

# 北信瑞丰中国智造主题灵活配置混合型证 券投资基金 2016 年半年度报告摘要

2016 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 26 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 22 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自基金合同生效日 2016 年 1 月 27 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	北信瑞丰中国智造主题
基金主代码	001829
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 1 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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	98,995,761.25 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，重点投资于受益于中国制造业升级的上市公司，包括机械设备、电气设备、信息设备、国防军工等装备制造业，以及食品饮料、医药、汽车家电等消费品制造业。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，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		北信瑞丰基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱彦	田青
	联系电话	010-68619390	010-67595096
	电子邮箱	service@bxrfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4000617297	95533
传真		010-68619300	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bxrfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

## §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(2016年1月27日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	7,099,058.24
本期利润	6,323,880.55
加权平均基金份额本期利润	0.0462
本期基金份额净值增长率	6.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0583
期末基金资产净值	105,176,758.44
期末基金份额净值	1.062

注：1、本基金基金合同自 2016 年 01 月 27 日起生效，至 2016 年 6 月 30 日未满六个月；

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

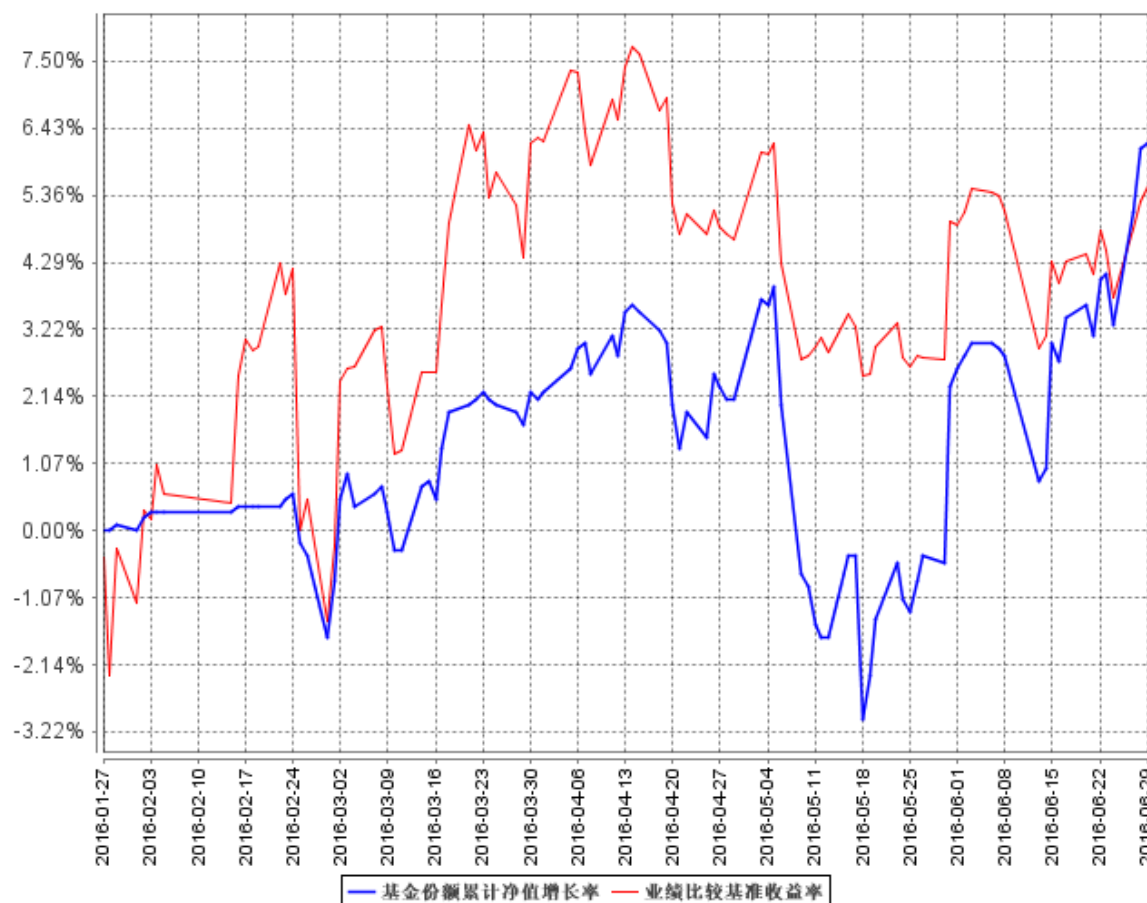
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.81%	0.84%	0.59%	0.68%	3.22%	0.16%

过去三个月	4.02%	0.92%	-0.67%	0.71%	4.69%	0.21%
自基金合同生效起至今	6.20%	0.76%	5.56%	0.94%	0.64%	-0.18%

注：本基金的业绩比较基准为中证 800 指数收益率×60% + 中证综合债券指数收益率×40%。中证 800 指数是由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场统一指数，它的样本选自沪深两个证券市场。中证 800 指数成分股覆盖了中证 500 和沪深 300 的所有成分股，综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况，具有一定权威性，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。中证综合债券指数是一个是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。

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

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 2016 年 01 月 27 日起生效，至 2016 年 6 月 30 日未满六个月。

## §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 月初，是经中国证监会证监许可[2014]265 号文批准，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的基金公司。公司注册资本 17,000 万人民币，总部设在北京，是一家从事基金募集、基金销售、资产管理以及中国证监会许可的其他业务的专业资产管理公司。

北信瑞丰基金着力打造具有高水平的投研团队，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，拥有丰富的管理和证券投资实战经验。公司秉承价值投资理念和勤勉尽责的职业道德，严守风险控制底线，遵循份额持有人利益优先、最大化原则，制定了严格的投资管理流程和制度。公司将注重开发权益类、固定收益类和资产配置类等特定资产管理产品，着眼于塑造“诚信、专业、稳健、创新”的行业品牌形象，力争为投资人创造持续良好的投资回报。北信瑞丰追求北京信托所恪守的“受人之托、代人理财”承诺，推崇“简洁、快速、有效”的经营管理理念，倡导“勤奋、坚韧”的企业文化，秉承投资人价值最大化的经营宗旨，坚持以专业的态度服务于投资者，为把公司打造成“投资者值得信任的投资平台、投资者丰盈财富的资管机构”而努力奋斗！

北信瑞丰基金旗下目前管理 11 只开放式基金产品，分别为北信瑞丰稳定收益债券型证券投资基金、北信瑞丰宜投宝货币市场基金、北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、北信瑞丰现金添利货币市场基金、北信瑞丰健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金、北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金、北信瑞丰新成长主题灵活配置混合型证券投资基金、北信瑞丰中国智造主题灵活配置混合型证券投资基金、北信瑞丰稳定增强偏债混合型证券投资基金、北信瑞丰外延增长主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金。

#### 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		
高峰	副总经理	2016 年 1 月 27 日	-	16	北京大学光华管理学院国民经济管理硕士，21 年金融从业经验，16 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。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《北信瑞丰中国智造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的规定，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，没有损害基金持有人利益。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，公司严格执行《公司公平交易管理办法》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、特定客户资产管理组合等。具体如下：

在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

### 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

2016 年的上半年，在新年第一周的暴跌之后，对经济基本面继续下行和外围环境的担忧一直笼罩在市场之上，市场总体呈现底部震荡的格局。上证综指、中证 500 以及创业板指数等各风格指数均出现下跌，跌幅大致在 17% 到 20% 之间，风格差异并不显著。行业表现上看，上半年煤炭、交运等受益供给侧改革的周期性行业表现较强，食品饮料、医药等业绩稳健成长、估值较低的行业也显著跑赢大盘，6 月份计算机、电子等超跌又有新的炒作题材的行业反弹也非常明显。由于本基金今年初刚刚成立，初期运作我们采取了相对稳健的策略，控制股票投资比例，在市场波动中精选符合本基金投资目标的个股逐步建仓，得益于市场总体保持平稳，上半年的业绩略优于比较基准的表现。

本基金是制造业升级主题基金，主要投资目标是有关智能制造、制造业升级相关机械、装备、控制系统、信息系统等的公司，主要集中在电子通信、军工机械、计算机等行业，这几个行业在年初下跌幅度较大，但在二季度的市场反弹中先后都有比较好的表现，虽然距去年的高位都还比较遥远，但总体估值的绝对水平确并不便宜。我们将坚持本基金的一贯策略，在市场调整中选择估值已处于合理期间，有明确业绩增长预期或外延成长预期的装备制造行业公司，以及估值合理的、进口替代确定性强，成长空间大的电子通信类公司进行投资，同时也会根据市场情绪波动和关注热点的变化把握一些波段机会。

#### 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 6.2%，波动率 0.76%，业绩比较基准收益率 5.56%，波动率 0.94%。



#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一直以来，我们对中国经济的长期增长都持有乐观判断，中国经济增长的内生动力非常强，现有技术和人口约束下的空间仍很大，现在的问题是转型过程中必然会遇到的问题，GDP 增速的下降并不可怕，甚至不是坏事。但是这些都有一个前提，那就是坚持以经济发展和改善人民生活水平为中心，坚持市场经济的基本制度和理念，由市场决定资源初次配置，政府从社会公平的角度参与收入的再分配。在这些方面到目前还没看到改变我们乐观判断的理由。

具体到 2016 年的下半年，我们判断短期经济增速大概率不会进一步下滑，年初以来刺激投资的系列政策将逐步发挥对经济的托底作用，物价仍会在低位保持平稳，流动性相对充裕，这些都意味着股票市场将迎来较好的环境。但 A 股市场的最大问题并不在宏观方面，而是估值结构的极度扭曲。以上证 50 和沪深 300 指数为代表的大盘蓝筹股估值基本处于历史最低，在国际范围内也处于较低水平，而一些小市值、主营业务长期微利或亏损，在行业中没有任何竞争优势的企业（所谓壳公司），计算机、电子等热门主题或行业的一些企业以及新上市公司的估值高高在上，显著高于历史平均水平，更远远高于成熟市场可比公司的估值。这种估值结构的扭曲根本原因在于投资者结构、投资者盈利预期和由此而带来的短期行为，如果投资于股票市场，每年的预期收益率在 10%到 20%之间，是完全可以投资企业的正常经营达到的、可以持续的，但如果投资者都希望在很短时间内赚取 30%或者更高的收益，常识告诉我们已经不可能通过企业正常经营带来的利润而得到了，只能去短期炒作各种题材，也就是从其他投资者身上赚钱。而 A 股市场还是一个供给管制的市场，个人投资者又占很大比例，各种媒体，甚至研究机构都会推荐脱离基本面炒作的股票，结果就是股价炒得再高，估值再荒谬，最后都会找到接盘者，造成了游资炒作的有恃无恐。不过这种现象一定是无法长期维持的，随注册制推进、退市制度趋严，估值体系一定会逐步回归到正常状态，不确定的因素在于估值回归的路径，以及过高估值股票价值回归过程中会不会给市场带来系统性的风险，这些都需要密切观察。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策；对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督；对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总经理、督察长、投资总监、研究总监、风险管理总监、运营总监及监察稽核总监组成。

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

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

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

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金和理财类基金）。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

注：无

## **§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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

# §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：北信瑞丰中国智造主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2016年6月30日
<b>资产：</b>	
银行存款	8,987,273.22
结算备付金	1,057,141.73
存出保证金	80,005.38
交易性金融资产	50,470,523.34
其中：股票投资	50,470,523.34
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	-
买入返售金融资产	49,000,000.00
应收证券清算款	2,901,245.83
应收利息	13,777.99
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	112,509,967.49
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>

	2016 年 6 月 30 日
<b>负 债：</b>	
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	-
应付证券清算款	2,616,488.54
应付赎回款	3,966,786.88
应付管理人报酬	138,237.26
应付托管费	23,039.53
应付销售服务费	-
应付交易费用	463,983.34
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	124,673.50
负债合计	7,333,209.05
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	98,995,761.25
未分配利润	6,180,997.19
所有者权益合计	105,176,758.44
负债和所有者权益总计	112,509,967.49

注：1、本基金本期末总份额 98,995,761.25 份，份额净值 1.062 元。

2、本基金基金合同自 2016 年 01 月 27 日起生效，至 2016 年 6 月 30 日未满六个月。

## 6.2 利润表

会计主体：北信瑞丰中国智造主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期
	2016 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	8,226,924.99
1.利息收入	788,801.19
其中：存款利息收入	127,625.65
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	661,175.54
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	7,815,324.76
其中：股票投资收益	7,445,680.75

基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	369,644.01
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-775,177.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	397,976.73
<b>减：二、费用</b>	<b>1,903,044.44</b>
1. 管理人报酬	893,656.68
2. 托管费	148,942.73
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	735,437.71
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	125,007.32
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>6,323,880.55</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>6,323,880.55</b>

注：本基金基金合同自 2016 年 01 月 27 日起生效，无上年度可比较期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：北信瑞丰中国智造主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	209,529,950.98	-	209,529,950.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,323,880.55	6,323,880.55
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）	-110,534,189.73	-142,883.36	-110,677,073.09

其中：1.基金申购款	942,582.48	16,963.08	959,545.56
2.基金赎回款	-111,476,772.21	-159,846.44	-111,636,618.65
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）	98,995,761.25	6,180,997.19	105,176,758.44

注：本基金基金合同自 2016 年 01 月 27 日起生效，无上年度可比较期间。

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：

<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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

北信瑞丰中国智造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 1953 号《关于准予北信瑞丰中国智造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《北信瑞丰中国智造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。本基金募集期限自 2015 年 12 月 14 日至 2016 年 1 月 22 日止。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 209,435,722.83 元，业经中喜会计师事务所（特殊普通合伙）中喜验字(2016)第 0034 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《北信瑞丰中国智造主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 1 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 209,529,950.98 份基金份额，其中认购资金利息折合 94,228.15 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《北信瑞丰中国智造主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、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。股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，80%以上的非现金基金资产投资于中国智造主题的上市

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%；本基金投资于其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以基金持续经营为基础编制，执行财政部 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则和中国证券业协会 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》。中国证监会 2010 年 2 月 8 日颁布的证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日止期间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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 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 2016 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款、应收款项。除与权证投资有关的金融资产外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示；与权证投资有关的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

本基金持有的股票投资、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。

本基金持有的各类应收款项等在活跃市场没有报价、回收金额固定或可以确定的非衍生金融

资产分类为贷款与应收款项。

#### (2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。除与权证投资有关的金融负债外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示，与权证投资有关的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

本基金目前持有的金融负债全部为其他金融负债，包括各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 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。

#### 6.4.4.5 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。

#### **6.4.4.6 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。

#### **6.4.4.7 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。

#### **6.4.4.8 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)。

#### **6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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。

#### 6.4.4.11 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。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 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，若出现重大事项停牌等情况，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、市盈率法等估值技术进行估值。

## 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

本报告期内本基金无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内本基金无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本基金无差错更正。

## 6.4.6 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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

注：本报告期，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。

### 6.4.7.2 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	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
北京国际信托有限公司	基金管理人的控股股东
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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 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。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月27日(基金合同生效日)至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	893,656.68	-
其中：支付销售机构的客户维护费	259,886.41	-

注：1、本基金基金合同自 2016 年 1 月 27 日起生效，无上年度可比较期间。

2、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。

3、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。

**6.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月27日(基金合同生效日) 至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	148,942.73	-

注：1、本基金基金合同自 2016 年 1 月 27 日起生效，无上年度可比较期间。

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

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

**6.4.8.2.3 销售服务费**

注：本基金无销售服务费。

**6.4.8.3 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。

**6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

注：本基金本报告期未发生管理人运用自有资金投资本基金的情况。

**6.4.8.4.2 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**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总份 额的比例
北京国际信托有限公司	50,011,500.00	50.52%	-	-
中国建设银行股份有限公司	0.00	0.00%		

注：本基金基金合同自 2016 年 01 月 27 日起生效，至 2016 年 6 月 30 日未滿六个月。

**6.4.8.5 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 2016年1月27日(基金合同生效日) 至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
中国建设银行股份有限公司	8,987,273.22	87,306.03	-	-

注：1、本基金基金合同自2016年01月27日起生效，无上年度可比较期间。

2、本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按约定利率计息。

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.9.1 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	可流通日	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
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	955	8,107.95	8,107.95	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	751	7,547.55	7,547.55	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

注：本基金截至2016年06月30日止持有以上因新股流通限售而尚未上市流通的股票，该类股票将在经交易所批准后上市流通。

**6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002316	键桥通讯	2016年5月	重大资产重组	13.88	-	-	168,100	2,313,021.00	2,333,228.00	-

		25 日								
002686	亿利达	2016 年 4 月 20 日	重大资产重组	13.54	2016 年 7 月 14 日	14.89	100,000	1,215,702.03	1,354,000.00	-

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金期末未持有银行间市场债券正回购。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金期末未持有银行间市场债券正回购。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 46,762,008.04 元，属于第二层次的余额为 3,708,515.30，无属于第三层次的余额。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

本基金本期及上年度可比期间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。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 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	50,470,523.34	44.86
	其中：股票	50,470,523.34	44.86
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	49,000,000.00	43.55
	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	10,044,414.95	8.93
7	其他各项资产	2,995,029.20	2.66
8	合计	112,509,967.49	100.00

注：由于四舍五入的原因报告期末基金资产组合各项目公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-



C	制造业	45,608,501.46	43.36
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	-	-
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	4,847,667.10	4.61
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	14,354.78	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	50,470,523.34	47.99

注：以上行业分类以 2016 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末无沪港通股票投资。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000100	TCL 集团	2,700,000	8,883,000.00	8.45
2	000678	襄阳轴承	550,034	4,345,268.60	4.13
3	000158	常山股份	300,000	4,167,000.00	3.96
4	002316	键桥通讯	168,100	2,333,228.00	2.22
5	000063	中兴通讯	160,000	2,294,400.00	2.18
6	600399	抚顺特钢	345,000	2,232,150.00	2.12
7	002625	龙生股份	50,000	2,199,000.00	2.09
8	601600	中国铝业	570,000	2,148,900.00	2.04

9	000800	一汽轿车	190,000	2,067,200.00	1.97
10	000927	一汽夏利	390,000	2,063,100.00	1.96

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站

www.bxrfund.com 的年度报告正文。

## 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	000697	炼石有色	12,841,321.00	12.21
2	600410	华胜天成	11,988,264.00	11.40
3	600862	中航高科	11,204,841.23	10.65
4	002117	东港股份	10,854,823.00	10.32
5	000678	襄阳轴承	10,453,708.96	9.94
6	000100	TCL 集团	10,342,406.00	9.83
7	000158	常山股份	10,145,573.00	9.65
8	300212	易华录	8,958,801.00	8.52
9	000922	佳电股份	7,973,652.07	7.58
10	000748	长城信息	7,481,498.00	7.11
11	002367	康力电梯	7,471,081.70	7.10
12	002625	龙生股份	6,526,920.00	6.21
13	002014	永新股份	6,525,019.60	6.20
14	300442	普丽盛	6,412,100.00	6.10
15	600884	杉杉股份	6,144,244.00	5.84
16	002093	国脉科技	5,664,105.54	5.39
17	600881	亚泰集团	5,549,889.00	5.28
18	002431	棕榈股份	5,296,847.00	5.04
19	600721	*ST 百花	5,227,998.00	4.97
20	600719	大连热电	5,131,626.00	4.88
21	000938	紫光股份	5,125,681.41	4.87
22	002316	键桥通讯	5,090,848.98	4.84
23	300182	捷成股份	4,796,000.00	4.56
24	600850	华东电脑	4,473,400.00	4.25
25	002008	大族激光	4,441,660.10	4.22
26	600038	中直股份	4,357,740.00	4.14

27	002364	中恒电气	4,169,500.00	3.96
28	300409	道氏技术	4,118,085.00	3.92
29	300207	欣旺达	4,089,360.00	3.89
30	000768	中航飞机	4,009,637.11	3.81
31	600372	中航电子	3,958,945.00	3.76
32	000066	长城电脑	3,944,385.46	3.75
33	600847	万里股份	3,689,044.00	3.51
34	600399	抚顺特钢	3,601,785.00	3.42
35	300017	网宿科技	3,508,200.00	3.34
36	002537	海立美达	3,228,387.00	3.07
37	600703	三安光电	3,127,600.00	2.97
38	002185	华天科技	3,054,730.00	2.90
39	600198	大唐电信	2,717,500.00	2.58
40	000063	中兴通讯	2,446,400.00	2.33
41	002686	亿利达	2,329,677.00	2.22
42	600563	法拉电子	2,326,914.38	2.21
43	600171	上海贝岭	2,291,580.00	2.18
44	601600	中国铝业	2,162,000.00	2.06
45	300124	汇川技术	2,161,550.00	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。

#### 7.4.2 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	000697	炼石有色	13,057,869.75	12.42
2	600862	中航高科	11,753,146.00	11.17
3	600410	华胜天成	10,632,131.03	10.11
4	300212	易华录	9,386,569.40	8.92
5	002117	东港股份	9,087,959.00	8.64
6	000922	佳电股份	8,807,587.48	8.37
7	002367	康力电梯	7,864,033.66	7.48
8	000748	长城信息	7,654,890.00	7.28
9	000158	常山股份	6,659,017.64	6.33
10	600884	杉杉股份	6,370,458.00	6.06
11	000678	襄阳轴承	6,153,662.02	5.85
12	300442	普丽盛	5,936,532.06	5.64

13	002093	国脉科技	5,840,770.00	5.55
14	600719	大连热电	5,724,730.00	5.44
15	002014	永新股份	5,674,389.88	5.40
16	600881	亚泰集团	5,489,000.00	5.22
17	002431	棕榈股份	5,447,000.00	5.18
18	600721	*ST 百花	5,412,440.00	5.15
19	600850	华东电脑	4,809,202.00	4.57
20	000938	紫光股份	4,635,301.00	4.41
21	600038	中直股份	4,583,010.00	4.36
22	002625	龙生股份	4,451,701.00	4.23
23	000768	中航飞机	4,160,131.00	3.96
24	300409	道氏技术	4,058,791.00	3.86
25	300207	欣旺达	4,004,233.30	3.81
26	300182	捷成股份	3,965,108.00	3.77
27	000066	长城电脑	3,872,850.00	3.68
28	300017	网宿科技	3,652,675.00	3.47
29	002537	海立美达	3,439,500.00	3.27
30	002185	华天科技	3,179,200.00	3.02
31	600847	万里股份	3,135,700.00	2.98
32	002316	键桥通讯	2,936,000.00	2.79
33	002008	大族激光	2,840,400.00	2.70
34	600198	大唐电信	2,751,600.00	2.62
35	600372	中航电子	2,674,462.00	2.54
36	600563	法拉电子	2,567,000.00	2.44
37	600171	上海贝岭	2,336,120.00	2.22
38	002364	中恒电气	2,308,500.00	2.19

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	271,058,209.09
卖出股票收入（成交）总额	227,258,188.81

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本期末未持有债券。

## **7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

注：本基金本期末未持有债券。

## **7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## **7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## **7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

## **7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

### **7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：（1）本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金本报告期内未进行股指期货交易。

### **7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

注：本基金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**

注：本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

### **7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：（1）本基金本报告期末未持有国债期货。

（2）本基金本报告期内未进行国债期货交易。

### **7.11.3 本期国债期货投资评价**

注：本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

## 7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金所投资的前十名股票没有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	80,005.38
2	应收证券清算款	2,901,245.83
3	应收股利	-
4	应收利息	13,777.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,995,029.20

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金不存在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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002316	键桥通讯	2,333,228.00	2.22	筹划重大资产重组

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

## §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
820	120,726.54	50,011,500.00	50.52%	48,984,261.25	49.48%

## 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	19,907.38	0.02%

## 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期间的情况

项目	持有基金份额总量的数量期间（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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年1月27日）基金份额总额	209,529,950.98
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	942,582.48
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	111,476,772.21
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	98,995,761.25

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

基金管理人：张洪水先生因个人原因自 2016 年 6 月 2 日起不再担任公司督察长职务，张洪水先生离任后，暂由总经理朱彦先生代为履行督察长职务直至新聘任督察长入职。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期基金投资策略未发生改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	2	491,995,554.08	98.75%	458,195.34	98.75%	新增
华融证券	2	6,214,987.00	1.25%	5,788.00	1.25%	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本报告期内，本基金新增银河证券、华融证券各 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**

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
银河证券	-	-	5,411,000,000.00	98.98%	-	-
华融证券	-	-	55,900,000.00	1.02%	-	-

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，本基金新增银河证券、华融证券各 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。

北信瑞丰基金管理有限公司  
2016 年 8 月 26 日