89
资产总计	288,340,728.65	22,053,302.50	-	22,031,874.33	332,425,905.48
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	20,000,000.00	-	-	-	20,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	53,134.60	53,134.60
应付管理人报酬	-	-	-	322,794.84	322,794.84
应付托管费	-	-	-	53,799.15	53,799.15
应付交易费用	-	-	-	8,190.40	8,190.40
应付利息	-	-	-	19,595.35	19,595.35
其他负债	-	-	-	300,402.06	300,402.06
负债总计	20,000,000.00	-	-	757,916.40	20,757,916.40
利率敏感度缺口	268,340,728.65	22,053,302.50	-	21,273,957.93	311,667,989.08

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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26日（基金转型日前日））	上年度末（2017年12月31日）
	1. 市场利率下降 25个基点	2,000.10	367,005.35
	2. 市场利率上升 25个基点	-2,000.10	-366,100.28

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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



交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 7.4.13.4.3.1 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26日(基金转型日前日)		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	-	-	16,869,019.44	5.41
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	-	-	16,869,019.44	5.41

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2018 年 6 月 26 日(基金转型日前日)，本基金未持有交易性权益类投资(2017 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.41%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.14 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 26 日(基金转型日前日)，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二层次的余额为 40,002,000.00 元，无属于第一或第三层次的余额

(2017 年 12 月 31 日：第一层次 18,722,321.94 元，第二层次 308,213,000.00 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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 26 日(基金转型日前日)，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 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) 其他

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（转型后）

### 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	1,457,291.00	5.51
	其中：股票	1,457,291.00	5.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,219,240.00	46.20
	其中：债券	12,219,240.00	46.20
	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	10,388,135.58	39.28
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	2,169,175.94	8.20
8	其他各项资产	215,378.64	0.81
9	合计	26,449,221.16	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。

## 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	2,875.00	0.01
B	采矿业	50,532.00	0.19
C	制造业	541,548.00	2.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,020.00	0.17
E	建筑业	55,272.00	0.21
F	批发和零售业	37,000.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	40,678.00	0.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	58,505.00	0.22
J	金融业	540,998.00	2.08
K	房地产业	64,637.00	0.25
L	租赁和商务服务业	14,191.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,900.00	0.01
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	2,135.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	1,457,291.00	5.60

注：以上行业分类以 2018 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港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 8.2.3 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	600016	民生银行	28,900	165,597.00	0.64
2	601318	中国平安	1,800	100,980.00	0.39
3	600519	贵州茅台	100	59,001.00	0.23
4	600837	海通证券	6,300	55,440.00	0.21
5	000333	美的集团	1,300	47,918.00	0.18
6	000002	万科A	2,000	47,640.00	0.18
7	600919	江苏银行	7,300	43,581.00	0.17
8	601328	交通银行	6,700	38,793.00	0.15
9	600887	伊利股份	1,600	36,608.00	0.14
10	601668	中国建筑	6,400	36,480.00	0.14
11	600104	上汽集团	1,200	32,004.00	0.12
12	600900	长江电力	1,900	30,172.00	0.12
13	601398	工商银行	5,100	26,979.00	0.10
14	002415	海康威视	1,000	25,760.00	0.10
15	601901	方正证券	4,700	24,957.00	0.10
16	601288	农业银行	6,300	22,680.00	0.09
17	000538	云南白药	300	22,188.00	0.09
18	000725	京东方A	8,200	21,566.00	0.08
19	600276	恒瑞医药	400	21,100.00	0.08
20	000858	五粮液	400	20,352.00	0.08
21	600115	东方航空	4,100	19,475.00	0.07
22	601099	太平洋	6,800	16,932.00	0.07
23	601600	中国铝业	4,500	15,975.00	0.06
24	300059	东方财富	1,300	15,730.00	0.06
25	600795	国电电力	5,800	14,848.00	0.06
26	601601	中国太保	500	14,215.00	0.05
27	601607	上海医药	800	13,600.00	0.05
28	601669	中国电建	2,700	13,122.00	0.05
29	601088	中国神华	700	12,572.00	0.05
30	601012	隆基股份	700	12,208.00	0.05
31	600028	中国石化	2,400	12,120.00	0.05
32	601888	中国国旅	200	12,040.00	0.05
33	601155	新城控股	500	11,845.00	0.05
34	000063	中兴通讯	600	11,754.00	0.05
35	300122	智飞生物	300	11,628.00	0.04
36	601198	东兴证券	1,200	11,472.00	0.04
37	600690	青岛海尔	800	11,080.00	0.04

38	601006	大秦铁路	1,300	10,699.00	0.04
39	601899	紫金矿业	3,200	10,688.00	0.04
40	601919	中远海控	2,600	10,504.00	0.04
41	600031	三一重工	1,200	10,008.00	0.04
42	601766	中国中车	1,100	9,922.00	0.04
43	601989	中国重工	2,300	9,775.00	0.04
44	600271	航天信息	400	9,156.00	0.04
45	600660	福耀玻璃	400	9,112.00	0.04
46	600019	宝钢股份	1,400	9,100.00	0.03
47	002466	天齐锂业	300	8,796.00	0.03
48	600585	海螺水泥	300	8,784.00	0.03
49	601336	新华保险	200	8,448.00	0.03
50	600309	万华化学	300	8,397.00	0.03
51	600050	中国联通	1,600	8,272.00	0.03
52	000568	泸州老窖	200	8,132.00	0.03
53	000963	华东医药	300	7,938.00	0.03
54	601857	中国石油	1,100	7,931.00	0.03
55	000423	东阿阿胶	200	7,910.00	0.03
56	600089	特变电工	1,100	7,469.00	0.03
57	002230	科大讯飞	300	7,392.00	0.03
58	600637	东方明珠	700	7,168.00	0.03
59	600352	浙江龙盛	700	6,755.00	0.03
60	002460	赣锋锂业	300	6,624.00	0.03
61	300136	信维通信	300	6,483.00	0.02
62	601628	中国人寿	300	6,117.00	0.02
63	300124	汇川技术	300	6,042.00	0.02
64	002081	金螳螂	700	5,670.00	0.02
65	600406	国电南瑞	300	5,559.00	0.02
66	000768	中航飞机	400	5,296.00	0.02
67	000402	金融街	800	5,152.00	0.02
68	002024	苏宁易购	500	4,925.00	0.02
69	600816	安信信托	1,100	4,807.00	0.02
70	600066	宇通客车	400	4,740.00	0.02
71	601933	永辉超市	600	4,722.00	0.02
72	600959	江苏有线	1,100	4,532.00	0.02
73	600588	用友网络	200	4,260.00	0.02
74	300070	碧水源	500	3,900.00	0.01
75	002050	三花智控	300	3,807.00	0.01
76	600038	中直股份	100	3,736.00	0.01

77	002456	欧菲科技	400	3,676.00	0.01
78	600153	建发股份	500	3,525.00	0.01
79	000792	盐湖股份	500	3,490.00	0.01
80	600516	方大炭素	200	3,342.00	0.01
81	300072	三聚环保	300	2,952.00	0.01
82	600583	海油工程	600	2,940.00	0.01
83	600100	同方股份	300	2,919.00	0.01
84	000876	新希望	400	2,912.00	0.01
85	600176	中国巨石	300	2,901.00	0.01
86	002714	牧原股份	100	2,875.00	0.01
87	600010	包钢股份	1,900	2,812.00	0.01
87	600804	鹏博士	400	2,812.00	0.01
88	601992	金隅集团	800	2,800.00	0.01
89	002065	东华软件	400	2,780.00	0.01
90	600188	兖州煤业	300	2,634.00	0.01
91	600398	海澜之家	300	2,544.00	0.01
92	600704	物产中大	500	2,290.00	0.01
93	300144	宋城演艺	100	2,135.00	0.01
94	600688	上海石化	400	1,996.00	0.01
95	000709	河钢股份	600	1,704.00	0.01
96	002572	索菲亚	100	1,675.00	0.01
97	000983	西山煤电	300	1,647.00	0.01
98	002385	大北农	500	1,600.00	0.01
99	000898	鞍钢股份	300	1,539.00	0.01
100	000786	北新建材	100	1,376.00	0.01
101	000959	首钢股份	300	1,119.00	0.00
102	601828	美凯龙	100	1,104.00	0.00
103	600415	小商品城	300	1,047.00	0.00
104	601718	际华集团	300	1,005.00	0.00

### 8.3 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.3.1 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	601318	中国平安	661,098.00	2.54
2	600519	贵州茅台	336,825.00	1.29
3	600016	民生银行	317,567.00	1.22

4	600036	招商银行	304,382.00	1.17
5	601288	农业银行	198,748.00	0.76
6	000651	格力电器	190,762.00	0.73
7	600887	伊利股份	181,230.00	0.70
8	601328	交通银行	174,675.00	0.67
9	601166	兴业银行	152,202.00	0.59
10	000858	五 粮 液	151,655.00	0.58
11	002415	海康威视	149,979.00	0.58
12	600276	恒瑞医药	147,525.00	0.57
13	600104	上汽集团	141,225.00	0.54
14	601668	中国建筑	133,817.00	0.51
15	000776	广发证券	129,170.00	0.50
16	000002	万 科A	126,944.00	0.49
17	600837	海通证券	124,277.00	0.48
18	601398	工商银行	124,275.00	0.48
19	600900	长江电力	121,248.00	0.47
20	000333	美的集团	116,032.00	0.45

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。

### 8.3.2 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	601318	中国平安	510,804.00	1.96
2	600036	招商银行	297,121.00	1.14
3	600519	贵州茅台	262,194.00	1.01
4	000651	格力电器	181,769.00	0.70
5	601288	农业银行	170,979.00	0.66
6	601166	兴业银行	148,573.00	0.57
7	600887	伊利股份	140,520.00	0.54
8	600016	民生银行	138,439.00	0.53
9	601328	交通银行	133,322.00	0.51
10	000776	广发证券	123,015.00	0.47
11	000858	五 粮 液	119,658.00	0.46
12	600276	恒瑞医药	111,389.00	0.43
13	002415	海康威视	107,612.00	0.41
14	600030	中信证券	107,176.00	0.41

15	600104	上汽集团	102,476.00	0.39
16	601398	工商银行	93,193.00	0.36
17	600000	浦发银行	92,933.00	0.36
18	601668	中国建筑	92,592.00	0.36
19	600900	长江电力	91,638.00	0.35
20	601601	中国太保	78,405.00	0.30

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。

### 8.3.3 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	25,014,355.54
卖出股票收入（成交）总额	38,902,244.04

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。

### 8.4 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	12,219,240.00	46.97
	其中：政策性金融债	12,219,240.00	46.97
4	企业债券	-	-
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	12,219,240.00	46.97

### 8.5 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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	180212	18 国开 12	100,000	10,110,000.00	38.87
2	018005	国开 1701	21,000	2,109,240.00	8.11

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。



**8.7 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**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.8 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**

本基金本报告期末未持有权证。

**8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

- (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。

**8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

**8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

**8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

- (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。

**8.10.3 本期国债期货投资评价**

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关评价。

**8.11 投资组合报告附注**

**8.11.1 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。**

**8.11.2 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。**

**8.11.3 其他资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	23,255.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	186,864.09
5	应收申购款	5,259.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	215,378.64

#### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金截至 2018 年 12 月 31 日止未持有流通受限的股票。

#### 8.11.6 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。

## §8 投资组合报告（转型前）

### 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	-	-
	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

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。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 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	601318	中国平安	2,457,961.00	0.79
2	600519	贵州茅台	1,212,383.00	0.39
3	601328	交通银行	1,014,946.00	0.33

4	601166	兴业银行	627,960.00	0.20
5	600036	招商银行	537,789.00	0.17
6	601601	中国太保	517,448.00	0.17
7	600016	民生银行	486,653.00	0.16
8	600019	宝钢股份	437,919.00	0.14
9	601988	中国银行	430,701.00	0.14
10	601989	中国重工	358,864.00	0.12
11	601336	新华保险	346,841.00	0.11
12	601006	大秦铁路	331,203.00	0.11
13	600000	浦发银行	327,604.00	0.11
14	600919	江苏银行	309,015.00	0.10
15	600887	伊利股份	305,974.00	0.10
16	601668	中国建筑	295,923.00	0.09
17	601288	农业银行	289,159.00	0.09
18	601398	工商银行	288,269.00	0.09
19	600048	保利地产	286,883.00	0.09
20	600104	上汽集团	276,454.00	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。

#### 8.4.2 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	601318	中国平安	3,805,541.00	1.22
2	600519	贵州茅台	1,966,201.00	0.63
3	600036	招商银行	1,769,026.00	0.57
4	601166	兴业银行	1,342,123.00	0.43
5	600016	民生银行	1,258,400.00	0.40
6	600887	伊利股份	1,200,925.00	0.39
7	601328	交通银行	1,002,644.00	0.32
8	600000	浦发银行	976,329.00	0.31
9	600837	海通证券	890,968.00	0.29
10	600030	中信证券	884,120.00	0.28
11	601288	农业银行	878,796.00	0.28
12	601668	中国建筑	843,600.00	0.27
13	601601	中国太保	802,009.00	0.26
14	601398	工商银行	772,850.00	0.25

15	600104	上汽集团	728,382.00	0.23
16	601628	中国人寿	707,128.00	0.23
17	601766	中国中车	611,024.00	0.20
18	600048	保利地产	574,485.00	0.18
19	601211	国泰君安	449,555.00	0.14
20	600518	康美药业	435,140.00	0.14

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	14,021,211.00
卖出股票收入（成交）总额	29,943,974.48

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

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	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

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	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

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

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**

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**

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**

(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**

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**

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**

(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**

本基金本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。**

**8.12.2 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。**

**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	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

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

#### 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息（转型后）

### 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
392	64,142.09	-	-	25,143,699.36	100.00%

### 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	48,485.50	0.19%

### 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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10



## §9 基金份额持有人信息（转型前）

### 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
837	111,642.02	-	-	93,444,368.84	100.00%

### 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	48,485.50	0.05%

### 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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

基金转型日基金份额总额	93,444,368.84
基金转型日起至报告期期末基金总申购份额	43,519.33
减:基金转型日起至报告期期末基金总赎回份额	68,344,188.81
基金转型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	25,143,699.36

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

**§ 10 开放式基金份额变动(转型前)**

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	388,102,582.12
本报告期期初基金份额总额	305,590,901.34
本报告期期间基金总申购份额	76,157.89
减:本报告期期间基金总赎回份额	212,222,690.39
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	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。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

### 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：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。

### 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

本基金由原北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金保本周期到期转型而来。

原北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金的投资策略为：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。

北信瑞丰丰利混合型证券投资基金的投资策略为：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。

### 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 77,000.00 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（转型后）

#### 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	
国联证券	3	19,951,414.10	100.00%	14,590.02	100.00%	新增
东吴证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
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
国联证券	28,950,749.85	100.00%	846,000,000.00	100.00%	-	-
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 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

### 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	
国联证券	2	32,824,345.48	74.66%	24,004.33	74.66%	-
东吴证券	1	11,140,840.00	25.34%	8,147.22	25.34%	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

### 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
国联证券	30,541,480.61	40.67%	99,600,000.00	98.03%	-	-
东吴证券	2,314,299.59	3.08%	2,000,000.00	1.97%	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	42,243,035.62	56.25%	-	-	-	-

**11.9 其他重大事件（转型后）**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金开放日常申购(赎回、转换、定期定额投资)业务公告	中国证券报、证券时报	2018年6月27日
2	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金 2018 年第 2 季度报告	中国证券报、证券时报和公司网站	2018年7月19日
3	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与奕丰金融费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报和公司网站	2018年7月25日
4	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国联证券费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报和公司网站	2018年8月1日
5	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下基金新增西藏东方财富证券股份有限公司为基金代销机构和参与费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报和公司网站	2018年8月24日
6	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下基金新增上海基煜基金销售有限公司为基金代销机构和参与费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报和公司网站	2018年8月28日
7	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金 2018 年半年度报告	公司网站	2018年8月29日
8	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金 2018 年半年度报告摘要	中国证券报、证券时报和公司网站	2018年8月29日
9	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下基金新增光大证券股份有限公司为基金代销机构的公告	中国证券报、证券时报和公司网站	2018年8月30日

10	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下基金开通东海证券股份有限公司定投业务并参与其定投费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报和公司网站	2018 年 9 月 7 日
11	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下基金开通东海证券股份有限公司定投业务并参与其定投费率优惠活动的公告 (2018/09/10)	中国证券报、证券时报和公司网站	2018 年 9 月 10 日
12	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下基金新增上海云湾基金销售有限公司为基金代销机构并开通定投业务和转换业务及参与费率优惠的公告	中国证券报、证券时报和公司网站	2018 年 9 月 14 日
13	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下基金新增中山证券有限责任公司为基金代销机构和参与费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报和公司网站	2018 年 9 月 26 日
14	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下基金新增金惠家保险代理有限公司为基金代销机构的公告	中国证券报、证券时报和公司网站	2018 年 10 月 10 日
15	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	中国证券报、证券时报和公司网站	2018 年 10 月 25 日
16	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下基金新增北京君德汇富基金销售有限公司为基金代销机构和参与费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报和公司网站	2018 年 12 月 3 日



**11.9 其他重大事件（转型前）**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	北信瑞丰丰利保本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	北信瑞丰丰利保本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 1 月 25 日
3	北信瑞丰丰利保本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 1 月 25 日
4	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
5	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
6	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
7	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
8	北信瑞丰丰利保本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
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	2018 年 4 月 10 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 4 月 19 日
11	北信瑞丰丰利保本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
12	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
13	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
14	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有限公司为基金代销机构和参与费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报	2018 年 6 月 6 日
15	北信瑞丰基金管理有限公司关于北信瑞丰丰利保本混合型证	中国证券报、证券时报	2018 年 6 月 6 日

	券投资基金保本周期到期第一次提示性公告		
16	北信瑞丰基金管理有限公司关于北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金保本周期到期第二次提示性公告	中国证券报、证券时报	2018年6月8日
17	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金合同	中国证券报、证券时报	2018年6月15日
18	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金托管协议	中国证券报、证券时报	2018年6月15日
19	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金合同摘要	中国证券报、证券时报	2018年6月15日
20	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金招募说明书	中国证券报、证券时报	2018年6月15日
21	北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型相关业务规则的公告	中国证券报、证券时报	2018年6月15日
22	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	中国证券报、证券时报	2018年6月15日

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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（转型后）

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。

### 12.1 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（转型前）

本基金本报告期内，不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 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。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 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。

### 13.3 查阅方式

网站：<http://www.bxrfund.com>

北信瑞丰基金管理有限公司

2019 年 3 月 28 日