

北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资 基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：北信瑞丰基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35

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	36
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40
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	40
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	40
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	40
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	40
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12	投资组合报告附注	40
§ 8	基金份额持有人信息	41
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	42
§ 9	开放式基金份额变动	42
§ 10	重大事件揭示	42
10.1	基金份额持有人大会决议	42
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	42
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4	基金投资策略的改变	43
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8	其他重大事件	45
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 12	备查文件目录	46
12.1	备查文件目录	46
12.2	存放地点	47
12.3	查阅方式	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	北信瑞丰健康生活主题灵活配置
基金主代码	001056
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 3 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	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	109,288,850.20 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健康生活发展趋势的上市公司，从中挑选三个方向即健康饮食类的农林牧渔、餐饮行业，文明生活类的体育、传媒、公共园林行业，健康辅助类的医疗环保行业，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。
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，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票基金，高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		北信瑞丰基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	夏彬	郭明
	联系电话	010-68619341	(010) 66105799
	电子邮箱	service@bxrfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-061-7297	95588
传真		010-68619300	(010) 66105798
注册地址		北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市丰台区开阳路 8 号京印国	北京市西城区复兴门内大街 55

	际中心 A 栋 4 层	号
邮政编码	100048	100140
法定代表人	李永东	廖林

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bxrfund.com
基金中期报告备置地点	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	北京市丰台区开阳路 8 号京印国际中心 A 栋 4 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（2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-24,398,813.52
本期利润	-45,081,699.54
加权平均基金份额本期利润	-0.4033
本期加权平均净值利润率	-41.52%
本期基金份额净值增长率	-32.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-21,442,719.82
期末可供分配基金份额利润	-0.1962
期末基金资产净值	87,846,130.38
期末基金份额净值	0.804
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	-19.60%

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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

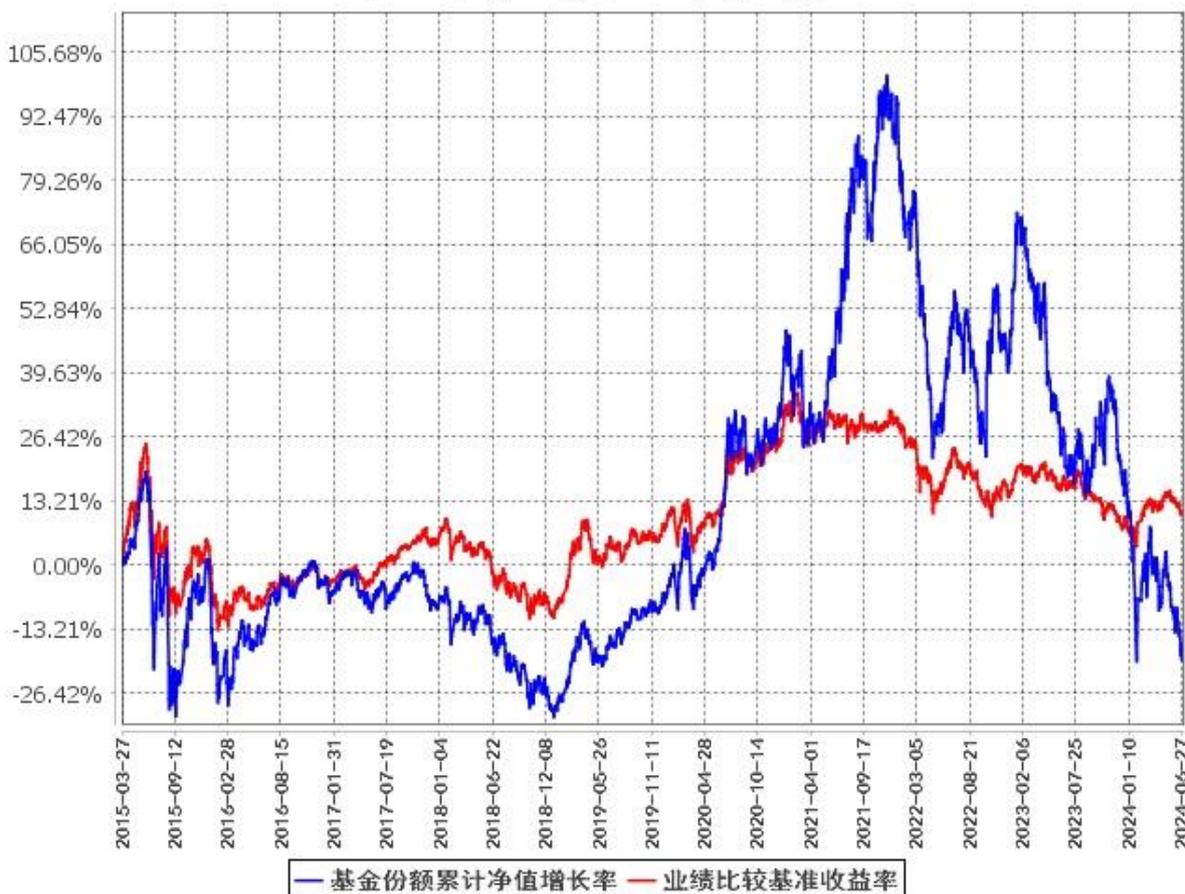
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-11.75%	1.91%	-2.21%	0.34%	-9.54%	1.57%
过去三个月	-18.95%	1.97%	-1.24%	0.49%	-17.71%	1.48%
过去六个月	-32.66%	2.36%	0.61%	0.61%	-33.27%	1.75%
过去一年	-32.89%	2.10%	-4.94%	0.55%	-27.95%	1.55%
过去三年	-47.42%	1.91%	-15.34%	0.62%	-32.08%	1.29%
自基金合同生效起至今	-19.60%	1.70%	10.58%	0.83%	-30.18%	0.87%

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综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015年3月27日至2024年6月30日)



注：报告期内基金的各项投资比例符合基金合同的有关规定。

§ 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。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。

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	说明

		任职日期	离任日期	年限	
庞文杰	本基金基金经理	2022 年 3 月 28 日	-	11	庞文杰先生，上海交通大学硕士研究生。历任清华大学生命科学学院院长助理，北京合正致淳投资管理有限公司研究部研究员，泰达宏利基金管理有限公司研究部助理研究员，工银瑞信基金管理有限公司研究部医药研究员。2019 年 1 月加入北信瑞丰基金管理有限公司，现任公司权益投资部基金经理。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；

2、证券从业的含义遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《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及各项实施准则规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，不存在损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律规定，严格执行《北信瑞丰基金管理有限公司公平交易管理制度》、《北信瑞丰基金管理有限公司异常交易管理办法》等公平交易制度要求，通过系统和人工等方式在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。公司要求投资人员应公平对待其管理的不同投资组

合，原则上应该做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差。在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、综合平衡、比例实施、保证各基金间的利益公平”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，合理分配投资指令。公司通过系统严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。在事后监控环节，本基金管理人对公平交易制度的遵守、相关业务流程的执行情况以及不同投资组合的同向交易价差和反向交易价差进行检查和分析，对发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。本报告期内本基金管理人严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

2024 年上半年中国经济总体呈回升态势，上半年 GDP 增长 5%，尽管单二季度 GDP 增速边际有所放缓，但上半年整体符合年初设定的 5% 左右的增长目标。欧美经济在今年上半年逐步走弱，包括欧央行在内的多个主要经济体央行在今年上半年开始首次降息。美联储降息预期在今年上半年出现剧烈波动，一方面美国经济数据逐步走弱，且就业、消费数据出现隐忧；另一方面通胀呈现较强粘性，使得美联储货币政策陷入两难，也加剧了市场预期的波动。受此影响，2024 年上半年各大指数均出现大幅波动，其中上证指数-0.25%，沪深 300 指数+0.89%，创业板指-10.99%，科创 50 指数-16.42%。

本基金本报告期内聚焦医药行业投资机会，重点布局于创新药、创新医疗器械以及研发外包产业链。

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 0.804 元，本报告期基金份额净值增长率为-32.66%；同期业绩比较基准收益率为 0.61%。

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 2024 年下半年，国内财政开始发力，今年上半年政府债发行进度慢于往年，但 5、6 月份

以来，政府债发行明显加快，三季度发债节奏有望继续提速，为下半年国内经济稳增长奠定良好基础。目前，A股市场已经具备较高性价比，未来随着稳增长政策持续发力，市场风险偏好将会持续提升。美联储预计今年开始降息，年内有望降息 1-2 次，全球流动性紧缩的态势有望得到逆转。受经济复苏和海外流动性边际改善影响，A股的盈利端和估值端均将持续修复。

全球生物医药领域迎来新一轮创新浪潮，2025 年到 2030 年，全球药企将面临新一轮专利悬崖高峰，增加研发投入，实现新的增长曲线将会成为全球各大药企的必然选择；海外的生物医药投融资已经出现拐点，今年上半年全球生物医药行业投融资金额同比大幅增长；国内对创新药健康发展的鼓励政策陆续推出，从研发创新、市场准入、保险支付、投融资等方面给与全链条的支持，投融资水平也已见底企稳，未来有望回升。全球生物医药投融资水平的回升，研发开支增加，我国的 CXO 产业将会明显受益。

今年上半年，美国国会的生物安全法案对 CXO 板块带来一些扰动，但这些议案都还在早期阶段，距离立法还有很远的距离，近几届国会涉华议案通过率持续降低，生物医药领域的涉华议案通过的可能性更低；众议院版本的生物安全法案未能纳入 2025 年国防授权法案中，未来独立通过立法的可能性十分渺茫。伴随着此事件影响的逐步消退，市场的关注点有望重新回到产业创新周期上来。

本基金将长期关注医药领域中的科技创新机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国基金业协会提供的相关估值指引等相关规定以及基金合同的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同完成，本基金管理人完成账务处理、基金份额净值的计算，与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术，建立了投资决策委员会，下设估值小组。估值小组成员由具备丰富的证券研究、合规风控、估值经验的公司相关领导、基金经理、研究人员、交易人员、监察稽核人员及基金运营人员组成。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。

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

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——北信瑞丰基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对北信瑞丰基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	6,631,500.71	9,306,777.71
结算备付金		77,443.80	238,906.04

存出保证金		17,491.72	20,602.36
交易性金融资产	6.4.7.2	81,922,682.25	129,278,988.98
其中：股票投资		81,922,682.25	129,278,988.98
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		68,316.37	448,235.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		88,717,434.85	139,293,510.90
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		655,451.77	1,108,996.14
应付管理人报酬		95,029.09	142,858.40
应付托管费		15,838.14	23,809.72
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	104,985.47	231,829.43
负债合计		871,304.47	1,507,493.69
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	109,288,850.20	115,389,169.91
未分配利润	6.4.7.8	-21,442,719.82	22,396,847.30
净资产合计		87,846,130.38	137,786,017.21
负债和净资产总计		88,717,434.85	139,293,510.90

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.804 元，基金份额总额 109,288,850.20 份。

6.2 利润表

会计主体：北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-44,252,772.23	-27,198,695.94
1. 利息收入		14,485.41	18,923.06
其中：存款利息收入	6.4.7.9	14,485.41	18,923.06
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）		-23,839,419.60	13,150,626.28
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-24,495,809.73	12,373,650.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	656,390.13	776,975.76
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-20,682,886.02	-40,713,698.39
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	255,047.98	345,453.11
减：二、营业总支出		828,927.31	1,208,640.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	645,319.34	959,108.64
2. 托管费	6.4.10.2.2	107,553.19	159,851.41
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	76,054.78	89,680.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-45,081,699.54	-28,407,336.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-45,081,699.54	-28,407,336.82
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-45,081,699.54	-28,407,336.82

6.3 净资产变动表

会计主体：北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	115,389,169.91	-	22,396,847.30	137,786,017.21
二、本期期初净资产	115,389,169.91	-	22,396,847.30	137,786,017.21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,100,319.71	-	-43,839,567.12	-49,939,886.83
（一）、综合收益总额	-	-	-45,081,699.54	-45,081,699.54
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-6,100,319.71	-	1,242,132.42	-4,858,187.29
其中：1. 基金申购款	56,332,694.00	-	-1,287,626.43	55,045,067.57
2. 基金赎回款	-62,433,013.71	-	2,529,758.85	-59,903,254.86

(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	109,288,850.20	-	-21,442,719.82	87,846,130.38
项目	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	74,691,244.72	-	35,401,488.71	110,092,733.43
二、本期期初净资产	74,691,244.72	-	35,401,488.71	110,092,733.43
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	31,448,058.07	-	-14,372,926.94	17,075,131.13
(一)、综合收益总额	-	-	-28,407,336.82	-28,407,336.82
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	31,448,058.07	-	14,034,409.88	45,482,467.95
其中：1. 基金申购款	71,395,017.53	-	35,942,842.04	107,337,859.57
2. 基金赎回款	-39,946,959.46	-	-21,908,432.16	-61,855,391.62
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	106,139,302.79	-	21,028,561.77	127,167,864.56

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：

刘 晓 玲	李 惠 军	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

北信瑞丰健康生活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 100 号《关于准予北信瑞丰健康生活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《北信瑞丰健康生活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 2,327,331,239.57 元,业经中喜会计师事务所(特殊普通合伙)中喜验字(2015)第 0114 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 3 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,327,526,690.74 份基金份额,其中认购资金利息折合 195,451.17 份基金份额。本基金的基金管理人为北信瑞丰基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《北信瑞丰健康生活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。本基金的股票投资占基金资产的比例为 0%-95%,其中 80%以上的非现金基金资产投资于健康生活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 \times 60%+中证综合债券指数收益率 \times 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颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第

3 号《年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金基于上述编制基础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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产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、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局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号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《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号文《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号文《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号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3、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。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5、基金卖出股票缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7、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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	6,631,500.71
等于：本金	6,630,882.76
加：应计利息	617.95
减：坏账准备	-
定期存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	6,631,500.71

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	144,070,914.22	-	81,922,682.25	- 62,148,231.97
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	144,070,914.22	-	81,922,682.25	- 62,148,231.97

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末本基金无衍生金融资产或负债。

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

本期末本基金无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末本基金无从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本期末本基金无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	753.29
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	37,101.48
其中：交易所市场	37,101.48
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	67,130.70
合计	104,985.47

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	115,389,169.91	115,389,169.91
本期申购	56,332,694.00	56,332,694.00
本期赎回（以“-”号填列）	-62,433,013.71	-62,433,013.71
本期末	109,288,850.20	109,288,850.20

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 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	84,184,823.55	-61,787,976.25	22,396,847.30
本期期初	84,184,823.55	-61,787,976.25	22,396,847.30
本期利润	-24,398,813.52	-20,682,886.02	-45,081,699.54
本期基金份额交易产生的变动数	-4,515,325.78	5,757,458.20	1,242,132.42
其中：基金申购款	32,550,411.56	-33,838,037.99	-1,287,626.43

基金赎回款	-37,065,737.34	39,595,496.19	2,529,758.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,270,684.25	-76,713,404.07	-21,442,719.82

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
活期存款利息收入	13,103.84
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	1,204.92
其他	176.65
合计	14,485.41

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
卖出股票成交总额	104,511,276.64
减：卖出股票成本总额	128,772,354.18
减：交易费用	234,732.19
买卖股票差价收入	-24,495,809.73

6.4.7.11 债券投资收益

本期本基金无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本期本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本期本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本期本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	656,390.13
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	656,390.13

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-20,682,886.02
——股票投资	-20,682,886.02
——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	-20,682,886.02

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
基金赎回费收入	254,277.44
基金转换费收入	770.54
合计	255,047.98

6.4.7.18 信用减值损失

本期本基金无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
审计费用	7,458.36
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	7,500.00
银行费用	1,424.08
合计	76,054.78

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
北信瑞丰基金管理有限公司（“北信瑞丰基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构

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

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。

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 2024年1月1日 至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日 至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	645,319.34	959,108.64
其中：应支付销售机构的客户维护费	291,627.62	439,832.47
应支付基金管理人的净管理费	353,691.72	519,276.17

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 × 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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日 至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	107,553.19	159,851.41

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末及上年度末，其他关联方未持有本基金。

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	6,631,500.71	13,103.84	8,871,748.68	16,946.69

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

本期本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月以上	新股流通受限	8.90	16.75	438	3,898.20	7,336.50	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月以上	新股流通受限	15.69	18.77	262	4,110.78	4,917.74	-

688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月以上	新股流通受限	22.66	15.87	213	4,826.58	3,380.31	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月以上	新股流通受限	16.20	15.95	208	3,369.60	3,317.60	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月以上	新股流通受限	21.28	29.48	65	1,383.20	1,916.20	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月以上	新股流通受限	15.38	15.23	110	1,691.80	1,675.30	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月以上	新股流通受限	72.46	68.02	24	1,739.04	1,632.48	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月以上	新股流通受限	16.98	13.48	118	2,003.64	1,590.64	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月以上	新股流通受限	38.18	38.88	40	1,527.20	1,555.20	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月以上	新股流通受限	29.02	25.34	59	1,712.18	1,495.06	-
001387	雪祺电气	-	-	锁定期送/转股	-	15.23	33	-	502.59	与正股同时流通

注：

1、根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的非公开发行股份，自发行结束之日起6个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 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。

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

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

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。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。本基金通过相对灵活的资产配置，重点投资于可以代表未来健康生活发展趋势的上市公司，从中挑选三个方向即健康饮食类的农林牧渔、餐饮行业，文明生活类的体育、传媒、公共园林行业，健康辅助类的医疗环保行业，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人中国工商银行，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 2024 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)。

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 2024 年 6 月 30 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(净资产)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》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%（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 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。

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未来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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和交易性金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,631,500.71	-	-	-	6,631,500.71
结算备付金	77,443.80	-	-	-	77,443.80
存出保证金	17,491.72	-	-	-	17,491.72
交易性金融资产	-	-	-	81,922,682.25	81,922,682.25
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	68,316.37	68,316.37
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,726,436.23	-	-	81,990,998.62	88,717,434.85
负债					
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	655,451.77	655,451.77
应付管理人报酬	-	-	-	95,029.09	95,029.09
应付托管费	-	-	-	15,838.14	15,838.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	104,985.47	104,985.47
负债总计	-	-	-	871,304.47	871,304.47
利率敏感度缺口	6,726,436.23	-	-	81,119,694.15	87,846,130.38
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	9,306,777.71	-	-	-	9,306,777.71
结算备付金	238,906.04	-	-	-	238,906.04
存出保证金	20,602.36	-	-	-	20,602.36
交易性金融资产	-	-	-	129,278,988.98	129,278,988.98

衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	448,235.81	448,235.81
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	9,566,286.11	-	129,727,224.79	139,293,510.90
负债	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	1,108,996.14	1,108,996.14
应付管理人报酬	-	-	142,858.40	142,858.40
应付托管费	-	-	23,809.72	23,809.72
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	231,829.43	231,829.43
负债总计	-	-	1,507,493.69	1,507,493.69
利率敏感度缺口	9,566,286.11	-	128,219,731.10	137,786,017.21

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2023 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%，其中 80%以上的非现金基金资产投资于健康生活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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	81,922,682.25	93.26	129,278,988.98	93.83
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	81,922,682.25	93.26	129,278,988.98	93.83

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(2024 年 6 月 30 日)	上年度末(2023 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	6,895,501.91	8,540,914.26
2. 业绩比较基准	-6,895,501.91	-8,540,914.26	

	(附注 6.4.1) 下降 5%		
--	------------------	--	--

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	81,893,362.63	129,012,501.86
第二层次	-	-
第三层次	29,319.62	266,487.12
合计	81,922,682.25	129,278,988.98

6.4.14.2.2 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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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以摊余成本计量的金融负债，其账面

价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	81,922,682.25	92.34
	其中：股票	81,922,682.25	92.34
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	6,708,944.51	7.56
8	其他各项资产	85,808.09	0.10
9	合计	88,717,434.85	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 报告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

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	-	-
C	制造业	23,103,719.57	26.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,504.80	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	2,476.04	0.00

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,717.10	0.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	58,726,454.95	66.85
N	水利、环境和公共设施管理业	32,809.79	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	81,922,682.25	93.26

7.2.2 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按行业分类的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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603259	药明康德	100,000	3,919,000.00	4.46
2	300759	康龙化成	210,000	3,901,800.00	4.44
3	301080	百普赛斯	110,000	3,850,000.00	4.38
4	603127	昭衍新药	290,000	3,848,300.00	4.38
5	301096	百诚医药	66,000	3,833,280.00	4.36
6	688356	键凯科技	63,406	3,727,004.68	4.24
7	688114	华大智造	78,000	3,697,980.00	4.21
8	300347	泰格医药	75,000	3,645,000.00	4.15
9	002821	凯莱英	55,000	3,619,000.00	4.12
10	301257	普蕊斯	127,400	3,599,050.00	4.10
11	300149	睿智医药	900,000	3,564,000.00	4.06
12	688690	纳微科技	201,269	3,496,042.53	3.98
13	300725	药石科技	130,000	3,480,100.00	3.96
14	688621	阳光诺和	80,000	3,416,000.00	3.89
15	688293	奥浦迈	106,091	3,317,465.57	3.78
16	301333	诺思格	97,000	3,260,170.00	3.71
17	603456	九洲药业	237,000	3,251,640.00	3.70
18	300363	博腾股份	261,000	3,118,950.00	3.55
19	301520	万邦医药	71,032	2,939,304.16	3.35
20	688131	皓元医药	147,000	2,812,110.00	3.20

21	688238	和元生物	552,222	2,556,787.86	2.91
22	688202	美迪西	96,960	2,525,808.00	2.88
23	688073	毕得医药	83,000	2,471,740.00	2.81
24	300558	贝达药业	60,000	1,953,000.00	2.22
25	688133	泰坦科技	112,477	1,774,887.06	2.02
26	688325	赛微微电	1,102	34,569.74	0.04
27	688459	哈铁科技	3,339	27,413.19	0.03
28	688175	高凌信息	1,841	27,209.98	0.03
29	301305	朗坤环境	1,755	26,693.55	0.03
30	688163	赛伦生物	1,763	21,402.82	0.02
31	688657	浩辰软件	491	18,147.36	0.02
32	688137	近岸蛋白	363	11,652.30	0.01
33	688184	帕瓦股份	881	10,721.77	0.01
34	301566	达利凯普	438	7,336.50	0.01
35	301217	铜冠铜箔	686	6,585.60	0.01
36	301182	凯旺科技	279	6,188.22	0.01
37	688275	万润新能	201	5,913.42	0.01
38	301087	可孚医疗	153	5,186.70	0.01
39	688709	成都华微	262	4,917.74	0.01
40	301237	和顺科技	205	4,686.30	0.01
41	301201	诚达药业	233	4,240.60	0.00
42	301578	辰奕智能	107	4,233.99	0.00
43	301362	民爆光电	116	3,950.96	0.00
44	301206	三元生物	153	3,760.74	0.00
45	301200	大族数控	115	3,629.40	0.00
46	301295	美硕科技	181	3,603.71	0.00
47	301190	善水科技	254	3,563.62	0.00
48	688584	上海合晶	213	3,380.31	0.00
49	601033	永兴股份	208	3,317.60	0.00
50	301225	恒勃股份	116	3,294.40	0.00
51	301518	长华化学	168	2,911.44	0.00
52	301469	恒达新材	118	2,880.38	0.00
53	301386	未来电器	138	2,862.12	0.00
54	301519	舜禹股份	169	2,798.64	0.00
55	301399	英特科技	141	2,774.88	0.00
56	301397	溯联股份	88	2,763.20	0.00
57	301395	仁信新材	255	2,723.40	0.00
58	300834	星辉环材	136	2,720.00	0.00
59	301189	奥尼电子	116	2,697.00	0.00
60	301418	协昌科技	66	2,640.00	0.00
61	301150	中一科技	141	2,533.77	0.00
62	301210	金杨股份	84	2,520.84	0.00
63	301219	腾远钴业	65	2,486.90	0.00

64	601083	锦江航运	259	2,476.04	0.00
65	301108	洁雅股份	101	2,455.31	0.00
66	301166	优宁维	89	2,403.00	0.00
67	301528	多浦乐	56	2,399.04	0.00
68	301170	锡南科技	91	2,370.55	0.00
69	301559	中集环科	162	2,360.34	0.00
70	301196	唯科科技	79	2,332.87	0.00
71	301157	华塑科技	69	2,249.40	0.00
72	301371	敷尔佳	72	2,236.32	0.00
73	301232	飞沃科技	81	2,204.82	0.00
74	001387	雪祺电气	143	2,177.89	0.00
75	688719	爱科赛博	83	2,163.81	0.00
76	300804	广康生化	99	2,158.20	0.00
77	301525	儒竞科技	38	2,138.64	0.00
78	301332	德尔玛	240	2,121.60	0.00
79	301177	迪阿股份	113	2,101.80	0.00
80	301355	南王科技	212	2,033.08	0.00
81	301322	绿通科技	105	1,970.85	0.00
82	603082	北自科技	65	1,916.20	0.00
83	603325	博隆技术	24	1,632.48	0.00
84	001379	腾达科技	118	1,590.64	0.00
85	603375	盛景微	40	1,555.20	0.00
86	603312	西典新能	59	1,495.06	0.00
87	603004	鼎龙科技	87	1,474.65	0.00
88	603231	索宝蛋白	76	1,295.04	0.00
89	603276	恒兴新材	77	1,073.38	0.00
90	603062	麦加芯彩	29	963.09	0.00

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	603259	药明康德	13,253,401.73	9.62
2	688114	华大智造	6,658,545.52	4.83
3	300759	康龙化成	4,960,041.00	3.60
4	688513	苑东生物	4,894,061.15	3.55
5	688073	毕得医药	4,892,654.01	3.55
6	300363	博腾股份	4,804,255.00	3.49
7	300725	药石科技	4,712,823.00	3.42
8	300171	东富龙	4,605,823.00	3.34

9	300358	楚天科技	4,504,622.00	3.27
10	300636	同和药业	4,354,088.00	3.16
11	002821	凯莱英	4,248,221.00	3.08
12	301520	万邦医药	3,762,621.62	2.73
13	688133	泰坦科技	3,748,860.05	2.72
14	000739	普洛药业	3,375,077.00	2.45
15	300558	贝达药业	3,308,351.00	2.40
16	688179	阿拉丁	2,350,799.24	1.71
17	300149	睿智医药	2,117,775.00	1.54
18	301301	川宁生物	2,037,974.00	1.48
19	688443	智翔金泰	2,008,633.09	1.46
20	688621	阳光诺和	1,985,415.56	1.44

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	603259	药明康德	13,634,227.50	9.90
2	688198	佰仁医疗	7,257,061.92	5.27
3	300725	药石科技	6,966,434.48	5.06
4	300759	康龙化成	5,930,901.00	4.30
5	002821	凯莱英	5,525,505.40	4.01
6	300363	博腾股份	5,406,287.00	3.92
7	300636	同和药业	5,299,391.50	3.85
8	688513	苑东生物	5,288,991.49	3.84
9	300358	楚天科技	4,407,429.00	3.20
10	300171	东富龙	4,321,952.00	3.14
11	301230	泓博医药	3,962,022.71	2.88
12	603538	美诺华	3,408,036.00	2.47
13	000739	普洛药业	3,404,220.00	2.47
14	688677	海泰新光	2,883,464.79	2.09
15	300404	博济医药	2,762,097.00	2.00
16	688179	阿拉丁	2,500,806.52	1.81
17	688443	智翔金泰	2,388,245.06	1.73
18	300347	泰格医药	2,327,052.00	1.69
19	688114	华大智造	2,172,497.57	1.58
20	688073	毕得医药	2,142,682.41	1.56

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	102,098,933.47
卖出股票收入（成交）总额	104,511,276.64

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

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

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

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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。

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

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

7.11.2 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是否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

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	17,491.72
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	68,316.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	85,808.09

7.12.4 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。

7.12.5 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不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
5,340	20,466.08	-	-	109,288,850.20	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	51,152.78	0.0468%

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年3月27日）基金份额总额	2,327,526,690.74
本报告期期初基金份额总额	115,389,169.91
本报告期基金总申购份额	56,332,694.00
减：本报告期基金总赎回份额	62,433,013.71
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	109,288,850.20

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：本报告期内，无涉及基金管理人的重大人事变动。

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事项。

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

为进一步维护基金份额持有人的利益，促进会计师事务所提供更优质的服务，自 2024 年 1 月 1 日起，本基金改聘了审计服务机构，由普华永道会计师事务所（特殊普通合伙）变更为上会会计师事务所（特殊普通合伙），该变更事项已履行相关程序，于 2024 年 1 月 3 日进行信息披露公告，并已按照相关规定及合同约定通知基金托管人。

上会会计师事务所（特殊普通合伙）已连续为本基金提供 1 年审计服务，本报告期内应支付会计师事务所的审计费为 7,458.36 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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
天风证券	2	66,885,804.40	32.41%	63,266.73	37.38%	-
国海证券	2	51,877,364.72	25.14%	38,694.92	22.86%	-
华安证券	2	37,911,217.60	18.37%	28,277.61	16.71%	新增
国投证券	1	32,725,474.47	15.86%	24,409.42	14.42%	新增
中信证券	4	6,929,353.91	3.36%	5,168.70	3.05%	新增
方正证券	1	6,562,452.70	3.18%	6,141.98	3.63%	-
西南证券	1	3,389,038.26	1.64%	3,205.68	1.89%	-
东方财富证券	2	107,150.05	0.05%	79.90	0.05%	-
信达证券	4	-	-	-	-	-

东吴证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	新增
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	新增
国金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券	3	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

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

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

- ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本报告期内，本基金新增中信证券 1 个交易单元、国投证券 1 个交易单元、华安证券 1 个交易单元、西部证券 2 个交易单元，退租东兴证券 1 个交易单元、方正证券 1 个交易单元、联讯证券 1 个交易单元、川财证券 1 个交易单元、山西证券 2 个交易单元、西南证券 2 个交易单元、首创证券 2 个交易单元、中信建投证券 2 个交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

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

本基金未使用所租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

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	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下部分基金增加“华夏 e 家”同业平台为代销平台的公告	基金管理人网站	2024 年 1 月 3 日
2	北信瑞丰基金管理有限公司基金改聘会计师事务所公告(2)	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 3 日
3	北信瑞丰基金管理有限公司基金产品风险等级划分规则说明(2024 年 1 月更新)	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 12 日

4	北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 22 日
5	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金增加国金证券为代销机构的公告	基金管理人网站	2024 年 3 月 4 日
6	北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 30 日
7	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 22 日
8	北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 22 日
9	北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 8 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

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

无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 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健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金的文件。
- 2、北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同。
- 3、北信瑞丰健康生活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

北京市丰台区开阳路 8 号京印国际中心 A 栋 4 层。

12.3 查阅方式

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

北信瑞丰基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日