

北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：北京银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 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 2020 年 1 月 1 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	48
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.....	52
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	北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金	
基金简称	北信瑞丰鼎利债券	
基金主代码	004564	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 1 月 25 日	
基金管理人	北信瑞丰基金管理有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	37,679,019.31 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	北信瑞丰鼎利债券 A	北信瑞丰鼎利债券 C
下属分级基金的交易代码:	004564	005193
报告期末下属分级基金的份额总额	37,131,908.00 份	547,111.31 份

2.2 基金产品说明

投资目标	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	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金的大类资产配置主要通过自上而下的配置完成，主要对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，预测宏观经济的发展趋势等，并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，在限定投资范围内，动态调整债券类资产、股票类等工具的配置比例，控制基金资产运作风险，提高基金资产风险调整后收益。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>(1) 类属资产配置策略</p> <p>在整体资产配置的基础上，本基金将通过考量不同类型固定收益品种的信用风险、市场风险、流动性风险、税收等因素，研究各投资品种的利差及其变化趋势，制定债券类属资产配置策略，以获取债券类属之间利差变化所带来的潜在收益。</p> <p>(2) 普通债券投资策略</p> <p>对于普通债券，本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下，采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、相对价值投资策略、杠杆策略等策略进行主动投资。</p> <p>(3) 可转换债券投资策略</p> <p>当正股价格处于特定区间内时，可转换债券将表现出股性、债性或者股债混合的特性。本基金将对可转换债券对应的正股进行分析，从行业背景、公司基本面、市场情绪、期权价值等因素综合考虑可转换债券的投资机会，在价值权衡和风险评估的基础上审慎进行可转换债券的投资，创造超额收益。</p> <p>(4) 中小企业私募债券投资策略</p> <p>与传统的信用债券相比，中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让，普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金对中小企业私募债券的投资将着力分析个券的实际信用风险，并寻求足够的收益补偿，增加基金收益。本基金管</p>

	<p>理人将对个券信用资质进行详尽的分析，从动态的角度分析发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，进而预测信用水平的变化趋势，决定投资策略。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股。</p>
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期风险与预期收益低于股票型基金与混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中等偏低风险收益品种。

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	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭亚	刘晔
	联系电话	010-68619341	010-66223586
	电子邮箱	service@bxrfund.com	liuyel@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		4000617297	95526
传真		010-68619300	010-66225309
注册地址		北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号	北京市西城区金融大街甲 17 号首层
办公地址		北京市海淀区西三环北路 100 号光耀东方中心 A 座 6 层、25 层	北京市西城区金融大街丙 17 号
邮政编码		100048	100033
法定代表人		李永东	张东宁

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	北信瑞丰基金管理有限公司	北京市海淀区西三环北路 100 号光耀东方中心 A 座 6 层、25 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

基金级别	北信瑞丰鼎利债券 A	北信瑞丰鼎利债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	-23,762.58	5,493.65
本期利润	-987,282.67	-23,491.56
加权平均基金份额本期利润	-0.0352	-0.0432
本期加权平均净值利润率	-3.33%	-4.10%
本期基金份额净值增长率	-3.94%	-4.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末可供分配利润	1,653,284.47	19,580.36
期末可供分配基金份额利润	0.0445	0.0358
期末基金资产净值	38,785,192.47	566,691.67
期末基金份额净值	1.0445	1.0358
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	4.45%	3.58%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 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

北信瑞丰鼎利债券 A

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	-0.02%	0.19%	-0.08%	0.11%	0.06%	0.08%
过去三个月	-0.95%	0.25%	0.73%	0.12%	-1.68%	0.13%
过去六个月	-3.94%	0.36%	2.26%	0.12%	-6.20%	0.24%
过去一年	0.47%	0.29%	5.31%	0.10%	-4.84%	0.19%
自基金合同	4.45%	0.31%	13.52%	0.11%	-9.07%	0.20%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

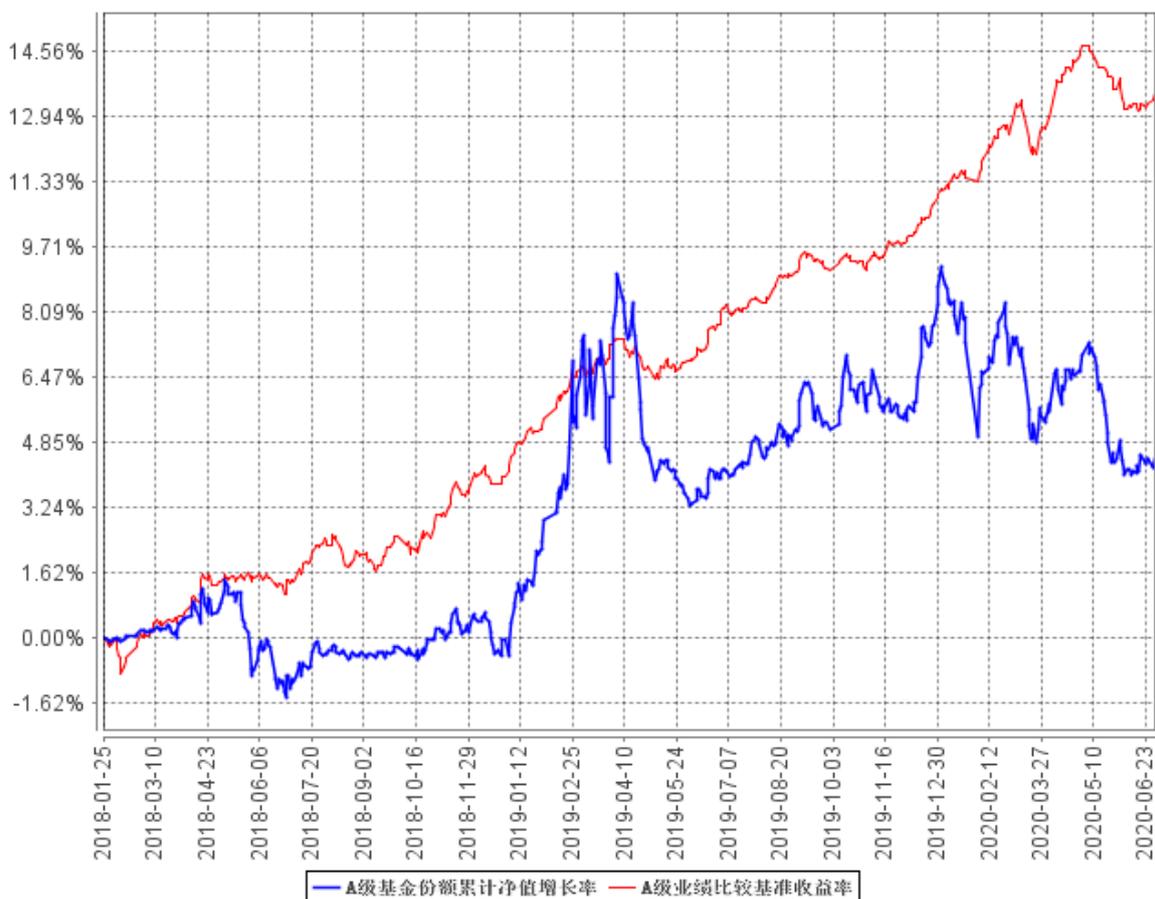
北信瑞丰鼎利债券 C

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	-0.05%	0.19%	-0.08%	0.11%	0.03%	0.08%
过去三个月	-1.03%	0.25%	0.73%	0.12%	-1.76%	0.13%
过去六个月	-4.00%	0.36%	2.26%	0.12%	-6.26%	0.24%
过去一年	0.21%	0.29%	5.31%	0.10%	-5.10%	0.19%
自基金合同生效起至今	3.58%	0.31%	13.52%	0.11%	-9.94%	0.20%

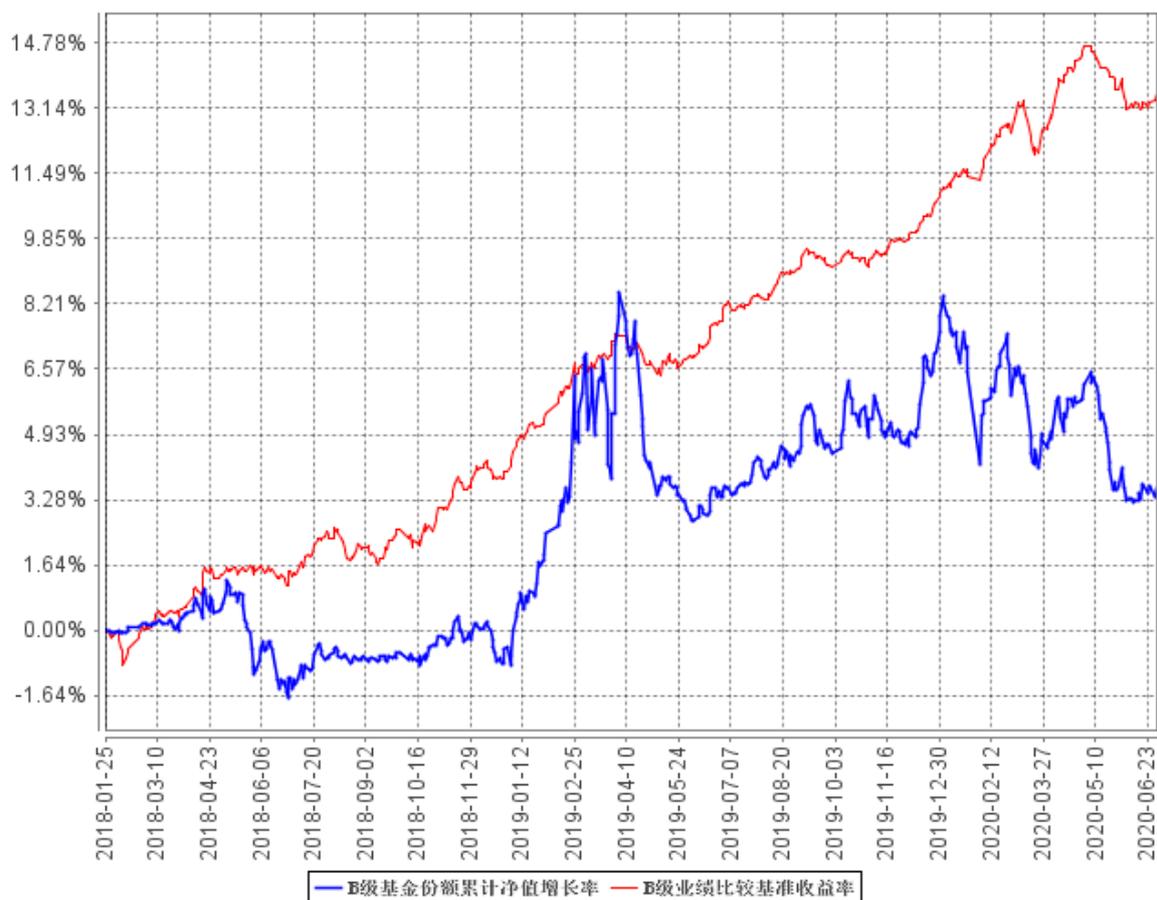
注：中证综合债指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。中证综合债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。沪深 300 指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基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

A级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



B级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 2018 年 1 月 25 日生效，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。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 18 只公募产品，保有 82 只专户产品，资产管理规模 297.60 亿元，其中公募资产管理规模 110.44 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		
鞏大吉	基金经理	2019 年 2 月 25 日	2020 年 4 月 7 日	9	鞏大吉先生，中国人民大学经济学学士，中国人民大学理论经济学硕士。2011 年 7 月至 2016 年 4 月曾任中债信用增进投资股份有限公司投资部交易员，投资经理等。2016 年 5 月加入北信瑞丰基金管理有限公司投资研究部，任基金经理助理。现任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理。
林翟	基金经理	2020 年 1 月 10 日	-	10	林翟先生，厦门大学应用经济学硕士，从事证券业 10 年。原华农财产保险股份有限公司资金运用部投资经理，中英人寿保险有限公司投资管理部投资经理，新时代证券股份有限公司固定收益部高级投资经理。2019 年 11 月加入北信瑞丰基金管理有限公司，现任北信瑞丰基金固收事业一部基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

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，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

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

本期债券市场先扬后抑，年初以来随着货币政策持续宽松，债券收益率大幅下行，近期随着经济数据边际改善、货币政策边际收紧，风险偏好回升，债券收益率大幅上行，目前收益率已回到疫情前水平。上半年货币政策宽松，经济继续探底，具有确定性业绩的消费、医药和部分科技股录得较大涨幅，近一周传统周期股迎来估值修复行情。本报告期内，受央行边际收紧流动性和风险偏好抬升影响，长久期利率债波动较大，同时带动了转债的转股溢价率大幅下行，多因素造成了本期产品净值回撤较多。

目前政策导向对权益市场较为友好，但长期走势依然要看业绩拐点是否出现。具体到投资策略：短期微观数据边际改善，宜跟随风险偏好的提升增加权益仓位，降债券久期，持债结构以低仓位、短久期、中等评级信用债为主，获取较高的票息收益。中期疫情反复或贸易摩擦等风险因

素可能导致风险偏好降低，届时宜降整体权益仓位，结构上降低传统周期类股票仓位，增加科技、成长类股票。同时拉债券久期，择时增配长久期利率债。我们将紧跟市场变化，积极应对，努力控制回撤，为持有人获取长期稳健回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末北信瑞丰鼎利债券 A 基金份额净值为 1.0445 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.94%；截至本报告期末北信瑞丰鼎利债券 C 基金份额净值为 1.0358 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.00%；同期业绩比较基准收益率为 2.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

海外疫情已经开始二次爆发，受美国财政部“直升机撒钱”托底影响，失业率下滑幅度收窄，该政策可能持续到美国大选之后，外需正在边际改善。国内疫情影响逐步下降，短期 PMI 连续反弹，基建发挥了托底作用，房地产销售改善，部分新兴行业业绩稳健增长。中小企业生存压力依然很大，就业压力凸显。宏观上看，社融、M2、信贷边际改善，是否持续增长有待观察。

目前经济恢复的动能仍在，但不确定性增加。下半年随着天气转冷，疫情可能会反复，造成经济活动程度下降，内需面临反复。国际关系也可能会更加紧张，外需面临不确定性。资本市场整体风险偏好可能会阶段性下降，权益市场经过较强的反弹之后可能会面临回调压力，债券市场由于前期跌幅已经较为显著，下半年应该会有一定程度修复。

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[2017]13号公告《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、[2008]38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（2017年9月5日废止）等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2018 年 09 月 03 日（含）至 2020 年 6 月 30 日期间资产净值低于五千万元，已经连续六十个工作日以上。本基金管理人已按规定向中国证监会进行了报告并提交了解决方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在托管北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金的过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真地复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、收益分配情况、投资组合报告的内容（“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内），保证复核内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	601,216.65	249,094.42
结算备付金		66,376.03	249.81
存出保证金		11,591.81	1,983.23
交易性金融资产	6.4.7.2	42,960,199.80	3,167,639.10
其中：股票投资		3,780,536.00	-
基金投资		-	-
债券投资		39,179,663.80	3,167,639.10
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		299,315.19	-
应收利息	6.4.7.5	520,109.40	21,421.88
应收股利		-	-
应收申购款		40.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		44,458,848.88	3,440,388.44
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		5,000,000.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		51,928.43	1,072.89
应付管理人报酬		19,357.68	1,867.17
应付托管费		3,226.27	311.19
应付销售服务费		162.75	177.50
应付交易费用	6.4.7.7	5,700.35	139.80
应交税费		2,198.48	60.14

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	24,390.78	40,000.40
负债合计		5,106,964.74	43,629.09
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	37,679,019.31	3,127,857.02
未分配利润	6.4.7.10	1,672,864.83	268,902.33
所有者权益合计		39,351,884.14	3,396,759.35
负债和所有者权益总计		44,458,848.88	3,440,388.44

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额 37,679,019.31 份。其中 A 类基金份额净值 1.0445 元，基金份额总额 37,131,908.00 份；C 类基金份额净值 1.0358 元，基金份额总额 547,111.31 份。

6.2 利润表

会计主体：北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		-841,147.51	781,385.69
1.利息收入		434,230.01	124,113.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,089.00	4,370.57
债券利息收入		423,957.64	119,743.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,183.37	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-283,459.41	648,506.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-79,960.14	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-261,053.27	648,506.07
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	57,554.00	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-992,505.30	5,262.76
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	587.19	3,503.02

减：二、费用		169,626.72	107,164.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	87,820.27	40,106.81
2. 托管费	6.4.10.2.2	14,636.74	6,684.50
3. 销售服务费		997.97	12,212.07
4. 交易费用	6.4.7.19	15,845.00	146.81
5. 利息支出		15,513.57	18,320.29
其中：卖出回购金融资产支出		15,513.57	18,320.29
6. 税金及附加		577.56	78.26
7. 其他费用	6.4.7.20	34,235.61	29,615.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,010,774.23	674,221.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,010,774.23	674,221.16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	3,127,857.02	268,902.33	3,396,759.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,010,774.23	-1,010,774.23
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）	34,551,162.29	2,414,736.73	36,965,899.02
其中：1.基金申购款	35,661,486.79	2,484,423.27	38,145,910.06
2.基金赎回款	-1,110,324.50	-69,686.54	-1,180,011.04
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）	37,679,019.31	1,672,864.83	39,351,884.14

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	16,527,221.91	-36,167.17	16,491,054.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	674,221.16	674,221.16
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)	-6,221,997.13	-267,400.58	-6,489,397.71
其中：1.基金申购款	823,254.05	40,712.13	863,966.18
2.基金赎回款	-7,045,251.18	-308,112.71	-7,353,363.89
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)	10,305,224.78	370,653.41	10,675,878.19

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 姜晴
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金(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[2017]第 419 号《关于准予北信瑞丰鼎利债券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《北信瑞丰鼎利债券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 228,305,933.99 元,业经中喜会计师事务所(特殊普通合伙)中喜验字(2018)第 0012 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 228,370,617.52 份基金份额,其中认购资金利息折合 64,683.53 份基金份额。本基金的基金管

理人为北信瑞丰基金管理有限公司，基金托管人为北京银行股份有限公司（以下简称“北京银行”）。

根据《北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金基金合同》和《北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金自募集期起根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用，称为 A 类基金份额；不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《北信瑞丰鼎利债券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、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债券、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、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。本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金持有的股票的比例不超过基金资产的 20%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证综合债指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

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〈年度报告和中期报告〉》、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》、《北信瑞丰鼎利债券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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2020 年 6 月 30 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以

产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

(5)本基金的城镇维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	601,216.65
定期存款	-
其他存款	-
合计	601,216.65

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,056,628.61	3,780,536.00	-276,092.61
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	24,038,425.08	23,626,590.60
	银行间市场	15,683,867.01	15,553,073.20
	合计	39,722,292.09	39,179,663.80
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	43,778,920.70	42,960,199.80	-818,720.90

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.1.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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 2020年6月30日
应收活期存款利息	125.16
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	29.90
应收债券利息	519,949.14
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	5.20
合计	520,109.40

6.4.7.6 其他资产

本基金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 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	5,235.43
银行间市场应付交易费用	464.92

合计	5,700.35
----	----------

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
预提费用	24,390.78
合计	24,390.78

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

北信瑞丰鼎利债券 A		
项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,628,211.93	2,628,211.93
本期申购	35,551,229.15	35,551,229.15
本期赎回(以“-”号填列)	-1,047,533.08	-1,047,533.08
本期末	37,131,908.00	37,131,908.00

金额单位：人民币元

北信瑞丰鼎利债券 C		
项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	499,645.09	499,645.09
本期申购	110,257.64	110,257.64
本期赎回(以“-”号填列)	-62,791.42	-62,791.42
本期末	547,111.31	547,111.31

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

北信瑞丰鼎利债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	111,901.09	117,518.89	229,419.98
本期利润	-23,762.58	-963,520.09	-987,282.67
本期基金份额交易产生的变动数	1,928,949.39	482,197.77	2,411,147.16
其中：基金申购款	1,984,077.31	492,996.31	2,477,073.62

基金赎回款	-55,127.92	-10,798.54	-65,926.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,017,087.90	-363,803.43	1,653,284.47

单位：人民币元

北信瑞丰鼎利债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,263.17	22,219.18	39,482.35
本期利润	5,493.65	-28,985.21	-23,491.56
本期基金份额交易产生的变动数	2,086.10	1,503.47	3,589.57
其中：基金申购款	4,994.82	2,354.83	7,349.65
基金赎回款	-2,908.72	-851.36	-3,760.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,842.92	-5,262.56	19,580.36

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	5,276.14
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	768.83
其他	44.03
合计	6,089.00

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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	4,181,854.25
减：卖出股票成本总额	4,261,814.39
买卖股票差价收入	-79,960.14

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
----	----

	2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	30,357,076.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	30,321,097.16
减：应收利息总额	297,032.11
买卖债券差价收入	-261,053.27

6.4.7.13.1.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	57,554.00
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	57,554.00

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-992,505.30
——股票投资	-276,092.61
——债券投资	-716,412.69
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-

合计	-992,505.30
----	-------------

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	587.19
合计	587.19

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	14,995.00
银行间市场交易费用	850.00
合计	15,845.00

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	19,890.78
账户维护费	13,500.00
汇划手续费	844.83
合计	34,235.61

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至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。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

北信瑞丰基金管理有限公司（“北信瑞丰基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
北京银行股份有限公司（“北京银行”）	基金销售机构、基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	87,820.27	40,106.81
其中：支付销售机构的客户维护费	4,500.85	13,919.31

注：1. 支付基金管理人北信瑞丰基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 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。

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产里列支的费用项目。

6.4.10.2.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	14,636.74	6,684.50

注：支付基金托管人北京银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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 0.10%/当年天数。

6.4.10.2.1.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	北信瑞丰鼎利债券 A	北信瑞丰鼎利债券 C	合计
北信瑞丰基金管理有限公司	-	78.43	78.43
北京银行股份有限公司	-	599.78	599.78
合计	-	678.21	678.21
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	北信瑞丰鼎利债券 A	北信瑞丰鼎利债券 C	合计
北信瑞丰基金管理有限公司	-	9,078.08	9,078.08
北京银行股份有限公司	-	2,291.27	2,291.27
合计	-	11,369.35	11,369.35

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给北信瑞丰基金，再由北信瑞丰基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额约定的销售服务费年费率为0.35%。销售服务费的计算公式为：日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值×0.35%/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

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 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 2020年1月1日至2020年6月30日	
	北信瑞丰鼎利债券 A	北信瑞丰鼎利债券 C
基金合同生效日（2018年1月25日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	北信瑞丰鼎利债券 A	北信瑞丰鼎利债券 C
基金合同生效日（2018年1月25日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	5,036,768.40
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	5,036,768.40
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	80.69%

注：基金管理人北信瑞丰基金在本年度赎回本基金的交易委托北信瑞丰基金直销中心办理，无赎回费。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间无除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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
	北京银行股份有限公司	601,216.65	5,276.14	730,046.30

注：本基金的银行存款由基金托管人北京银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期及上年度可比期间，本基金未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本期及上年度可比期间，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2020 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

本报告期末，本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 5,000,000.00 元，于 2020 年 7 月 7 号到期。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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本期末本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货

币市场基金。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、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债券、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、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。本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金持有的股票的比例不超过基金资产的 20%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险管理委员会，根据公司总体战略负责拟订公司风险战略和风险管理政策，并对其实施情况及效果进行监督和评价，指导公司的风险管理和内控制度建设；对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估；监督公司的财务状况，审计公司的财务报表，评估公司的财务表现，保证公司的财务运作符合法律的要求和通行的会计标准。在业务操作层面，监察稽核部承担其他风险的管理职责，负责在各业务部门一线风险控制的基础上实施风险再控制。

本基金的基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行北京银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能

性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	7,741,075.00	2,045,734.10
AAA 以下	15,605,714.76	586,584.00
未评级	-	-
合计	23,346,789.76	2,632,318.10

注：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、同业存单及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的同业存单投资。

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。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购

交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	601,216.65	-	-	-	601,216.65
结算备付金	66,376.03	-	-	-	66,376.03
存出保证金	11,591.81	-	-	-	11,591.81
交易性金融资产	13,340,742.90	13,626,500.90	12,212,420.00	3,780,536.00	42,960,199.80
应收证券清算款	-	-	-	299,315.19	299,315.19
应收利息	-	-	-	520,109.40	520,109.40
应收申购款	-	-	-	40.00	40.00
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,019,927.39	13,626,500.90	12,212,420.00	4,600,000.59	44,458,848.88
负债					
卖出回购金融资产款	5,000,000.00	-	-	-	5,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	51,928.43	51,928.43
应付管理人报酬	-	-	-	19,357.68	19,357.68
应付托管费	-	-	-	3,226.27	3,226.27
应付销售服务费	-	-	-	162.75	162.75
应付交易费用	-	-	-	5,700.35	5,700.35
应交税费	-	-	-	2,198.48	2,198.48
其他负债	-	-	-	24,390.78	24,390.78

负债总计	5,000,000.00	-	-	106,964.74	5,106,964.74
利率敏感度缺口	9,019,927.39	13,626,500.90	12,212,420.00	4,493,035.85	39,351,884.14
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	249,094.42	-	-	-	249,094.42
结算备付金	249.81	-	-	-	249.81
存出保证金	1,983.23	-	-	-	1,983.23
交易性金融资产	2,639,014.80	528,624.30	-	-	3,167,639.10
应收利息	-	-	-	21,421.88	21,421.88
资产总计	2,890,342.26	528,624.30	-	21,421.88	3,440,388.44
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,072.89	1,072.89
应付管理人报酬	-	-	-	1,867.17	1,867.17
应付托管费	-	-	-	311.19	311.19
应付销售服务费	-	-	-	177.50	177.50
应付交易费用	-	-	-	139.80	139.80
应交税费	-	-	-	60.14	60.14
其他负债	-	-	-	40,000.40	40,000.40
负债总计	-	-	-	43,629.09	43,629.09
利率敏感度缺口	2,890,342.26	528,624.30	-	-22,207.21	3,396,759.35

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	46,670.29	30,251.84
2. 市场利率上升 25 个基点	-46,342.23	-30,250.06	

6.4.13.4.1.3 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.1.4 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。本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金持有的股票的比例不超过基金资产的 20%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

6.4.13.4.1.5 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	3,780,536.00	9.61	-	-
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	3,780,536.00	9.61	-	-

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 2020 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 10,013,868.10 元，属于第二层次的余额为 32,946,331.70 元，无属于第三层次的余额。(2019 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 2,553,451.80 元，属于第二层次的余额为 614,187.30 元，无属于第三层次的余额)

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 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。(2019 年 12 月 31 日：同。)

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	3,780,536.00	8.50
	其中：股票	3,780,536.00	8.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	39,179,663.80	88.13
	其中：债券	39,179,663.80	88.13
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	667,592.68	1.50
8	其他各项资产	831,056.40	1.87
9	合计	44,458,848.88	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	329,616.00	0.84
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,195,820.00	5.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	333,900.00	0.85
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	-	-
J	金融业	398,400.00	1.01
K	房地产业	522,800.00	1.33
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	-	-
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	3,780,536.00	9.61

注：以上行业分类以 2020 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

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	000002	万科 A	20,000	522,800.00	1.33
2	300308	中际旭创	7,000	441,000.00	1.12
3	601398	工商银行	80,000	398,400.00	1.01
4	600111	北方稀土	40,000	372,800.00	0.95
5	000063	中兴通讯	9,000	361,170.00	0.92
6	601668	中国建筑	70,000	333,900.00	0.85
7	300498	温氏股份	15,120	329,616.00	0.84
8	002013	中航机电	40,000	316,000.00	0.80
9	000100	TCL 科技	40,000	248,000.00	0.63
10	000725	京东方 A	40,000	186,800.00	0.47
11	600392	盛和资源	25,000	176,250.00	0.45
12	600031	三一重工	5,000	93,800.00	0.24

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000063	中兴通讯	1,104,987.00	32.53
2	601318	中国平安	657,630.00	19.36
3	000002	万科 A	614,977.00	18.10
4	300750	宁德时代	603,020.00	17.75

5	600585	海螺水泥	564,520.00	16.62
6	601668	中国建筑	539,200.00	15.87
7	002013	中航机电	522,350.00	15.38
8	600031	三一重工	443,718.00	13.06
9	300308	中际旭创	428,420.00	12.61
10	300498	温氏股份	423,288.00	12.46
11	601398	工商银行	412,800.00	12.15
12	600111	北方稀土	388,200.00	11.43
13	688111	金山办公	291,700.00	8.59
14	002025	航天电器	254,901.00	7.50
15	000100	TCL 科技	244,800.00	7.21
16	600392	盛和资源	198,500.00	5.84
17	000725	京东方 A	188,000.00	5.53
18	000651	格力电器	173,982.00	5.12
19	002601	龙蟠佰利	164,400.00	4.84
20	600030	中信证券	99,050.00	2.92

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 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	689,750.00	20.31
2	000063	中兴通讯	608,780.00	17.92
3	601318	中国平安	561,480.00	16.53
4	600585	海螺水泥	550,267.90	16.20
5	600031	三一重工	372,740.00	10.97
6	688111	金山办公	325,167.35	9.57
7	002025	航天电器	271,300.00	7.99
8	002013	中航机电	207,250.00	6.10
9	000651	格力电器	177,000.00	5.21
10	002601	龙蟠佰利	167,319.00	4.93
11	601668	中国建筑	162,000.00	4.77
12	600030	中信证券	88,800.00	2.61

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	8,318,443.00
卖出股票收入（成交）总额	4,181,854.25

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	1,865,420.00	4.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	14,399,200.00	36.59
	其中：政策性金融债	14,399,200.00	36.59
4	企业债券	16,681,711.70	42.39
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	6,233,332.10	15.84
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,179,663.80	99.56

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	190310	19 进出 10	100,000	10,347,000.00	26.29
2	1580231	15 伊宁债	50,000	3,070,000.00	7.80
3	136176	16 绿地 01	30,000	3,033,900.00	7.71
4	127489	PR 六交投	25,840	2,067,716.80	5.25
5	1480583	14 芜湖县建投债	50,000	2,058,500.00	5.23

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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

- (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

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

- (1) 本基金本报告期末未持有国债期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

7.11.3 本期国债期货投资评价

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受到调查以及处罚的情况的说明

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,591.81
2	应收证券清算款	299,315.19
3	应收股利	-
4	应收利息	520,109.40
5	应收申购款	40.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	831,056.40

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110062	烽火转债	872,970.00	2.22
2	128028	赣锋转债	697,800.00	1.77
3	132015	18 中油 EB	600,000.00	1.52
4	113553	金牌转债	599,850.00	1.52
5	113550	常汽转债	370,680.00	0.94
6	128045	机电转债	356,880.00	0.91
7	113547	索发转债	350,010.00	0.89
8	132018	G 三峡 EB1	332,880.00	0.85
9	128088	深南转债	314,560.00	0.80
10	128074	游族转债	303,900.00	0.77
11	110053	苏银转债	194,892.80	0.50
12	127005	长证转债	116,640.00	0.30
13	110065	淮矿转债	84,376.00	0.21
14	113543	欧派转债	64,682.80	0.16
15	110059	浦发转债	53,980.50	0.14

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
北信瑞丰鼎利债券 A	157	236,508.97	35,522,074.30	95.66%	1,609,833.70	4.34%
北信瑞丰鼎利债券 C	65	8,417.10	-	0.00%	547,111.31	100.00%
合计	222	169,725.31	35,522,074.30	94.28%	2,156,945.01	5.72%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	北信瑞丰鼎利债券 A	38,818.80	0.10%
	北信瑞丰鼎利债券 C	47,198.77	8.63%
	合计	86,017.57	0.23%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	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	北信瑞丰鼎利债券 A	0~10
	北信瑞丰鼎利债券 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	北信瑞丰鼎利债券 A	-
	北信瑞丰鼎利债券 C	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	北信瑞丰鼎利债券 A	北信瑞丰鼎利债券 C
基金合同生效日（2018 年 1 月 25 日）基金份额总额	77,543,160.91	150,827,456.61
本报告期期初基金份额总额	2,628,211.93	499,645.09
本报告期基金总申购份额	35,551,229.15	110,257.64
减：本报告期基金总赎回份额	1,047,533.08	62,791.42
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	37,131,908.00	547,111.31

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

本报告期没有举行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管理人、基金财产、基金托管人业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

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 19,890.78 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

本报告期内，中国证券监督管理委员会（下称“中国证监会”）北京监管局于 2020 年 5 月 4 日对本基金管理人下发的《关于对北信瑞丰基金管理有限公司采取责令改正行政监管措施的决定》（行政监管措施决定书[2020]70 号）。本基金管理人已根据法律法规、行政法规和中国证监会的要求落实整改。

本报告期内，中国证券监督管理委员会（下称“中国证监会”）北京监管局于 2020 年 5 月 20 日对本基金高级管理人下发的《关于对朱彦采取出具警示函行政监管措施的决定》（[2020]85 号）本基金高级管理人已根据法律法规、行政法规和中国证监会的要求落实整改。

本报告期内，未发生托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国联证券	2	12,500,297.25	100.00%	9,141.34	100.00%	-

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，本基金租用证券公司交易单元未变更。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
国联证券	60,355,741.26	100.00%	127,810,000.00	100.00%	-	-

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，本基金租用证券公司交易单元未变更。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	北信瑞丰基金管理有限公司关于调整基金经理的公告	上海证券报、指定网站	2020年1月11日
2	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金2019年第4季度报告提示性公告	上海证券报、指定网站	2020年1月18日
3	北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金2019年第4季度报告	指定网站	2020年1月18日
4	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下基金开放日及开放时间的提示性公告	上海证券报、指定网站	2020年1月31日
5	北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金2019年年度报告摘要	指定网站	2020年3月27日
6	北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金2019年年度报告	指定网站	2020年3月27日
7	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金2019年年度报告提示性公告	上海证券报、指定网站	2020年3月27日
8	北信瑞丰基金管理有限公司关于调整基金经理的公告	上海证券报、指定网站	2020年4月9日
9	北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金2020年第1季度报告	指定网站	2020年4月22日
10	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金2020年第1季度报告提示性公告	上海证券报、指定网站	2020年4月22日
11	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下证券投资基金修改基金合同的公告	上海证券报、指定网站	2020年5月26日
12	北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金基金合同	指定网站	2020年5月26日
13	北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金托管协议	指定网站	2020年5月26日
14	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券估值调整的提示性公告	上海证券报、指定网站	2020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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200207-20200304	-	7,503,752.34	-	7,503,752.34	19.91%
	2	20200305-20200630	-	18,638,397.01	-	18,638,397.01	49.47%
	3	20200113-20200113 20200204-20200206	597,609.56	-	-	597,609.56	1.59%
	4	20200207-20200630	-	9,379,924.95	-	9,379,924.95	24.89%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

注：1、管理人按照基金合同独立进行投资决策，不存在通过投资顾问或其他方式让渡投资决策权的情况；

2、管理人已制定投资者集中度管理制度，根据该制度管理人将不再接受份额占比已经达到或超过 50%的单一投资者的新增申购；管理人将严格按照相关法规及基金合同审慎确认大额申购与大额赎回，加强流动性管理；

3、因本基金存在单一投资者持有基金份额比例较为集中（超过 20%）的情况，持有基金份额比例集中的投资者（超过 20%）申请全部或大比例赎回时，会给基金资产变现带来压力，进而造成基金净值下跌压力。因此，提醒投资者本产品存在单一投资者持有基金份额比较集中（超过 20%）而特有的流动性风险。但在巨额赎回情况下管理人将采取相应赎回限制等措施，以保障中小投资者合法权益。

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鼎利债券型证券投资基金的文件。
- 2、北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金合同。
- 3、北信瑞丰鼎利债券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

北京市海淀区西三环北路 100 号光耀东方中心 A 座 6 层、25 层

12.3 查阅方式

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

北信瑞丰基金管理有限公司

2020 年 8 月 29 日