

北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资
基金
2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 25 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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。

本报告期自 2017 年 2 月 20 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	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.....	10
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.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	11
§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.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15

§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
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.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
§9 开放式基金份额变动	47
§10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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.....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51

§12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金
基金简称	北信瑞丰增强回报
基金主代码	004165
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年2月20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	550,792,741.36份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金封闭期与开放期采取不同的投资策略。在封闭期内，主要以资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略等为主。在开放期内，本基金将充分保障开放期的流动性需求，主要投资高流动性的资产，在此基础上追求基金的长期稳定增值。本基金为偏债混合型基金，在债券投资的基础上，通过将部分资金投资于权益类资产争取增强回报。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险与预期收益低于股票型基金，高于货币市场基金和债券型基金，属于证券投资基金中的较高风险收益品种。

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	郭亚	郭明
	联系电话	010-68619390	010-66105799

电子邮箱	service@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	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bxrfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	北信瑞丰基金管理有限公司	北京市海淀区首体南路 9 号主语国际 4 号楼 3 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 2 月 20 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,497,395.87
本期利润	6,918,932.29
加权平均基金份额本期利润	0.0126
本期加权平均净值利润率	1.25%
本期基金份额净值增长率	1.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	3,497,395.87
期末可供分配基金份额利润	0.0064
期末基金资产净值	557,711,673.65
期末基金份额净值	1.0126
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	1.26%

注：1、本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，至 2017 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

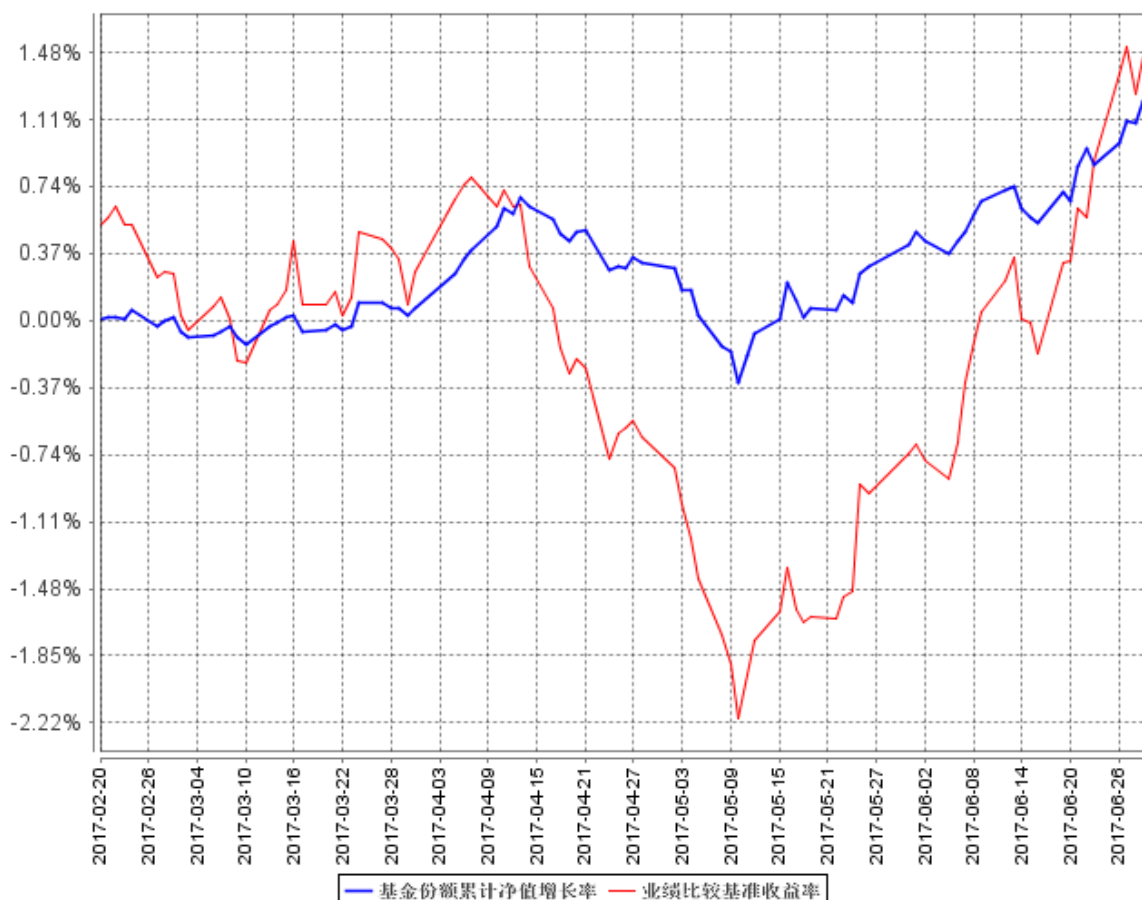
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.84%	0.09%	2.14%	0.22%	-1.30%	-0.13%
过去三个月	1.19%	0.10%	1.12%	0.23%	0.07%	-0.13%
自基金合同生效起至今	1.26%	0.08%	1.39%	0.21%	-0.13%	-0.13%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%。中债综合指数是中央国债登记结算有限责任公司发布的，样本债券涵盖的范围十分全面的债券指数。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。沪深 300 指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。

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：本基金基金合同于 2017 年 2 月 20 日生效，截止报告期末未满六个月，基金成立当年净值增长率以实际存续期计算。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

北信瑞丰基金管理有限公司成立于 2014 年 3 月 17 日，是经中国证监会批准，由北京国际信托有限公司与莱州瑞海投资有限公司两家股东共同发起设立。公司结合基金行业特点改善公司治理结构，积极推进股权激励，并在专户业务及子公司各业务条线进行事业部制改革。北信瑞丰基金着力打造具有高水准的投研团队，公司高管和主要投资管理人员的金融相关从业年限均在 10 年以上，拥有丰富的管理经验和证券投资实战经验。

截至报告期末，公司共成立 14 只公募产品，保有 134 只专户产品，资产管理规模超过 360 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		
郑猛	基金经理	2017 年 2 月 20 日	-	7	CFA、FRM 持证人，南开大学理学学士，北京大学工程硕士。2010 年 7 月至 2012 年 8 月在国家开发银行天津市分行，任一级业务员（副科级）；2012 年 9 月至 2014 年 10 月在国网英大保险资产管理公司（原英大财险投资部），担任固定收益投资经理；2014 年 11 月至 2016 年 8 月，在中国工商银行总行，资产管理部固定收益处，担任投资经理。现任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理。
于军华	基金经理	2017 年 2 月 20 日	-	7	中国人民大学世界经济学硕士毕业。 原国家信息中心经济咨询中心汽车行业高级项目分析师，宏源证券研究所汽车行业分析师，擅长公司基本面分析，2014 年 4 月加入北信瑞丰基金管理有限公司投资研究部，负责权益类产品的研究。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤

勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了

《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《北信瑞丰基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年，债券收益率整体上行，主要是因为国内供给侧改革和去杠杆背景下，货币政策偏紧，国内经济数据向好，美联储加息等原因。而股市震荡走势，漂亮 50 行情，其中的波动主要受到了监管的变化和央行的货币政策。中国经济基本面短期向好，通胀温和。受监管影响，社融有所下降，M2 持续走低。房地产销售面积下行，但房地产投资仍在高位。美国经济低于预期，美元指数下跌，人民币汇率开始趋于稳定。整体来看，上半年 1 年左右的信用债表现较好，转债随着股市反弹表现也不错，长端利率债波动较大，收益为负。操作方面，上半年合理控制了债券组合久期，以及打新的股票底仓比例；并在市场波动中寻求波段交易的机会，保障组合的流动性和收益率的稳定性。

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 1.0126 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.26%，业绩比较基准收益率为 1.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债市方面，展望 2017 年下半年，美国还处在加息周期，年底开始进行缩表，中国的供给侧改革和去杠杆压力依然存在，尤其是金融工作会议之后，未来还需关注监管细则的进一步出台，但现在利率债绝对收益水平偏高，经济增长逐渐趋缓，央行继续实行稳健货币政策，基本确认 5 月份利率为年内高点，未来无风险利率可能还会震荡式小幅下行。期限利差方面，无风险收益率曲线开始倒挂，但回归常态是大概率事件，未来无论是牛陡还是熊陡，短端的风险收益比显然更高。信用利差方面，随着委外赎回和监管穿透带来的流动性溢价，低等级信用利差上行的幅度

会更大,我们更看好高等级信用债。行业利差或券种方面,短期看好过剩产能因为供给侧改革带来的业绩改善,长期更看好城投的风险能够穿越周期,同时也需要尽可能规避民企带来的黑天鹅事件。

股市方面,展望后市,短期谨慎、中长期乐观是我们的基本判断,三季度市场可能震荡筑底。对于经济形势,我们一贯对中国经济的长期增长持有的乐观判断,中国经济增长的内生动力非常强,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。16 年底以来,货币政策转向偏紧,利率上行,市场流动性约束下,存量博弈和监管导向导致二八分化,一线蓝筹出现估值溢价,预计三季度金融监管对流动性影响有所缓和,市场估值比较将导致行情向二线蓝筹和优质成长股扩散。随着十九大的逐步临近,市场在改革等方面预期会升温。

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。

4.7 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。

§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增强回报定期开放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,北信瑞丰增强回报定期开放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增强回报定期开放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。

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增强回报定期开放混合型证券投资基金 2017 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	2,088,471.42
结算备付金		500,779.63
存出保证金		57,694.15
交易性金融资产	6.4.7.2	623,617,569.54
其中：股票投资		71,354,347.54
基金投资		-
债券投资		552,263,222.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		38,280.51
应收利息	6.4.7.5	10,286,615.66
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		636,589,410.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 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		77,980,687.53
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		273,484.72
应付托管费		68,371.20
应付销售服务费		273,484.72
应付交易费用	6.4.7.7	140,686.88
应交税费		-
应付利息		20,418.37
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	120,603.84
负债合计		78,877,737.26
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	550,792,741.36
未分配利润	6.4.7.10	6,918,932.29
所有者权益合计		557,711,673.65
负债和所有者权益总计		636,589,410.91

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0126 元，基金份额总额 550,792,741.36 份。

2、本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，至 2017 年 6 月 30 日未满六个月。

6.2 利润表

会计主体：北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 2 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 2 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		11,688,533.99
1.利息收入		9,472,656.75
其中：存款利息收入	6.4.7.11	904,888.98
债券利息收入		7,756,607.48
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		811,160.29
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,205,659.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,813,087.70
基金投资收益		-

债券投资收益	6.4.7.13	-261,435.22
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	868,863.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,421,536.42
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-
减：二、费用		4,769,601.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,180,198.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	295,049.69
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,180,198.58
4. 交易费用	6.4.7.19	199,963.58
5. 利息支出		1,789,103.04
其中：卖出回购金融资产支出		1,789,103.04
6. 其他费用	6.4.7.20	125,088.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,918,932.29
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,918,932.29

注：本基金成立于 2017 年 02 月 20 日，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：北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 2 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 2 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	550,792,741.36	-	550,792,741.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,918,932.29	6,918,932.29
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)			
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	550,792,741.36	6,918,932.29	557,711,673.65

注：本基金成立于 2017 年 02 月 20 日，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：

_____ 朱彦 _____	_____ 朱彦 _____	_____ 孟曦 _____
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

北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]第 3043 号《关于准予北信瑞丰增强回报定期开放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《北信瑞丰增强回报定期开放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 550,358,431.00 元，业经中喜会计师事务所(特殊普通合伙)中喜验字(2017)第 0042 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 2 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 550,792,741.36 份基金份额，其中认购资金利息折合 434,310.36 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《北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要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）、权证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单等，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相关规定）。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-30%。开放期内，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%，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 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

本基金采用公历年度，即从每年 1 月 1 日至 12 月 31 日为一个会计期间。本基金本报告期为 2017 年 02 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 06 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

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）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。

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、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（1）具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；（2）交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

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。

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：

(1) 对于证券交易所上市的股票，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、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有

明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期内无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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) 自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收

入亦免征增值税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	2,088,471.42
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,088,471.42

注：本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，至 2017 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	67,110,471.91	71,354,347.54	4,243,875.63	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	81,612,864.80	80,525,622.00	-1,087,242.80
	银行间市场	471,472,696.41	471,737,600.00	264,903.59
	合计	553,085,561.21	552,263,222.00	-822,339.21
资产支持证券	-	-	-	

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	620,196,033.12	623,617,569.54	3,421,536.42

注：本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，至 2017 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末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

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,104.33
应收结算备付金利息	225.30
应收债券利息	10,285,260.03
其他	26.00
合计	10,286,615.66

注：本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，至 2017 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.7.6 其他资产

注：本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	129,978.65
银行间市场应付交易费用	10,708.23
合计	140,686.88

注：本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，至 2017 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
预提费用	120,603.84
合计	120,603.84

注：本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，至 2017 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年2月20日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	550,792,741.36	550,792,741.36
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	550,792,741.36	550,792,741.36

注：1、本基金基金合同自 2017 年 02 月 20 日起生效，至 2017 年 6 月 30 日未满六个月。

2、本基金自 2017 年 01 月 05 日至 2017 年 02 月 15 日期间公开募集，基金合同生效日的基金份额总额为 550,792,741.36 份基金份额，其中认购资金利息折合 434,310.36 份基金份额。

3、本基金以 1 年为一个封闭期，每个封闭期为自基金合同生效日（含）或每个开放期结束之日的次日（含）起至 1 年后的年度对日的前一日止的期间，在每个封闭期内本基金采取封闭运作的模式，基金份额持有人不得申请申购、赎回本基金。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,497,395.87	3,421,536.42	6,918,932.29
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,497,395.87	3,421,536.42	6,918,932.29

注：本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，至 2017 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年2月20日(基金合同生效日)至2017年 6月30日
活期存款利息收入	96,455.20
定期存款利息收入	788,263.89
结算备付金利息收入	19,961.18
其他	208.71
合计	904,888.98

注：本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，至 2017 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年2月20日(基金合同生效日)至 2017年6月30日
卖出股票成交总额	48,472,556.93
减：卖出股票成本总额	50,285,644.63
买卖股票差价收入	-1,813,087.70

注：本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，至 2017 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年2月20日(基金合同生效日)至2017年 6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	258,158,248.86
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	254,815,555.36
减：应收利息总额	3,604,128.72
买卖债券差价收入	-261,435.22

注：本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，至 2017 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资，无上年度可比期间。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期间无贵金属投资，无上年度可比期间。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期间无衍生工具投资，无上年度可比期间。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年2月20日(基金合同生效日)至2017年 6月30日
股票投资产生的股利收益	868,863.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	868,863.74

注：本基金基金合同自2017年2月20日起生效，至2017年6月30日未满六个月。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年2月20日(基金合同生效日)至 2017年6月30日
1. 交易性金融资产	3,421,536.42
——股票投资	4,243,875.63
——债券投资	-822,339.21
——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	3,421,536.42

注：本基金基金合同自2017年2月20日起生效，至2017年6月30日未满六个月。

6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年2月20日(基金合同生效日)至
----	----------------------------

	2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	193,708.58
银行间市场交易费用	6,255.00
合计	199,963.58

注：本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，至 2017 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 2 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
信息披露费	99,810.21
审计费用	20,793.63
汇划手续费	4,484.39
合计	125,088.23

注：本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，至 2017 年 6 月 30 日未满六个月。

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

注：截至资产负债表日本基金未存在或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《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[2016]140 号)，要求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，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56 号)，资管产品运营过程中发生增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，自 2018 年 1 月 1 日起施行。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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

6.4.9 关联方关系

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

注：本报告期，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	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
北京国际信托有限公司	基金管理人的股东
莱州瑞海投资有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易，无上年度可比期间。

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 2017年2月20日(基金合同生效日)至2017年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,180,198.58
其中：支付销售机构的客户维护费	884,973.48

注：1、本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，无上年度可比期间。

2、支付基金管理人北信瑞丰基金管理有限公司管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 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 0.60% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年2月20日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	295,049.69

注：1、本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，无上年度可比期间。

2、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 0.15% 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 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2017 年 2 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国工商银行股份有限公司	1,179,962.04
合计	1,179,962.04

注：1、本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，无上年度可比期间。

2、支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.60% 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：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 0.60% / 当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期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，无上年度可比期间。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金，无上年度可比期间。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末无除基金管理人之外其他关联方投资本基金的情况，无上年度可比期间。

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 2017 年 2 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	2,088,471.42	96,455.20

注：1、本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，无上年度可比期间。

2、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，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内未发生其他需要说明的关联交易事项，无上年度可比期间。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2017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	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
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	未上市	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	未上市	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	未上市	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	未上市	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

6.4.12.2 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
601088	中国神华	2017年6月5日	筹划重大事项	22.29	未知	未知	73,700	1,255,415.00	1,642,773.00	-
600050	中国联通	2017年4月5日	筹划重大事项	7.47	2017年8月21日	8.22	188,500	1,264,711.00	1,408,095.00	-
600795	国电电力	2017年6月5日	重大资产重组	3.60	未知	未知	381,200	1,266,512.00	1,372,320.00	-
601989	中国	2017年	重大资	6.21	未知	未知	165,000	1,262,155.00	1,024,650.00	-

	重工	5月31日	产重组							
000656	金科股份	2017年5月31日	重大资产重组	6.54	2017年7月5日	5.92	109,000	651,865.00	712,860.00	-
000100	TCL集团	2017年6月2日	筹划重大事项	3.43	2017年7月26日	3.72	117,800	414,707.00	404,054.00	-
000887	中鼎股份	2017年6月20日	重大资产重组	22.09	2017年7月14日	19.88	15,000	340,110.00	331,350.00	-
603501	韦尔股份	2017年6月5日	重大资产重组	20.15	未知	未知	1,657	11,632.14	33,388.55	-
000700	模塑科技	2017年6月28日	筹划重大事项	8.09	2017年8月16日	8.00	2,100	16,642.43	16,989.00	-

注：本基金截至 2017 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。

6.4.12.3 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

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 74,980,687.53 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
011767004	17大同煤矿SCP001	2017年7月7日	100.30	500,000	50,150,000.00
041754010	17鞍钢集CP001	2017年7月7日	100.50	273,000	27,436,500.00
合计				773,000	77,586,500.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,000,000.00 元，于 2017 年 7 月 5 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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。本基金通过积极灵活的资产配置，采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，重点投资于外延增长主题的上市公司，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。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构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。在定期存款和银行间同业市场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产品投资流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年6月30日
A-1	352,729,600.00
A-1 以下	-
未评级	-
合计	352,729,600.00

注：1、以上按短期信用评级的债券投资中不包括国债、政策性金融债及央行票据等。

2、本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，至 2017 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日
AAA	9,519,000.00
AAA 以下	190,014,622.00
未评级	-
合计	199,533,622.00

注：1、以上按长期信用评级的债券投资中不包括国债、政策性金融债及央行票据等。

2、本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，至 2017 年 6 月 30 日未满六个月。

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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金所持大部分证券在证券交易所上市和银行间同业市场交易，除 6.4.12 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。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资产的公允价值。

本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 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	2,088,471.42	-	-	-	-	-	2,088,471.42
结算备付金	500,779.63	-	-	-	-	-	500,779.63
存出保证	57,694.15	-	-	-	-	-	57,694.15

金							
交易性金融资产	20,090,000.00	70,192,000.00	331,068,600.00	130,912,622.00	-71,354,347.54	623,617,569.54	
应收证券清算款	-	-	-	-	38,280.51	38,280.51	
应收利息	-	-	-	-	-10,286,615.66	10,286,615.66	
资产总计	22,736,945.20	70,192,000.00	331,068,600.00	130,912,622.00	-81,679,243.71	636,589,410.91	
负债							
卖出回购金融资产款	77,980,687.53	-	-	-	-	77,980,687.53	
应付管理人报酬	-	-	-	-	273,484.72	273,484.72	
应付托管费	-	-	-	-	68,371.20	68,371.20	
应付销售服务费	-	-	-	-	273,484.72	273,484.72	
应付交易费用	-	-	-	-	140,686.88	140,686.88	
应付利息	-	-	-	-	20,418.37	20,418.37	
其他负债	-	-	-	-	120,603.84	120,603.84	
负债总计	77,980,687.53	-	-	-	897,049.73	78,877,737.26	
利率敏感度缺口	-55,243,742.33	70,192,000.00	331,068,600.00	130,912,622.00	-80,782,193.98	557,711,673.65	

注：1、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。

2、本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，至 2017 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2017 年 6 月 30 日，本基金运作尚不足一年，无足够经验数据。

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，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不超过 30%；债券等固定收益类金融工具占基金资产的比例不低于 70%；保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。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 2017 年 6 月 30 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	71,354,347.54	12.79
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	71,354,347.54	12.79

注：本基金基金合同自 2017 年 2 月 20 日起生效，至 2017 年 6 月 30 日未满六个月。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2017 年 6 月 30 日，本基金运作尚不足一年，无足够经验数据。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 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 64,358,294.20 元，属于第二层次的余额为 559,259,275.34 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间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。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，

暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§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	71,354,347.54	11.21
	其中：股票	71,354,347.54	11.21
2	固定收益投资	552,263,222.00	86.75
	其中：债券	552,263,222.00	86.75
	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	-	-
	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	2,589,251.05	0.41
7	其他各项资产	10,382,590.32	1.63
8	合计	636,589,410.91	100.00

注：本基金合同生效日期为 2017 年 02 月 20 日，截止本报告期末本基金成立未满 6 个月。

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	19,492.00	0.00
B	采矿业	4,094,775.00	0.73
C	制造业	14,152,997.45	2.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,439,561.00	1.69
E	建筑业	7,502,960.20	1.35
F	批发和零售业	1,873,840.80	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	7,429,810.00	1.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,408,095.00	0.25

J	金融业	21,601,220.09	3.87
K	房地产业	3,574,185.00	0.64
L	租赁和商务服务业	37,015.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	97,378.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	72,810.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	50,208.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	71,354,347.54	12.79

注：以上行业分类以 2017 年 06 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600690	青岛海尔	120,300	1,810,515.00	0.32
2	601318	中国平安	34,300	1,701,623.00	0.31
3	600009	上海机场	45,400	1,693,874.00	0.30
4	601607	上海医药	57,100	1,649,048.00	0.30
5	601088	中国神华	73,700	1,642,773.00	0.29
6	601111	中国国航	160,000	1,560,000.00	0.28
7	600036	招商银行	65,000	1,554,150.00	0.28
8	601601	中国太保	45,800	1,551,246.00	0.28
9	601006	大秦铁路	180,500	1,514,395.00	0.27
10	600519	贵州茅台	3,200	1,509,920.00	0.27
11	600887	伊利股份	68,800	1,485,392.00	0.27
12	600900	长江电力	96,100	1,478,018.00	0.27
13	601336	新华保险	27,500	1,413,500.00	0.25
14	600050	中国联通	188,500	1,408,095.00	0.25
15	600886	国投电力	177,700	1,403,830.00	0.25
16	600585	海螺水泥	61,000	1,386,530.00	0.25
17	600795	国电电力	381,200	1,372,320.00	0.25
18	601668	中国建筑	140,600	1,361,008.00	0.24
19	601288	农业银行	386,600	1,360,832.00	0.24

20	600018	上港集团	213,000	1,350,420.00	0.24
21	601985	中国核电	172,100	1,344,101.00	0.24
22	601669	中国电建	166,400	1,317,888.00	0.24
23	600048	保利地产	132,100	1,317,037.00	0.24
24	601939	建设银行	212,600	1,307,490.00	0.23
25	601633	长城汽车	97,800	1,299,762.00	0.23
26	601628	中国人寿	47,700	1,286,946.00	0.23
27	600030	中信证券	75,400	1,283,308.00	0.23
28	600028	中国石化	215,600	1,278,508.00	0.23
29	601988	中国银行	339,800	1,257,260.00	0.23
30	601166	兴业银行	74,500	1,256,070.00	0.23
31	601618	中国中冶	246,700	1,235,967.00	0.22
32	601328	交通银行	199,300	1,227,688.00	0.22
33	601818	光大银行	302,500	1,225,125.00	0.22
34	600011	华能国际	166,600	1,222,844.00	0.22
35	601766	中国中车	120,600	1,220,472.00	0.22
36	600115	东方航空	178,600	1,214,480.00	0.22
37	601390	中国中铁	139,300	1,207,731.00	0.22
38	600015	华夏银行	128,880	1,188,273.60	0.21
39	600027	华电国际	245,800	1,187,214.00	0.21
40	600023	浙能电力	215,600	1,177,176.00	0.21
41	601857	中国石油	152,600	1,173,494.00	0.21
42	601186	中国铁建	96,900	1,165,707.00	0.21
43	601169	北京银行	124,600	1,142,582.00	0.20
44	600016	民生银行	138,700	1,140,114.00	0.20
45	601998	中信银行	180,100	1,132,829.00	0.20
46	600606	绿地控股	144,400	1,129,208.00	0.20
47	601800	中国交建	71,000	1,128,190.00	0.20
48	601989	中国重工	165,000	1,024,650.00	0.18
49	600104	上汽集团	23,800	738,990.00	0.13
50	000656	金科股份	109,000	712,860.00	0.13
51	000100	TCL 集团	117,800	404,054.00	0.07
52	000887	中鼎股份	15,000	331,350.00	0.06
53	002367	康力电梯	26,500	309,520.00	0.06
54	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.03
55	000989	九 芝 堂	9,900	187,704.00	0.03
56	000404	华意压缩	23,300	183,371.00	0.03
57	000626	远大控股	5,600	104,160.00	0.02
58	000002	万 科 A	3,000	74,910.00	0.01

59	000651	格力电器	1,800	74,106.00	0.01
60	000333	美的集团	1,700	73,168.00	0.01
61	000150	宜华健康	3,000	72,810.00	0.01
62	000858	五粮液	1,300	72,358.00	0.01
63	002415	海康威视	2,100	67,830.00	0.01
64	000776	广发证券	3,700	63,825.00	0.01
65	001979	招商蛇口	2,900	61,944.00	0.01
66	000001	平安银行	6,500	61,035.00	0.01
67	603197	保隆科技	1,086	57,612.30	0.01
68	000063	中兴通讯	2,400	56,976.00	0.01
69	000166	申万宏源	10,100	56,560.00	0.01
70	000538	云南白药	600	56,310.00	0.01
71	002142	宁波银行	2,700	52,110.00	0.01
72	000661	长春高新	400	51,644.00	0.01
73	000568	泸州老窖	1,000	50,580.00	0.01
74	000895	双汇发展	2,100	49,875.00	0.01
75	000069	华侨城 A	4,800	48,288.00	0.01
76	000625	长安汽车	3,300	47,586.00	0.01
77	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
78	000783	长江证券	5,000	47,350.00	0.01
79	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
80	603758	秦安股份	2,441	45,036.45	0.01
81	000423	东阿阿胶	600	43,134.00	0.01
82	000513	丽珠集团	600	40,860.00	0.01
83	000028	国药一致	500	40,450.00	0.01
84	000627	天茂集团	5,000	40,400.00	0.01
85	002202	金风科技	2,600	40,222.00	0.01
86	000963	华东医药	800	39,760.00	0.01
87	000540	中天金融	5,600	38,920.00	0.01
88	000869	张裕 A	1,000	37,200.00	0.01
89	002271	东方雨虹	1,000	37,100.00	0.01
90	000415	渤海金控	5,500	37,015.00	0.01
91	000883	湖北能源	7,300	36,646.00	0.01
92	000581	威孚高科	1,400	36,260.00	0.01
93	000876	新希望	4,400	36,168.00	0.01
94	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.01
95	000826	启迪桑德	1,000	35,120.00	0.01
96	000786	北新建材	2,200	34,848.00	0.01
97	000046	泛海控股	3,900	34,047.00	0.01

98	002146	荣盛发展	3,400	33,558.00	0.01
99	000488	晨鸣纸业	2,600	33,540.00	0.01
100	603501	韦尔股份	1,657	33,388.55	0.01
101	002001	新和成	1,700	32,997.00	0.01
102	002081	金螳螂	3,000	32,940.00	0.01
103	000559	万向钱潮	3,100	32,922.00	0.01
104	000418	小天鹅A	700	32,753.00	0.01
105	000623	吉林敖东	1,430	32,732.70	0.01
106	002051	中工国际	1,560	32,338.80	0.01
107	000686	东北证券	3,200	32,160.00	0.01
108	000999	华润三九	1,000	31,750.00	0.01
109	000732	泰禾集团	1,900	31,692.00	0.01
110	000550	江铃汽车	1,500	31,050.00	0.01
111	000750	国海证券	5,600	30,800.00	0.01
112	000596	古井贡酒	600	30,570.00	0.01
113	002470	金正大	4,000	30,120.00	0.01
114	000059	华锦股份	3,000	30,030.00	0.01
115	000793	华闻传媒	2,900	29,348.00	0.01
116	000027	深圳能源	4,300	28,939.00	0.01
117	000915	山大华特	780	28,758.60	0.01
118	000718	苏宁环球	4,800	28,128.00	0.01
119	002701	奥瑞金	4,400	28,116.00	0.01
120	002563	森马服饰	3,200	27,136.00	0.00
121	000022	深赤湾A	900	26,775.00	0.00
122	000910	大亚圣象	1,069	26,553.96	0.00
123	000501	鄂武商A	1,430	26,397.80	0.00
124	000921	海信科龙	1,500	25,815.00	0.00
125	002372	伟星新材	1,380	25,778.40	0.00
126	000539	粤电力A	4,700	25,051.00	0.00
127	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
128	000810	创维数字	1,900	23,047.00	0.00
129	000828	东莞控股	1,900	22,800.00	0.00
130	002705	新宝股份	1,430	21,492.90	0.00
131	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
132	002042	华孚色纺	2,000	21,380.00	0.00
133	000928	中钢国际	2,240	21,190.40	0.00
134	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
135	000587	金洲慈航	1,400	20,860.00	0.00
135	000719	大地传媒	2,000	20,860.00	0.00

136	002285	世联行	2,600	20,852.00	0.00
137	000902	新洋丰	2,300	20,700.00	0.00
138	000030	富奥股份	2,300	20,562.00	0.00
139	002157	正邦科技	4,500	20,475.00	0.00
140	001696	宗申动力	2,700	20,439.00	0.00
141	000543	皖能电力	3,500	20,405.00	0.00
142	001896	豫能控股	2,900	20,358.00	0.00
143	000631	顺发恒业	4,600	20,286.00	0.00
144	000598	兴蓉环境	3,600	20,232.00	0.00
145	000726	鲁泰 A	1,700	20,162.00	0.00
146	000541	佛山照明	2,200	20,042.00	0.00
147	002588	史丹利	2,600	19,994.00	0.00
148	000848	承德露露	2,000	19,960.00	0.00
149	000863	三湘印象	2,700	19,764.00	0.00
150	000685	中山公用	1,800	19,710.00	0.00
151	002242	九阳股份	1,000	19,670.00	0.00
152	002191	劲嘉股份	2,100	19,656.00	0.00
153	000429	粤高速 A	2,300	19,642.00	0.00
154	002477	雏鹰农牧	4,400	19,492.00	0.00
155	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
156	000600	建投能源	1,400	17,178.00	0.00
157	000700	模塑科技	2,100	16,989.00	0.00
158	000919	金陵药业	1,500	16,230.00	0.00
159	000811	烟台冰轮	900	15,705.00	0.00
160	000036	华联控股	1,700	15,470.00	0.00
161	000546	金圆股份	1,400	15,260.00	0.00
162	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
163	000957	中通客车	1,300	15,210.00	0.00
164	000952	广济药业	1,000	15,030.00	0.00
165	002543	万和电气	600	14,742.00	0.00
166	000908	景峰医药	1,700	14,348.00	0.00
167	000936	华西股份	2,000	14,040.00	0.00
168	000417	合肥百货	1,700	14,025.00	0.00
169	000888	峨眉山 A	1,100	13,970.00	0.00
170	000966	长源电力	2,800	13,832.00	0.00
171	000900	现代投资	1,500	13,800.00	0.00
172	000698	沈阳化工	2,100	13,713.00	0.00
173	002357	富临运业	1,300	13,624.00	0.00
174	002003	伟星股份	1,300	13,585.00	0.00

175	000601	韶能股份	1,900	13,547.00	0.00
176	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
177	000899	赣能股份	1,600	13,520.00	0.00
178	000531	穗恒运 A	1,400	13,328.00	0.00
179	000667	美好置业	4,000	13,240.00	0.00
180	000650	仁和药业	2,200	13,156.00	0.00
181	002327	富安娜	1,500	12,465.00	0.00
182	000537	广宇发展	1,500	12,315.00	0.00
183	000958	东方能源	1,400	11,312.00	0.00
184	000620	新华联	1,400	9,954.00	0.00
185	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
186	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

注：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。

7.4 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	601988	中国银行	1,267,027.00	0.23
2	601288	农业银行	1,266,634.00	0.23
3	600795	国电电力	1,266,512.00	0.23
4	600028	中国石化	1,266,190.00	0.23
5	601818	光大银行	1,266,066.00	0.23
6	600018	上港集团	1,266,020.00	0.23
7	600027	华电国际	1,265,750.00	0.23
8	601618	中国中冶	1,265,272.00	0.23
9	601985	中国核电	1,265,107.00	0.23
10	601006	大秦铁路	1,265,070.00	0.23
11	600023	浙能电力	1,264,747.00	0.23
12	600050	中国联通	1,264,711.00	0.23
13	600886	国投电力	1,264,552.00	0.23
14	601328	交通银行	1,264,455.00	0.23
15	601939	建设银行	1,264,416.00	0.23
16	601111	中国国航	1,264,383.00	0.23
17	601857	中国石油	1,264,330.00	0.23
18	601998	中信银行	1,264,228.00	0.23

19	600015	华夏银行	1,264,211.00	0.23
20	601669	中国电建	1,263,852.00	0.23

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	002415	海康威视	1,146,950.00	0.21
2	000333	美的集团	1,034,430.00	0.19
3	000001	平安银行	1,004,190.00	0.18
4	000858	五粮液	1,003,170.00	0.18
5	000651	格力电器	998,217.00	0.18
6	000002	万科 A	971,324.00	0.17
7	000776	广发证券	943,260.00	0.17
8	000166	申万宏源	919,544.00	0.16
9	001979	招商蛇口	871,038.00	0.16
10	000069	华侨城 A	842,618.00	0.15
11	002142	宁波银行	811,792.00	0.15
12	000568	泸州老窖	791,854.00	0.14
13	000895	双汇发展	715,428.00	0.13
14	000063	中兴通讯	703,728.00	0.13
15	000783	长江证券	699,413.00	0.13
16	000625	长安汽车	687,242.00	0.12
17	000538	云南白药	633,150.00	0.11
18	000627	天茂集团	626,841.00	0.11
19	000876	新希望	603,473.00	0.11
20	000883	湖北能源	585,101.00	0.10

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	117,396,116.54
卖出股票收入（成交）总额	48,472,556.93

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	80,525,622.00	14.44
5	企业短期融资券	352,729,600.00	63.25
6	中期票据	119,008,000.00	21.34
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	552,263,222.00	99.02

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	122267	13 永泰债	510,000	51,183,600.00	9.18
2	041754010	17 鞍钢集 CP001	500,000	50,250,000.00	9.01
3	011767004	17 大同煤矿 SCP001	500,000	50,150,000.00	8.99
4	011760032	17 广汇汽车 SCP004	500,000	49,935,000.00	8.95
5	1382189	13 辽方大 MTN1	500,000	49,475,000.00	8.87

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：（1）本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金本报告期内未进行股指期货交易。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金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：本基金本报告期内未进行国债期货投资，无相关评价。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	57,694.15
2	应收证券清算款	38,280.51
4	应收利息	10,286,615.66
9	合计	10,382,590.32

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

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	601088	中国神华	1,642,773.00	0.29	筹划重大事项

注：本基金截至 2017 年 06 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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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
2,727	201,977.54	-	-	550,792,741.36	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金本报告期末无基金管理人的从业人员持有本基金。

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

注：本基金本报告期末无基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年2月20日）基金份额总额	550,792,741.36
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	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
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	550,792,741.36

注：1、本基金以1年为一个封闭期，每个封闭期为自基金合同生效日（含）或每个开放期结束之日的次日（含）起至1年后的年度对日的前一日止的期间，在每个封闭期内本基金采取封闭运作的模式，基金份额持有人不得申请申购、赎回本基金。

2、本基金基金合同自2017年2月20日起生效，至2017年6月30日未满六个月。

§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

本报告期基金管理人、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

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金于 2017 年 2 月 20 日成立，在报告期内，基金管理人严格参照《北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》及《北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金招募说明书》内所述投资目标、投资范围开展投资，在审慎的前提下遴选优质证券，以期为投资人获取稳健回报。截至目前，本基金已经逐步完成了建仓管理。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 20,793.63 元。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

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	
海通证券	1	61,084,681.19	37.04%	44,671.28	34.37%	新增
东吴证券	1	55,353,744.39	33.57%	40,479.75	31.14%	新增

天风证券	2	46,894,380.95	28.44%	43,672.86	33.60%	新增
西南证券	1	604,378.30	0.37%	442.03	0.34%	新增
国金证券	1	421,721.67	0.26%	308.36	0.24%	新增
大同证券	1	358,553.11	0.22%	262.17	0.20%	新增
信达证券	1	193,522.90	0.12%	141.52	0.11%	新增
兴业证券	2	924.00	0.00%	0.68	0.00%	新增
东北证券	1	-	-	-	-	新增
中信证券	1	-	-	-	-	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 12 个交易单元，包括天风证券、兴业证券各 2 个交易单元，海通证券、东北证券、中信证券、西南证券、东吴证券、信达证券、国金证券、大同证券各 1 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
海通证券	10,026,944.66	5.09%	1,000,000,000.00	40.04%	-	-
东吴证券	-	-	60,000,000.00	2.40%	-	-

天风证券	-	-	724,200,000.00	29.00%	-	-
西南证券	47,642,594.68	24.18%	203,000,000.00	8.13%	-	-
国金证券	934.30	0.00%	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	17,000,000.00	0.68%	-	-
兴业证券	110,037,560.66	55.86%	393,000,000.00	15.74%	-	-
东北证券	-	-	100,000,000.00	4.00%	-	-
中信证券	29,293,105.48	14.87%	-	-	-	-

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 12 个交易单元，包括天风证券、兴业证券各 2 个交易单元，海通证券、东北证券、中信证券、西南证券、东吴证券、信达证券、国金证券、大同证券各 1 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。

10.8 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	北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金基金合同	中国证券报、证券时报	2017 年 1 月 3 日
2	北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金托管协议	中国证券报、证券时报	2017 年 1 月 3 日
3	北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金基金合同摘要	中国证券报、证券时报	2017 年 1 月 3 日
4	北信瑞丰基金管理有限公司北信瑞丰增强回报定期开放混合型证	中国证券报、证券时报	2017 年 1 月 3 日

	券投资基金招募说明书		
5	北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金份额发售公告	中国证券报、证券时报	2017 年 1 月 3 日
6	北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金延期结束募集的公告	中国证券报、证券时报	2017 年 1 月 19 日
7	北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证券报、证券时报	2017 年 2 月 13 日
8	北信瑞丰增强回报定期开放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	2017 年 2 月 21 日
9	北信瑞丰基金关于参加宜信普泽投资顾问(北京)有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报	2017 年 3 月 9 日
10	北信瑞丰基金管理有限公司更正公告	中国证券报、证券时报	2017 年 6 月 8 日
11	北信瑞丰基金管理有限公司关于增加中期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	2017 年 6 月 9 日
12	北信瑞丰基金管理有限公司关于增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为基金代销机构公告	中国证券报、证券时报	2017 年 6 月 9 日
13	北信瑞丰基金管理有限公司关于增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为基金代销机构公告	中国证券报、证券时报	2017 年 6 月 23 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额达到或超过 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披露。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金的文件。
- 2、北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金基金合同。
- 3、北信瑞丰增强回报定期开放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

2017 年 8 月 25 日