

北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证 券投资基金 2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：北信瑞丰基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 30 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 03 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。

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

本报告期自 2015 年 03 月 27 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况..... | 9 |
| §4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 12 |
| 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..... | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 12 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 14 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 14 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| §6 审计报告 | 15 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 15 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 15 |
| §7 年度财务报表 | 16 |
| 7.1 资产负债表..... | 16 |
| 7.2 利润表..... | 18 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 19 |
| 7.4 报表附注..... | 19 |
| §8 投资组合报告 | 39 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 39 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 39 |
| 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..... | 40 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 41 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 45 |
| 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..... | 45 |
| 8.7 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..... | 45 |
| 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..... | 45 |

| | |
|---|-----------|
| 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..... | 45 |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 45 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 45 |
| 8.12 投资组合报告附注..... | 46 |
| §9 基金份额持有人信息..... | 46 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 46 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 47 |
| 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..... | 47 |
| §10 开放式基金份额变动..... | 47 |
| §11 重大事件揭示..... | 47 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议..... | 47 |
| 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..... | 47 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 47 |
| 11.4 基金投资策略的改变..... | 48 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 48 |
| 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..... | 48 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 48 |
| 11.8 其他重大事件..... | 50 |
| §12 备查文件目录..... | 54 |
| 12.1 备查文件目录..... | 54 |
| 12.2 存放地点..... | 54 |
| 12.3 查阅方式..... | 54 |

§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 | 1,037,250,892.30 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 | 张洪水 | 蒋松云 |
| | 联系电话 | 010-68619306 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | zhanghongshui@bxrfund.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4000617297 | 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 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | 100048 | 100140 |
| 法定代表人 | 周瑞明 | 姜建清 |

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 | http://www.bxrfund.com |
| 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 号企业天地 2 号楼普华永道中心 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 |

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日 |
|---------------|---|
| 本期已实现收益 | 137,620,691.67 |
| 本期利润 | 66,764,569.50 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0436 |
| 本期加权平均净值利润率 | 4.39% |
| 本期基金份额净值增长率 | -0.30% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末 |
| 期末可供分配利润 | -25,427,198.35 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0245 |
| 期末基金资产净值 | 1,034,579,617.78 |
| 期末基金份额净值 | 0.997 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2015 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | -0.30% |

注：1、本基金基金合同自 2015 年 3 月 27 日起生效，至 2015 年 12 月 31 日未满 12 个月；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

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

3.2 基金净值表现

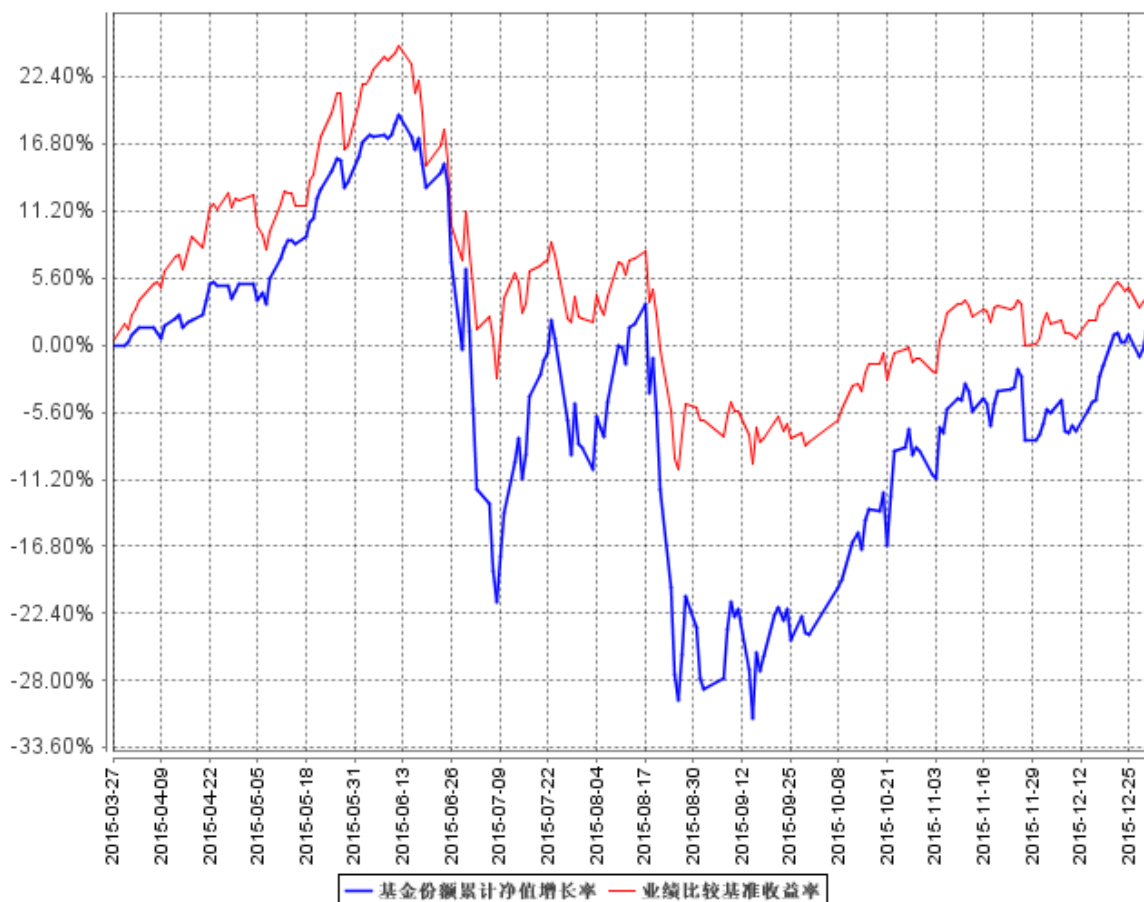
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 31.36% | 2.00% | 12.18% | 1.03% | 19.18% | 0.97% |
| 过去六个月 | -6.30% | 3.33% | -7.15% | 1.64% | 0.85% | 1.69% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.30% | 2.86% | 3.17% | 1.61% | -3.47% | 1.25% |

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

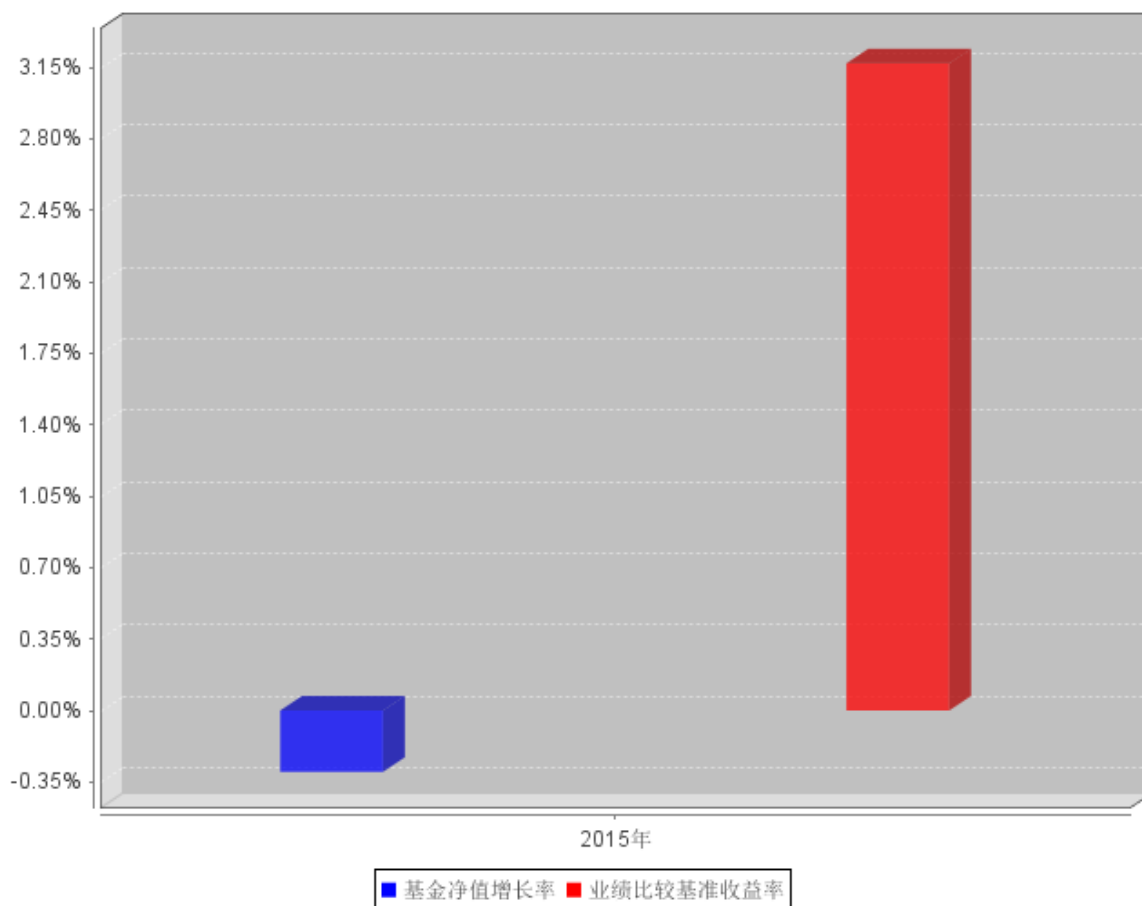
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同自 2015 年 3 月 27 日起生效，至 2015 年 12 月 31 日未满 12 个月。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2015 年 3 月 27 日起生效，基金成立当年净值增长率以实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同自 2015 年 3 月 27 日起生效，至 2015 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。

2015 年 7 月 10 日，基金子公司——上海北信瑞丰资产管理有限公司成立。2015 年，公司荣膺大众证券报“2015 十大风云基金公司”；北信瑞丰稳定收益债券基金摘得“2015 东方财富风云榜”最受欢迎债券类基金大奖。

截至报告期末，公司共成立 7 只公募产品，保有 60 只专户产品，资产管理规模超过 139 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 于军华 | 基金经理 | 2014 年 9 月 30 日 | - | 5 | CPA，中国人民大学世界经济经济学硕士毕业。 原国家信息中心经济咨询中心高级项目分析师，宏源证券研究所行业分析师，擅长公司基本面分析，2014 年 4 月加入北信瑞丰基金管理有限公司投资研究部，现任北信瑞丰无限互联灵活配置基金基金经理，北信瑞丰健康生活灵活配置基金基金经理。 |
| 高峰 | 副总经理 | 2014 年 5 月 26 日 | - | 15 | 北京大学光华管理学院国民经济管理 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | <p>硕士， 20 年金融 从业经验， 15 年证券 投资研究 经验。 曾任中国 对外经济 贸易信托 投资公司 计划财务 部财务科 经理，中 化总公司 财务部综 合部经理， 中国对外 经济贸易 信托有限 公司资产 管理部副 总经理、 证券业务 部总经理， 宝盈基金 管理有限 公司董事， 宝盈基金 管理有限 公司总经 理助理、 投资部总 监、基金 经理、公 司投委会 主席，现 任北信瑞 丰基金管 理有限公 司副总经 理。</p> |
|--|--|--|--|--|---|

注：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》、《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》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

如果用一句话来概括 2015 年全年 A 股市场，可能很难找到比“冰火两重天”更为贴切的了。在年底回顾全年，全年指数的上涨大概在 20%左右，与我们预期基本一致，但我们猜对了结局，却没有猜对过程，没有想到 5 月，6 月市场会涨到如此之高，也没有想到随后 7 月，9 月的调整方式会如此极端。作为一支 15 年 3 月底新成立的基金，成立之初市场快速上涨时还在封闭期内，没有快速加仓，基金开放后市场已涨到高位，因此在 15 年上半年绝大部分时间都比较谨慎，三季度后才逐步开始相对积极的投资操作。全年业绩略优于比较基准，基本完成预定的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率-0.30%，波动率 2.86%，业绩比较基准收益率 3.17%，波动率 1.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然 2016 年开年之初市场就出现破位的恐慌性下跌，但展望全年，我们仍维持之前对市场环境的基本判断：一、股票市场大的牛市背景并没有发生变化，这一轮牛市最大的动力，一是来自于居民金融资产配置向权益类市场转移，二是决策层希望借助一个活跃的资本市场解决融资结构及转型期投资动力不足的问题，这将是一个持续至少 3 到 5 年的趋势。二、全年市场大概率将呈现震荡上升的格局，不论上涨还是下跌都难以走出大的单边行情，目前市场总体估值水平尚处于合理区间，但结构非常不均衡，或者说定价效率很低，向合理水平回归应该是一个长期趋势。三、高估值的成长股分化将加剧，考验选股能力。中长期的许多观点和理念我们都是一贯坚持的，这里就不再重复了。

在 A 股市场做投资，有些问题可能一直困扰着许多投资者，价值投资到底有没有用？为什么国内市场投资者总愿意追逐业绩不佳、甚至没有主营业务、不断围绕市场热点讲故事的中小市值公司？成熟市场一般都是行业龙头估值最高，而在 A 股市场则刚好相反？低市盈率的蓝筹股到底有没有投资价值？要理解这些问题，我们还是要回到本源，那就是投资者进入这个市场的初心，我们追求的盈利目标是什么？成熟市场中，绝大部分投资者投资于权益类产品，每年的盈利目标基本上是 10%到 15%之间，这一目标和优质公司权益回报率基本一致，因此选择好的企业长期持有是可以达到的，这是价值投资有效的坚实基础，也被上百年来成熟市场的发展所证实。但在 A 股市场，绝大部分的投资者，包括很多机构投资者，都不会满足于每年 10%左右的收益率，买入股票的原因就是希望在 3 个月到 6 个月股价能够上涨 50%或者更多，这显然是很难依靠企业的正常经营来满足的，只能寄希望于并购、重组、转型等非常规发展，而各行业的龙头公司、市值巨大的蓝筹公司转型动力不强，自然难以受到这部分投资者的青睐。也就是说，低估值的蓝筹公司的投资价值，是和投资者的期望收益率相关的，对于追求短时间高收益率的投资者来说，可能确实没有“价值”，但并不意味着对于追求长期稳定合理收益的资金就没有投资价值。年底前后，保险资金大规模举牌的对象，则正是地产、金融等低估值的蓝筹公司，这与保险资金的特点和收益率目标是相符的，保险资金成本较低，追求的是长期较为稳定的投资回报，年期望收益率能达到 10%就很满意，对于这部分资金，最佳投资对象就是低估值、业绩稳定的蓝筹股。预计今年部分银行理财资金也会进入市场，这部分资金成本和期望收益率更低，将会明显提升业绩稳定、估值较低的各行业龙头公司的估值水平，成为市场稳定的重要力量。

本基金是健康生活主题基金，主要投资对象是有关健康、娱乐、环保等方面公司，主要集中在医药、医疗服务、传媒、食品饮料、环保等行业，这几个行业，尤其是医药和食品饮料，由于行业景气度以及市场风格偏好的原因，连续两年跑输市场，不论是纵向比较还是横向比较，估值都处于低位，而其受宏观经济的影响又比较小，有许多适合长期投资的品种。我们会在市场调整中选择估值偏低或处于合理区间，业绩稳定增长或即将进入加速增长通道、战略明确、管理优良的上市公司进行长期投资，同时也会根据市场波动和关注热点的变化把握一些波段机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内，本基金管理人开展了基金管理公司内控自查、基金从业人员证券投资行为自查等多项内控自查工作，制定或修订了《北信瑞丰基金管理有限公司基金资产关联交易管理办法》、《公司从业人员证券投资管理制

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理公司于本报告期内成立估值小组，成员由总经理、督察长、基金运营部总监、基金经理及基金会计组成。估值小组负责确定基金估值程序及标准以及对突发事件的处理，在采用估值政策和程序时，充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和独立性，通过估值委员会、参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金的管理人——北信瑞丰基金管理有限公司在北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对北信瑞丰基金管理有限公司编制和披露的北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

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(2016)第 22423 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 | 北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人： |

| | |
|--------------|---|
| 引言段 | 我们审计了后附的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“北信瑞丰健康生活混合基金”)的财务报表,包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 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。 |
| 管理层对财务报表的责任段 | 编制和公允列报财务报表是北信瑞丰健康生活混合基金的基金管理人北信瑞丰基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1)按照企业会计准则和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财务报表,并使其实现公允反映; (2)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。 |
| 注册会计师的责任段 | 我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 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。 |
| 审计意见段 | 我们认为,上述北信瑞丰健康生活混合基金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,公允反映了北信瑞丰健康生活混合基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。 |
| 注册会计师的姓名 | 薛竞 张勇 |
| 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) |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼 |
| 审计报告日期 | 2016 年 3 月 25 日 |

§7 年度财务报表

7.1 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：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|---------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 70,941,973.12 |
| 结算备付金 | | 10,898,755.75 |
| 存出保证金 | | 1,721,077.82 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 807,496,809.84 |
| 其中：股票投资 | | 807,496,809.84 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | - |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | 150,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 465,862.83 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 36,005.71 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | 1,997.00 |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 1,041,562,482.07 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2015 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | |
| 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 | | 987,526.39 |
| 应付管理人报酬 | | 1,307,463.16 |
| 应付托管费 | | 217,910.54 |
| 应付销售服务费 | | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 4,318,656.79 |
| 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 | 151,307.41 |
| 负债合计 | | 6,982,864.29 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 1,037,250,892.30 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | -2,671,274.52 |
| 所有者权益合计 | | 1,034,579,617.78 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,041,562,482.07 |

注：1、报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.997 元，基金份额总额

1,037,250,892.30 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2015 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日。

7.2 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：2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|------------------------|------------|---|
| 一、收入 | | 101,130,200.81 |
| 1. 利息收入 | | 9,104,827.20 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 1,549,304.33 |
| 债券利息收入 | | 407.44 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 7,555,115.43 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 159,237,940.78 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 150,715,923.62 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 361,741.28 |
| 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 | 8,160,275.88 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | -70,856,122.17 |
| 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 | 3,643,555.00 |

| | | |
|----------------------------|------------|---------------|
| 减：二、费用 | | 34,365,631.31 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 17,299,277.19 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 2,883,212.86 |
| 3. 销售服务费 | | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | 14,018,380.21 |
| 5. 利息支出 | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.20 | 164,761.05 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 66,764,569.50 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 66,764,569.50 |

注：本基金基金合同自 2015 年 03 月 27 日起生效，至 2015 年 12 月 31 日未满 12 个月。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 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） | 2,327,526,690.74 | - | 2,327,526,690.74 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 66,764,569.50 | 66,764,569.50 |
| 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） | -1,290,275,798.44 | -69,435,844.02 | -1,359,711,642.46 |
| 其中：1. 基金申购款 | 54,704,298.37 | -6,193,990.46 | 48,510,307.91 |
| 2. 基金赎回款 | -1,344,980,096.81 | -63,241,853.56 | -1,408,221,950.37 |
| 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） | 1,037,250,892.30 | -2,671,274.52 | 1,034,579,617.78 |

注：本基金基金合同自 2015 年 03 月 27 日起生效，至 2015 年 12 月 31 日未满 12 个月。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|-----------|-----------|-----------|
| <u>朱彦</u> | <u>郭亚</u> | <u>孟曦</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

北信瑞丰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 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。

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，本基金投资范围限于国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金持有的股票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×60% + 中证综合债券指数收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人北信瑞丰基金管理有限公司于 2016 年 3 月 25 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》、《北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 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 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 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和债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公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金持有的其他金融负债包括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和债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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金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，并且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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利

润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

本报告期内本基金无会计估计变更。

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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 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 2015 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款 | 70,941,973.12 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 70,941,973.12 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015 年 12 月 31 日 | | |
|-------------------|-------------------------|----------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 878,352,932.01 | 807,496,809.84 | -70,856,122.17 |
| 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 | 878,352,932.01 | 807,496,809.84 | -70,856,122.17 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本年度末未持有衍生金融资产/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 2015 年 12 月 31 日 | |
|--------|-------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券 | 150,000,000.00 | - |
| 合计 | 150,000,000.00 | - |

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本年度末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 2015 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|
| 应收活期存款利息 | 25,383.92 |
| 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 | 5,394.95 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | 4,375.00 |
| 应收申购款利息 | - |

| | |
|------------|-----------|
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 851.84 |
| 合计 | 36,005.71 |

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 4,318,656.79 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 4,318,656.79 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年12月31日 |
|-------|--------------------|
| 应付赎回费 | 1,307.41 |
| 预提费用 | 150,000.00 |
| 合计 | 151,307.41 |

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年3月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日 | |
|---------------|---------------------------------------|-------------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 2,327,526,690.74 | 2,327,526,690.74 |
| 本期申购 | 54,704,298.37 | 54,704,298.37 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -1,344,980,096.81 | -1,344,980,096.81 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 1,037,250,892.30 | 1,037,250,892.30 |

注：

1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2015 年 3 月 6 日至 2015 年 3 月 24 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 2,327,331,239.57 元。根据《北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 195,451.17 元在本基金成立后，折算为 195,451.17 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 18 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务和转换业务自 2015 年 6 月 19 日起开始办理。

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 |
|----------------|-----------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 137,620,691.67 | -70,856,122.17 | 66,764,569.50 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -163,047,890.02 | 93,612,046.00 | -69,435,844.02 |
| 其中：基金申购款 | 3,310,206.71 | -9,504,197.17 | -6,193,990.46 |
| 基金赎回款 | -166,358,096.73 | 103,116,243.17 | -63,241,853.56 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -25,427,198.35 | 22,755,923.83 | -2,671,274.52 |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------|---|
| 活期存款利息收入 | 1,118,915.22 |
| 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 | 411,971.47 |
| 其他 | 18,417.64 |
| 合计 | 1,549,304.33 |

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|-------------|---|
| 卖出股票成交总额 | 4,993,030,455.38 |
| 减: 卖出股票成本总额 | 4,842,314,531.76 |
| 买卖股票差价收入 | 150,715,923.62 |

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 2015年3月27日(基金合同生效日)至 2015年12月31日 |
|--------------------------|---|
| 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额 | 1,503,148.72 |
| 减: 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额 | 1,141,000.00 |
| 减: 应收利息总额 | 407.44 |
| 买卖债券差价收入 | 361,741.28 |

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注: 本基金本报告期无资产支持证券投资。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注: 本基金本报告期无贵金属投资。

7.4.7.15 衍生工具收益

注: 本基金本报告期无衍生工具投资。

7.4.7.16 股利收益

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|-------------|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 8,160,275.88 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 8,160,275.88 |

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2015年3月27日(基金合同生效日)至2015年 12月31日 |
|------------|---|
| 1. 交易性金融资产 | -70,856,122.17 |
| ——股票投资 | -70,856,122.17 |
| ——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 | - |
| 合计 | -70,856,122.17 |

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年3月27日(基金合同生效日)至2015年 12月31日 |
|---------|---|
| 基金赎回费收入 | 3,642,865.83 |
| 转换费收入 | 689.17 |
| 合计 | 3,643,555.00 |

注：

1. 本基金的投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于 30 日但少于 90 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 75% 归入基金财产；对于持有期长于 90 日但小于 180 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 50% 归入基金财产；对于持有期长于 180 日但小于 730 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 25% 归入基金财产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于 30 日但少于 90 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 75% 归入基金财产；对于持有期长于 90 日但小于 180 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 50% 归入基金财产；对于持有期长于 180 日但小于 730 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 25% 归入基金财产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年3月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 14,018,380.21 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 14,018,380.21 |

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年3月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |
|-------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 30,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 |
| 其他 | 400.00 |
| 银行费用 | 8,361.05 |
| 帐户维护费 | 6,000.00 |
| 合计 | 164,761.05 |

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

截至本财务报表批准报出日，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 |
| 中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 北京国际信托有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 莱州瑞海投资有限公司 | 基金管理人的股东 |

注：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

注：本基金 2015 年 03 月 27 日成立，截止到报告期未满 12 个月。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本报告期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 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 17,299,277.19 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 10,407,566.43 |

注：支付基金管理人北信瑞丰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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 1.5 % / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|----------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,883,212.86 |

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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**

份额单位：份

| 项目 | 本期 2015 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|---------------------------------|---|
| 基金合同生效日（2015 年 3 月 27 日）持有的基金份额 | 14,999,000.00 |

| | |
|-----------------------|---------------|
| 期初持有的基金份额 | 14,999,000.00 |
| 期间申购/买入总份额 | 5,542,128.60 |
| 期间因拆分变动份额 | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - |
| 期末持有的基金份额 | 20,541,128.60 |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 1.98% |

注：

1. 期间申购总份额含红利再投份额，期间赎回总份额含转换出份额。
2. 基金管理人北信瑞丰基金 在本年度申购/赎回本基金的交易委托北信瑞丰基金直销中心办理，申购费为人民币 1,000 元/笔。

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

注：本基金本报告期内未发生除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2015年3月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日 | |
|--------------|---------------------------------------|--------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 70,941,973.12 | 1,118,915.22 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，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

注：本基金本报告期内未发生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

注：本报告期间本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

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

注：本基金本报告期内未实施利润分配。

7.4.12 期末（2015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

注：截止 2015 年 12 月 31 日，未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截至 2015 年 12 月 31 日，未持有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

注：至本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：至本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。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。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过风险管理委员会设定流动性比例要求，独立的风险管理部门对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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的证券不得超过该证券的 10%。本

基金所持证券均在证券交易所上市，除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

于 2015 年 12 月 31 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 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：本基金本报告期末无金融资产和金融负债列示。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2015 年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月 -1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|----------------------------|----------------|--------|--------------|-------|-------|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 70,941,973.12 | - | - | - | - | - | 70,941,973.12 |
| 结算备付金 | 10,898,755.75 | - | - | - | - | - | 10,898,755.75 |
| 存出保证金 | 1,721,077.82 | - | - | - | - | - | 1,721,077.82 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 807,496,809.84 | 807,496,809.84 |
| 买入返售金融资产 | 150,000,000.00 | - | - | - | - | - | 150,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 465,862.83 | 465,862.83 |

| | | | | | | |
|---------|----------------|---|---|---|-----------------|------------------|
| 应收利息 | - | - | - | - | 36,005.71 | 36,005.71 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | 1,997.00 | 1,997.00 |
| 资产总计 | 233,561,806.69 | - | - | - | -808,000,675.38 | 1,041,562,482.07 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | 987,526.39 | 987,526.39 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 1,307,463.16 | 1,307,463.16 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 217,910.54 | 217,910.54 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | 4,318,656.79 | 4,318,656.79 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 151,307.41 | 151,307.41 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 6,982,864.29 | 6,982,864.29 |
| 利率敏感度缺口 | 233,561,806.69 | - | - | - | -801,017,811.09 | 1,034,579,617.78 |

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

注：于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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%。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。

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 2015 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 | 807,496,809.84 | 78.05 |
| 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 | 807,496,809.84 | 78.05 |

注：于本期末，本基金成立不满一年，尚无足够经验数据。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2015 年 12 月 31 日，本基金运作尚不足一年，无足够经验数据。

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

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。

(a) 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 2015 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 807,496,809.84 元，无属于第二及第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交

易不活跃)等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(b)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015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。

(c)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | 807,496,809.84 | 77.53 |
| | 其中:股票 | 807,496,809.84 | 77.53 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 150,000,000.00 | 14.40 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 81,840,728.87 | 7.86 |
| 7 | 其他各项资产 | 2,224,943.36 | 0.21 |
| 8 | 合计 | 1,041,562,482.07 | 100.00 |

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 | 82,886,494.14 | 8.01 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 510,570,191.12 | 49.35 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,236,357.40 | 1.18 |
| E | 建筑业 | 18,685.00 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 120,765,486.06 | 11.67 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 77,007,120.24 | 7.44 |
| 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 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 4,012,475.88 | 0.39 |
| 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 | 807,496,809.84 | 78.05 |

注：以上行业分类以 2015 年 12 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本报告期末本基金未持有按行业分类的沪港通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 | 002653 | 海思科 | 2,550,038 | 55,820,331.82 | 5.40 |
| 2 | 000915 | 山大华特 | 1,350,061 | 47,468,144.76 | 4.59 |
| 3 | 000503 | 海虹控股 | 1,390,076 | 46,553,645.24 | 4.50 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 4 | 600332 | 白云山 | 1,500,000 | 45,405,000.00 | 4.39 |
| 5 | 600276 | 恒瑞医药 | 900,000 | 44,208,000.00 | 4.27 |
| 6 | 601607 | 上海医药 | 2,200,000 | 43,802,000.00 | 4.23 |
| 7 | 002038 | 双鹭药业 | 1,300,052 | 43,551,742.00 | 4.21 |
| 8 | 600881 | 亚泰集团 | 5,884,901 | 42,606,683.24 | 4.12 |
| 9 | 300006 | 莱美药业 | 958,546 | 38,341,840.00 | 3.71 |
| 10 | 600521 | 华海药业 | 1,326,787 | 33,687,121.93 | 3.26 |
| 11 | 000078 | 海王生物 | 1,300,000 | 31,148,000.00 | 3.01 |
| 12 | 300273 | 和佳股份 | 1,350,000 | 28,215,000.00 | 2.73 |
| 13 | 600108 | 亚盛集团 | 3,615,100 | 26,534,834.00 | 2.56 |
| 14 | 600467 | 好当家 | 2,465,301 | 26,181,496.62 | 2.53 |
| 15 | 000919 | 金陵药业 | 1,500,000 | 25,800,000.00 | 2.49 |
| 16 | 600166 | 福田汽车 | 3,654,200 | 23,131,086.00 | 2.24 |
| 17 | 600976 | 武汉健民 | 641,622 | 21,706,072.26 | 2.10 |
| 18 | 600037 | 歌华有线 | 1,000,000 | 21,530,000.00 | 2.08 |
| 19 | 600422 | 昆明制药 | 464,902 | 18,512,397.64 | 1.79 |
| 20 | 600073 | 上海梅林 | 1,200,000 | 16,980,000.00 | 1.64 |
| 21 | 300206 | 理邦仪器 | 611,850 | 16,862,586.00 | 1.63 |
| 22 | 300026 | 红日药业 | 760,800 | 16,052,880.00 | 1.55 |
| 23 | 002447 | 壹桥海参 | 1,617,200 | 15,605,980.00 | 1.51 |
| 24 | 002321 | 华英农业 | 1,102,512 | 14,564,183.52 | 1.41 |
| 25 | 600211 | 西藏药业 | 299,210 | 13,099,413.80 | 1.27 |
| 26 | 002479 | 富春环保 | 913,161 | 12,236,357.40 | 1.18 |
| 27 | 600993 | 马应龙 | 500,000 | 11,010,000.00 | 1.06 |
| 28 | 000839 | 中信国安 | 438,500 | 8,923,475.00 | 0.86 |
| 29 | 600809 | 山西汾酒 | 302,200 | 5,823,394.00 | 0.56 |
| 30 | 600129 | 太极集团 | 252,281 | 5,381,153.73 | 0.52 |
| 31 | 000826 | 启迪桑德 | 101,274 | 4,012,475.88 | 0.39 |
| 32 | 300158 | 振东制药 | 131,000 | 2,652,750.00 | 0.26 |
| 33 | 002785 | 万里石 | 12,000 | 70,080.00 | 0.01 |
| 34 | 002781 | 奇信股份 | 500 | 18,685.00 | 0.00 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|------|------|----------|-----------------|
|----|------|------|----------|-----------------|

| | | | | |
|----|--------|------|----------------|-------|
| 1 | 601166 | 兴业银行 | 366,678,935.38 | 35.44 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 366,286,194.12 | 35.40 |
| 3 | 600637 | 百视通 | 248,884,031.80 | 24.06 |
| 4 | 002653 | 海思科 | 243,876,519.58 | 23.57 |
| 5 | 600976 | 武汉健民 | 207,067,118.57 | 20.01 |
| 6 | 300006 | 莱美药业 | 165,895,578.23 | 16.04 |
| 7 | 600600 | 青岛啤酒 | 163,718,056.82 | 15.82 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 159,891,403.73 | 15.45 |
| 9 | 300273 | 和佳股份 | 154,738,730.19 | 14.96 |
| 10 | 002432 | 九安医疗 | 151,608,108.82 | 14.65 |
| 11 | 600511 | 国药股份 | 134,930,465.17 | 13.04 |
| 12 | 601288 | 农业银行 | 121,099,350.00 | 11.71 |
| 13 | 600158 | 中体产业 | 118,922,230.19 | 11.49 |
| 14 | 601988 | 中国银行 | 118,905,000.00 | 11.49 |
| 15 | 000503 | 海虹控股 | 115,027,433.16 | 11.12 |
| 16 | 600332 | 白云山 | 111,219,322.27 | 10.75 |
| 17 | 600881 | 亚泰集团 | 106,289,897.27 | 10.27 |
| 18 | 000826 | 启迪桑德 | 101,816,079.05 | 9.84 |
| 19 | 601888 | 中国国旅 | 98,581,993.80 | 9.53 |
| 20 | 600422 | 昆明制药 | 98,241,108.36 | 9.50 |
| 21 | 002707 | 众信旅游 | 93,732,757.09 | 9.06 |
| 22 | 300254 | 仟源医药 | 92,448,348.26 | 8.94 |
| 23 | 600521 | 华海药业 | 90,920,324.03 | 8.79 |
| 24 | 300003 | 乐普医疗 | 90,082,491.83 | 8.71 |
| 25 | 002038 | 双鹭药业 | 72,676,378.76 | 7.02 |
| 26 | 600037 | 歌华有线 | 71,460,285.00 | 6.91 |
| 27 | 300081 | 恒信移动 | 68,273,087.72 | 6.60 |
| 28 | 000915 | 山大华特 | 64,127,842.20 | 6.20 |
| 29 | 300005 | 探路者 | 60,200,131.37 | 5.82 |
| 30 | 300288 | 朗玛信息 | 59,270,826.99 | 5.73 |
| 31 | 300178 | 腾邦国际 | 58,139,304.42 | 5.62 |
| 32 | 002412 | 汉森制药 | 55,125,946.14 | 5.33 |
| 33 | 000078 | 海王生物 | 55,009,772.98 | 5.32 |
| 34 | 002287 | 奇正藏药 | 54,851,460.00 | 5.30 |
| 35 | 600832 | 东方明珠 | 54,179,524.79 | 5.24 |
| 36 | 601607 | 上海医药 | 54,122,186.60 | 5.23 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 37 | 300289 | 利德曼 | 50,890,335.21 | 4.92 |
| 38 | 600276 | 恒瑞医药 | 50,543,864.40 | 4.89 |
| 39 | 300016 | 北陆药业 | 50,171,194.00 | 4.85 |
| 40 | 000566 | 海南海药 | 47,124,350.15 | 4.55 |
| 41 | 600993 | 马应龙 | 45,588,218.79 | 4.41 |
| 42 | 300144 | 宋城演艺 | 42,878,031.46 | 4.14 |
| 43 | 600697 | 欧亚集团 | 42,004,632.00 | 4.06 |
| 44 | 000739 | 普洛药业 | 37,987,985.18 | 3.67 |
| 45 | 300204 | 舒泰神 | 37,830,311.74 | 3.66 |
| 46 | 300244 | 迪安诊断 | 37,652,157.78 | 3.64 |
| 47 | 600467 | 好当家 | 37,651,415.81 | 3.64 |
| 48 | 000661 | 长春高新 | 36,441,611.04 | 3.52 |
| 49 | 300431 | 暴风科技 | 36,171,721.00 | 3.50 |
| 50 | 000919 | 金陵药业 | 35,658,656.93 | 3.45 |
| 51 | 300026 | 红日药业 | 33,971,061.76 | 3.28 |
| 52 | 600594 | 益佰制药 | 31,822,396.88 | 3.08 |
| 53 | 300197 | 铁汉生态 | 31,821,664.46 | 3.08 |
| 54 | 600129 | 太极集团 | 29,453,798.72 | 2.85 |
| 55 | 600108 | 亚盛集团 | 26,963,081.66 | 2.61 |
| 56 | 600351 | 亚宝药业 | 26,500,718.14 | 2.56 |
| 57 | 600386 | 北巴传媒 | 23,956,934.00 | 2.32 |
| 58 | 002675 | 东诚药业 | 23,703,150.08 | 2.29 |
| 59 | 600073 | 上海梅林 | 23,360,023.00 | 2.26 |
| 60 | 002479 | 富春环保 | 22,693,478.54 | 2.19 |
| 61 | 600166 | 福田汽车 | 22,306,651.30 | 2.16 |
| 62 | 300463 | 迈克生物 | 21,399,343.00 | 2.07 |
| 63 | 002447 | 壹桥海参 | 21,290,422.75 | 2.06 |

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1 | 601166 | 兴业银行 | 366,061,706.14 | 35.38 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 363,899,164.85 | 35.17 |
| 3 | 600637 | 百视通 | 255,350,173.87 | 24.68 |

| | | | | |
|----|--------|------|----------------|-------|
| 4 | 002653 | 海思科 | 192,028,724.07 | 18.56 |
| 5 | 600600 | 青岛啤酒 | 168,029,232.20 | 16.24 |
| 6 | 600976 | 武汉健民 | 162,639,349.12 | 15.72 |
| 7 | 600030 | 中信证券 | 159,227,773.51 | 15.39 |
| 8 | 600511 | 国药股份 | 148,305,696.38 | 14.33 |
| 9 | 300273 | 和佳股份 | 139,708,347.51 | 13.50 |
| 10 | 002432 | 九安医疗 | 136,240,093.04 | 13.17 |
| 11 | 300006 | 莱美药业 | 135,562,394.00 | 13.10 |
| 12 | 600158 | 中体产业 | 131,009,107.81 | 12.66 |
| 13 | 601288 | 农业银行 | 116,892,190.00 | 11.30 |
| 14 | 300003 | 乐普医疗 | 115,542,046.60 | 11.17 |
| 15 | 601988 | 中国银行 | 114,832,973.56 | 11.10 |
| 16 | 601888 | 中国国旅 | 106,679,998.35 | 10.31 |
| 17 | 000826 | 启迪桑德 | 104,180,810.90 | 10.07 |
| 18 | 300254 | 仟源医药 | 91,093,658.00 | 8.80 |
| 19 | 002707 | 众信旅游 | 86,986,173.00 | 8.41 |
| 20 | 600422 | 昆明制药 | 79,912,393.00 | 7.72 |
| 21 | 300081 | 恒信移动 | 76,391,719.73 | 7.38 |
| 22 | 600832 | 东方明珠 | 67,596,480.59 | 6.53 |
| 23 | 300005 | 探路者 | 66,601,367.28 | 6.44 |
| 24 | 600881 | 亚泰集团 | 66,521,903.17 | 6.43 |
| 25 | 600521 | 华海药业 | 65,225,935.17 | 6.30 |
| 26 | 300288 | 朗玛信息 | 58,448,166.10 | 5.65 |
| 27 | 300178 | 腾邦国际 | 55,880,106.78 | 5.40 |
| 28 | 000566 | 海南海药 | 49,114,027.00 | 4.75 |
| 29 | 600332 | 白云山 | 48,922,760.71 | 4.73 |
| 30 | 300144 | 宋城演艺 | 47,641,859.30 | 4.60 |
| 31 | 300244 | 迪安诊断 | 46,315,611.38 | 4.48 |
| 32 | 002287 | 奇正藏药 | 43,828,576.00 | 4.24 |
| 33 | 000739 | 普洛药业 | 43,033,169.04 | 4.16 |
| 34 | 600037 | 歌华有线 | 41,566,739.01 | 4.02 |
| 35 | 300204 | 舒泰神 | 41,137,399.59 | 3.98 |
| 36 | 600697 | 欧亚集团 | 40,910,024.78 | 3.95 |
| 37 | 600993 | 马应龙 | 40,772,896.42 | 3.94 |
| 38 | 300289 | 利德曼 | 40,552,484.40 | 3.92 |
| 39 | 000661 | 长春高新 | 39,427,347.32 | 3.81 |
| 40 | 000503 | 海虹控股 | 39,304,904.26 | 3.80 |
| 41 | 600351 | 亚宝药业 | 38,212,756.81 | 3.69 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 42 | 300016 | 北陆药业 | 37,634,087.00 | 3.64 |
| 43 | 300197 | 铁汉生态 | 37,441,023.18 | 3.62 |
| 44 | 002412 | 汉森制药 | 35,821,947.95 | 3.46 |
| 45 | 300431 | 暴风科技 | 35,048,327.00 | 3.39 |
| 46 | 600594 | 益佰制药 | 34,707,136.96 | 3.35 |
| 47 | 600386 | 北巴传媒 | 30,093,022.20 | 2.91 |
| 48 | 000078 | 海王生物 | 28,503,068.30 | 2.76 |
| 49 | 600129 | 太极集团 | 27,911,056.76 | 2.70 |
| 50 | 002038 | 双鹭药业 | 27,223,663.90 | 2.63 |
| 51 | 300026 | 红日药业 | 26,001,062.00 | 2.51 |
| 52 | 002675 | 东诚药业 | 25,397,996.40 | 2.45 |
| 53 | 300463 | 迈克生物 | 25,361,304.00 | 2.45 |
| 54 | 002086 | 东方海洋 | 21,776,485.61 | 2.10 |
| 55 | 002690 | 美亚光电 | 20,716,432.00 | 2.00 |

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 | 5,720,667,463.77 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 4,993,030,455.38 |

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：（1）本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金本报告期内未进行股指期货交易。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：（1）本基金本报告期末未持有国债期货。

（2）本基金本报告期内未进行国债期货交易。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,721,077.82 |
| 2 | 应收证券清算款 | 465,862.83 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 36,005.71 |
| 5 | 应收申购款 | 1,997.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,224,943.36 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§9 基金份额持有人信息**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|---------------|------------|------------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 11,258 | 92,134.56 | 23,316,891.96 | 2.25% | 1,013,934,000.34 | 97.75% |

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 | 1,216,720.50 | 0.12% |

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 | 50~100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 50~100 |

§10 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 | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 54,704,298.37 |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 1,344,980,096.81 |

| | |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,037,250,892.30 |

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

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人本报告期内没有发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 30,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 招商证券 | 1 | 234,836,952.20 | 2.19% | 213,795.13 | 2.71% | 新增 |
| 国联证券 | 11 | 1,604,021,726.54 | 14.98% | 1,139,497.62 | 14.43% | 新增 |

| | | | | | | |
|--------|---|------------------|--------|--------------|--------|----|
| 中信建投证券 | 2 | 2,439,535,720.24 | 22.78% | 2,230,316.17 | 28.25% | 新增 |
| 川财证券 | 1 | 563,332,789.78 | 5.26% | 404,456.08 | 5.12% | 新增 |
| 西南证券 | 1 | 85,636,276.61 | 0.80% | 79,753.02 | 1.01% | 新增 |
| 东兴证券 | 1 | 1,264,538,887.33 | 11.81% | 1,160,264.15 | 14.70% | 新增 |
| 山西证券 | 1 | 154,505,910.32 | 1.44% | 109,761.28 | 1.39% | 新增 |
| 国都证券 | 2 | 946,686,091.28 | 8.84% | 686,553.56 | 8.70% | 新增 |
| 联讯证券 | 2 | 1,869,115,882.83 | 17.45% | 769,193.92 | 9.74% | 新增 |
| 信达证券 | 2 | 1,360,677,705.87 | 12.70% | 968,309.54 | 12.26% | 新增 |
| 国金证券 | 1 | 188,148,555.08 | 1.76% | 133,660.96 | 1.69% | 新增 |

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

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

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本基金合同于 2015 年 03 月 27 日正式生效，本期新增招商证券、国联证券、川财证券、西南证券、东兴证券、山西证券、国金证券各一个交易单元，以及中信建投证券、国都证券、联讯证券、信达证券各两个交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 招商证券 | - | - | 1,700,000,000.00 | 3.20% | - | - |

| | | | | | | |
|--------|------------|--------|-------------------|--------|---|---|
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | 806,200.00 | 53.65% | 1,590,000,000.00 | 3.00% | - | - |
| 川财证券 | - | - | 1,660,300,000.00 | 3.13% | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | 21,297,700,000.00 | 40.14% | - | - |
| 山西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国都证券 | - | - | - | - | - | - |
| 联讯证券 | 696,592.13 | 46.35% | 13,541,600,000.00 | 25.52% | - | - |
| 信达证券 | - | - | 6,768,900,000.00 | 12.76% | - | - |
| 国金证券 | - | - | 6,500,000,000.00 | 12.25% | - | - |

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

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

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本基金合同于 2015 年 03 月 27 日正式生效，本期新增招商证券、国联证券、川财证券、西南证券、东兴证券、山西证券、国金证券各一个交易单元，以及中信建投证券、国都证券、联讯证券、信达证券各两个交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---------------------------------|----------------|----------------|
| 1 | 北信瑞丰健康生活主题灵活配置 混合型证券投资基金基金合同 | 中国证券报、证券 时报 | 2015 年 3 月 3 日 |
| 2 | 北信瑞丰健康生活主题灵活配置 | 中国证券报、证券 | 2015 年 3 月 3 日 |

| | | | |
|----|---|----------------|-----------------|
| | 混合型证券投资基金托管协议 | 时报 | |
| 3 | 北信瑞丰健康生活主题灵活配置 混合型证券投资基金招募说明书 | 中国证券报、证券 时报 | 2015 年 3 月 3 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发售公告 | 中国证券报、证券 时报 | 2015 年 3 月 3 日 |
| 5 | 关于增加东兴证券股份有限公司 为基金销售机构的公告 | 中国证券报、证券 时报 | 2015 年 3 月 9 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新增代销机 构公告 | 中国证券报、证券 时报 | 2015 年 3 月 9 日 |
| 7 | 北信瑞丰基金管理有限公司关于 增加华融证券股份有限公司为基 金销售机构的公告 | 中国证券报、证券 时报 | 2015 年 3 月 23 日 |
| 8 | 北信瑞丰基金管理有限公司关于 增加华宝证券有限责任公司为基 金销售机构的公告 | 中国证券报、证券 时报 | 2015 年 3 月 26 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合同生 效公告 | 中国证券报、证券 时报 | 2015 年 3 月 29 日 |
| 10 | 北信瑞丰基金管理有限公司关于 广州证券股份有限公司推出基金 申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、证券 时报 | 2015 年 4 月 30 日 |
| 11 | 北信瑞丰基金管理有限公司关于 增加西南证券股份有限公司为基 金销售机构公告 | 中国证券报、证券 时报 | 2015 年 5 月 20 日 |
| 12 | 北信瑞丰健康生活主题灵活配置 混合型证券投资基金开放日常申 购、赎回、转换和定期定额投资 业务的公告 | 中国证券报、证券 时报 | 2015 年 6 月 17 日 |

| | | | |
|----|--|------------|-----------------|
| 13 | 北信瑞丰基金管理有限公司关于天天基金网推出基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、证券时报 | 2015 年 6 月 24 日 |
| 14 | 天天基金申购费率打折公告(健康与平安) | 中国证券报、证券时报 | 2015 年 6 月 30 日 |
| 15 | 北信瑞丰基金管理有限公司关于国都证券打折公告 | 中国证券报、证券时报 | 2015 年 7 月 6 日 |
| 16 | 北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第二季度报告 | 中国证券报、证券时报 | 2015 年 7 月 22 日 |
| 17 | 北信瑞丰基金基金转换业务公告 | 中国证券报、证券时报 | 2015 年 7 月 27 日 |
| 18 | 北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加数米基金网费率优惠活动的公告 | 中国证券报、证券时报 | 2015 年 8 月 12 日 |
| 19 | 北信瑞丰基金管理有限公司关于增加北京钱景财富投资管理有限公司为基金销售机构及同时推出申购费率优惠活动公告 | 中国证券报、证券时报 | 2015 年 8 月 24 日 |
| 20 | 北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金 2015 年半年度报告摘要 | 中国证券报、证券时报 | 2015 年 8 月 28 日 |
| 21 | 北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金 2015 年半年度报告 | 中国证券报、证券时报 | 2015 年 8 月 28 日 |
| 22 | 北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华宝证券有限责任公司费率优惠活动的公告 | 中国证券报、证券时报 | 2015 年 9 月 14 日 |
| 23 | 北信瑞丰基金管理有限公司关于 | 中国证券报、证券时报 | 2015 年 9 月 25 日 |

| | | | |
|----|--|------------|------------------|
| | 增加上海陆金所资产管理有限公司为基金代销机构及同时推出申购费率优惠活动公告 | 时报 | |
| 24 | 北信瑞丰基金管理有限公司关于参加天天基金定投优惠费率公告 | 中国证券报、证券时报 | 2015 年 9 月 26 日 |
| 25 | 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 | 2015 年 10 月 8 日 |
| 26 | 北信瑞丰基金管理有限公司关于变更基金直销账户的公告 | 中国证券报、证券时报 | 2015 年 10 月 16 日 |
| 27 | 北信瑞丰基金管理有限公司关于增加大泰金石投资管理有限公司为基金销售机构及同时推出申购费率优惠活动公告 | 中国证券报、证券时报 | 2015 年 10 月 16 日 |
| 28 | 关于增加诺亚正行（上海）基金投资顾问有限公司为基金销售机构及同时推出费率优惠活动公告 | 中国证券报、证券时报 | 2015 年 10 月 16 日 |
| 29 | 北信瑞丰基金管理有限公司关于在北京银行股份有限公司开展定投业务的公告 | 中国证券报、证券时报 | 2015 年 10 月 17 日 |
| 30 | 北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 3 季度报告 | 中国证券报、证券时报 | 2015 年 10 月 27 日 |
| 31 | 北信瑞丰基金管理有限公司关于增加中经北证（北京）资产管理有限公司为基金代销机构公告 | 中国证券报、证券时报 | 2015 年 10 月 28 日 |
| 32 | 北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新（2015 年第 1 号）定稿 | 中国证券报、证券时报 | 2015 年 11 月 9 日 |

| | | | |
|----|---|----------------|------------------|
| 33 | 北信瑞丰健康生活主题灵活配置 混合型证券投资基金招募说明书 (更新)摘要 | 中国证券报、证券 时报 | 2015 年 11 月 9 日 |
| 34 | 北信瑞丰基金管理有限公司关于 变更基金直销账户的公告 | 中国证券报、证券 时报 | 2015 年 11 月 23 日 |
| 35 | 关于旗下部分基金参加同花顺基 金销售有限公司申购及定期定额 投资费率优惠活动的公告 | 中国证券报、证券 时报 | 2015 年 11 月 30 日 |
| 36 | 北信瑞丰基金管理有限公司关于 参加中国工商银行股份有限公司 定投费率优惠活动的公告 | 中国证券报、证券 时报 | 2015 年 12 月 28 日 |

§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

北京市海淀区首体南路 9 号主语国际 4 号楼 3 层

12.3 查阅方式

网站：<http://www.bxrfund.com>

北信瑞丰基金管理有限公司
2016 年 3 月 30 日