

# 北信瑞丰丰利混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2022 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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                              | 5         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 6         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 9         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 9         |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 12        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 12        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>40</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 40        |
| 7.2 报告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                   | 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    | 45        |
| 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        | 本基金投资股指期货的投资政策                    | 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                          | 45        |
| <b>§ 8</b>  | <b>基金份额持有人信息</b>                  | <b>47</b> |
| 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        |
| <b>§ 9</b>  | <b>开放式基金份额变动</b>                  | <b>47</b> |
| <b>§ 10</b> | <b>重大事件揭示</b>                     | <b>48</b> |
| 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        |
| <b>§ 11</b> | <b>影响投资者决策的其他重要信息</b>             | <b>51</b> |
| 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                    | 52        |
| <b>§ 12</b> | <b>备查文件目录</b>                     | <b>52</b> |
| 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       | 北信瑞丰丰利混合型证券投资基金  |
| 基金简称       | 北信瑞丰丰利           |
| 基金主代码      | 002745           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2018 年 6 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      | 北京银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 141,131,710.80 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金主要投资于股票等权益类资产和债券等固定收益类金融工具，通过科学的资产配置与严谨的风险管理，力争超越业绩比较基准、实现基金资产持续稳定增值。 |
| 投资策略   | 主要包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略。                               |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×20%+中债总财富指数收益率×80%  |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。      |

### 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                                   | 张恩源                 |
|         | 联系电话                                 | 010-68619341        |
|         | 电子邮箱                                 | service@bxrfund.com |
| 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                                  | 霍学文                 |

### 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》  |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.bxrfund.com">http://www.bxrfund.com</a> |

|            |                  |
|------------|------------------|
| 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

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日） |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 2,139,923.62                        |
| 本期利润          | 4,783,585.87                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0561                              |
| 本期加权平均净值利润率   | 5.11%                               |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.77%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2022 年 6 月 30 日）               |
| 期末可供分配利润      | 17,648,267.63                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1250                              |
| 期末基金资产净值      | 158,779,978.43                      |
| 期末基金份额净值      | 1.1250                              |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末（2022 年 6 月 30 日）               |
| 基金份额累计净值增长率   | 8.70%                               |

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

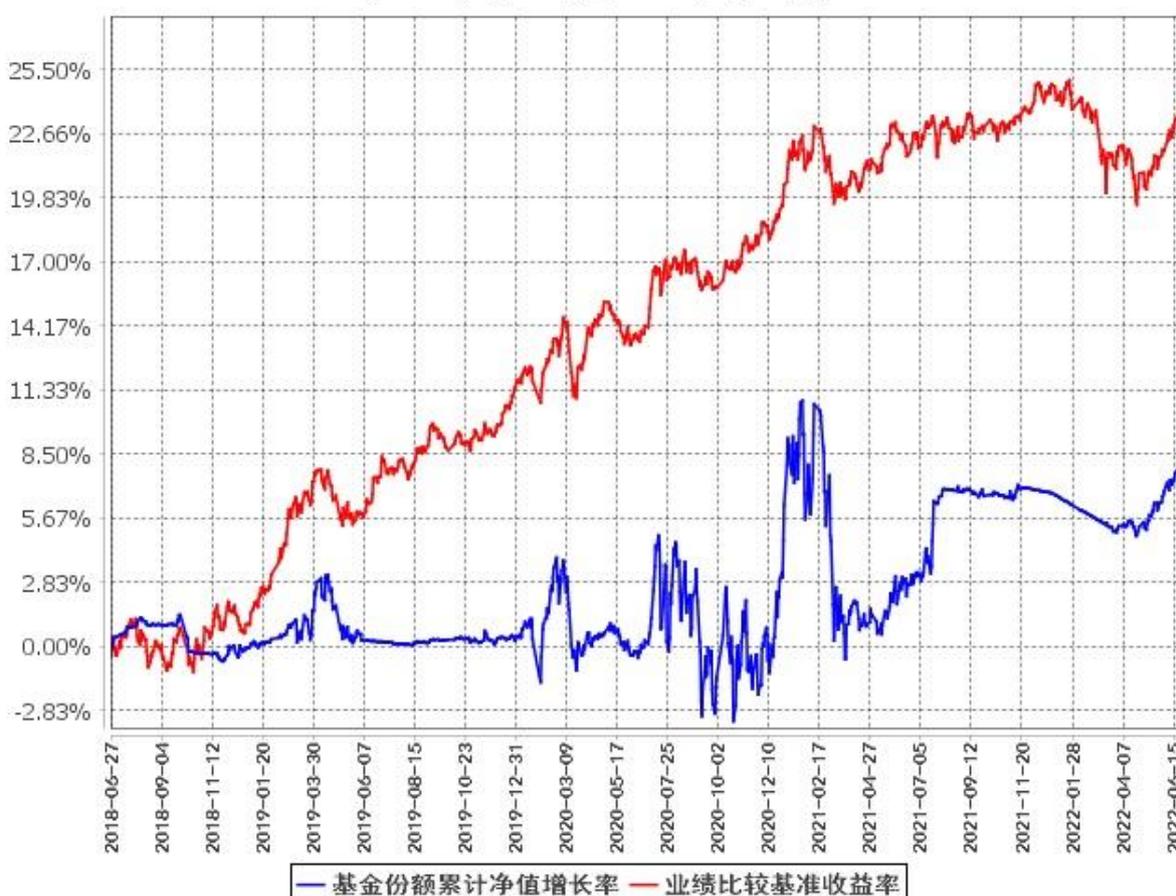
| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月 | 1.93%    | 0.24%       | 1.84%      | 0.21%         | 0.09% | 0.03% |

|            |       |       |        |       |         |        |
|------------|-------|-------|--------|-------|---------|--------|
| 过去三个月      | 3.34% | 0.18% | 2.06%  | 0.28% | 1.28%   | -0.10% |
| 过去六个月      | 1.77% | 0.14% | -0.52% | 0.30% | 2.29%   | -0.16% |
| 过去一年       | 5.25% | 0.18% | 1.26%  | 0.26% | 3.99%   | -0.08% |
| 过去三年       | 8.44% | 0.57% | 15.55% | 0.25% | -7.11%  | 0.32%  |
| 自基金合同生效起至今 | 8.70% | 0.51% | 24.22% | 0.26% | -15.52% | 0.25%  |

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×20%+中债总财富指数收益率×80%。沪深 300 指数选取了 A 股市场上规模最大、流动性最好的 300 只股票作为其成份股，较好地反映了 A 股市场的总体趋势，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。中债总财富指数的编制参考了中国债券市场中部分核心成员的收益率估值数据，以更好地反映债券价格信息，是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准，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  
(2018年6月27日至2022年6月30日)



注：本报告期本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

## § 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，公司共存续 18 只公募产品，保有 30 只专户产品，资产管理规模 135.20 亿元，其中公募资产管理规模 77.49 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）<br>期限 |      | 证券<br>从业<br>年限 | 说明   |
|----|-----------------|---------------------|------|----------------|--|
|    |                 | 任职日期                | 离任日期 |                |  |
| 陈皓 | 本基金<br>基金经<br>理 | 2021 年 3 月 26 日     | -    | 7              | 陈皓先生，意大利威尼斯东方大学经济与组织专业博士学位，从事宏观研究及债券研究相关工作 7 年。曾任职于盛景网联企业管理顾问股份有限公司及合众人寿保险股份有限公司，从事咨询及大类资产配置相关工作。2014 年 7 月加入北信瑞丰基金管理有限公司，现任公司固收投资部基金经理。 |
| 林翟 | 本基金<br>基金经<br>理 | 2022 年 3 月 7 日      | -    | 12             | 林翟先生，厦门大学应用经济学硕士，从事证券业 12 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，现任固收投资二部基金经理。    |

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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规及各项实施准则规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律规定，严格执行《北信瑞丰基金管理有限公司公平交易管理办法》、《北信瑞丰基金管理有限公司异常交易监控管理办法》等公平交易制度要求，通过系统和人工等方式在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、综合平衡、比例实施、保证各基金间的利益公平”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。在事后监控环节，本基金管理人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。

## 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

新年伊始，受通胀影响，市场对美联储货币政策收紧的预期急速升温，风险偏好急速下降，权益上涨戛然而止，债券市场随之上涨。行至 2 月中下旬，俄乌冲突爆发，通胀预期进一步升温，权益市场再下一个台阶，债券市场受通胀预期影响开始回落。3 月中下旬，上海疫情爆发，市场对经济前景极度悲观，市场开始交易衰退预期，因此权益市场继续急速杀跌，而债券市场随之上涨。4 月下旬，很多机构产品净值或已在止损点附近，引发了一波止损盘出清，随即市场迎来一波快速反弹，而此时货币政策较为宽松，经济前景预期仍然不明朗，因此债券市场依然继续上涨。行至 5 月底，风险偏好开始回升，股票市场(尤其是优质成长股)已经收复了上海疫情以来的跌幅继续上行，此时对下半年的经济复苏预期(宽信用)导致债券市场开始调整。由于本产品定位为相对稳健，所以底部增加了权益敞口。债券部分继续采用票息、杠杆和骑乘策略，并保持较低久期。由于债券部分比较稳健，并未影响产品净值，而权益仓位的增加使得本产品净值稳步上涨。

从企业的生命周期理论看，企业会经历导入期、成长期、成熟期和衰退期。导入期标的由于其业绩主要靠“想象”，故不在我们考虑范围之内，而衰退期主要是一些夕阳行业，业绩增长乏力，以传统周期股为主，也不在我们考虑范围之内，当然如果周期股业绩增速特别高的阶段也能进入候选池。成长期的股票只要价格合适是具有长期 alpha 的，成熟期的标的由于其业绩稳定，虽然增速已经降下来了，但在经济下行期是能跑赢大部分股票的。所以我们选股主要在成长期和成熟期展开。针对成长期和成熟期我们利用量化选股模型去刻画其风险收益特征，并且不做“主观”的风格择时和个股择时，交易所统计过择时的收益，绝大多数人包括机构择时都是负收益。但在每个子策略的因子权重部分，我们是设计加入了一些“客观”择时因素的，这样可以给一些强势标的更高的权重。

关于基金产品的选择，投资者一定要了解清楚基金产品的定位和基金经理的风格。并不是短期收益越高越好，也不是某一段时间跑输对应的基准或者同类产品就不好，一定要综合考虑这段时间基金经理的风格与市场风格是否有错配或者共振。比如去年 2 月份以来，价值成长风格的基金产品跑不赢指数，并不能说这类型的基金经理选股能力差，拉长看价值成长风格是有 alpha 的。再比如过去 3 年专注新能源赛道的成长风格产品跑赢指数，同样我们也不能认为基金经理未来会持续创造 alpha。风格的 beta 可以让基金经理或者基金产品短期脱颖而出，但投资者一定要仔细分析、谨慎选择投资产品，如果该基金经理风格正好符合你的风格偏好，那我们就做时间的朋友，给与其回撤阶段适当的容忍度，在其踩对风格阶段也要清楚的知道这可能只是风格共振带来的 beta 而已，不要倾其所有去申购该产品，一定要做好风险控制，包括大类资产配置、仓位分配等等。

#### 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 1.1250 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.77%；同期业绩比较基准收益率为-0.52%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着老龄化程度的加剧，未来债券收益率长期下行趋势不改，而基金经理本人对高收益债的投资又心存敬畏，因此纯债底仓部分的收益率会逐年降低。

反观权益市场，基金经理认为权益大时代序幕已经拉开，未来十年是权益市场的黄金十年。高层已经关注到不能任由房地产行业独大，否则对经济结构、社会创新都有强大的破坏力。房地产已是明日黄花，需要新能源、新技术、新产业来接棒，而发展新产业需要资本市场的深度参与。在此背景下，高层频频推出相应的政策：注册制(优胜劣汰，炒小炒烂或成为过去)、基金经理与产品业绩深度绑定(自己必须买自己管理的产品，可以有效减少委托代理问题，也就是说鼓励基金经理赚长钱而不是赚快钱，利好绩优股)、个人养老金入市(增量资金)、完善衍生品市场为风险管理提供工具(以后风险管理的成本会更低，收益会有增厚)、完善可转债市场参与者结构和涨跌幅限制(不鼓励炒烂，保护中小投资者)。未来我们会继续保持一定的权益仓位，在产品收益相对稳健的同时，尽可能为持有人创造超额收益。

#### 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、交易人员、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 7 月 12 日至 2022 年 3 月 15 日期间资产净值低于伍仟万元，已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。截至报告期末，本基金资产净值已不低于伍仟万元。

## § 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

在本报告期内，本基金托管人在托管北信瑞丰丰利混合型证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

在本报告期内，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、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，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

本基金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(注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容，复核内容真实、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：北信瑞丰丰利混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号        | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                                |                                  |
| 银行存款          | 6.4.7.1    | 525,924.07                     | 3,862,787.88                     |
| 结算备付金         |            | 842,821.95                     | 3,206.60                         |
| 存出保证金         |            | 30,621.06                      | 3,510.94                         |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 154,087,401.37                 | 307,712.30                       |
| 其中：股票投资       |            | 15,471,091.90                  | -                                |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | 138,616,309.47                 | 307,712.30                       |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资         |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | 4,000,000.00                   | -                                |
| 债权投资          | 6.4.7.5    | -                              | -                                |
| 其中：债券投资       |            | -                              | -                                |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 其他债权投资        |            | -                              | -                                |
| 其他权益工具投资      |            | -                              | -                                |
| 应收清算款         |            | 1,002,148.75                   | -                                |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 99.92                          | -                                |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.6    | -                              | 5,303.07                         |
| 资产总计          |            | 160,489,017.12                 | 4,182,520.79                     |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2021 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                                |                                  |
| 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   |         | 200,000.00     | -            |
| 应付清算款       |         | 1,304,121.58   | -            |
| 应付赎回款       |         | 30.75          | 15.61        |
| 应付管理人报酬     |         | 77,403.62      | 2,149.97     |
| 应付托管费       |         | 12,900.62      | 358.30       |
| 应付销售服务费     |         | -              | -            |
| 应付投资顾问费     |         | -              | -            |
| 应交税费        |         | 9,529.46       | -            |
| 应付利润        |         | -              | -            |
| 递延所得税负债     |         | -              | -            |
| 其他负债        | 6.4.7.7 | 105,052.66     | 49,785.58    |
| 负债合计        |         | 1,709,038.69   | 52,309.46    |
| <b>净资产：</b> |         |                |              |
| 实收基金        | 6.4.7.8 | 141,131,710.80 | 3,736,490.45 |
| 其他综合收益      |         | -              | -            |
| 未分配利润       | 6.4.7.9 | 17,648,267.63  | 393,720.88   |
| 净资产合计       |         | 158,779,978.43 | 4,130,211.33 |
| 负债和净资产总计    |         | 160,489,017.12 | 4,182,520.79 |

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1250 元，基金份额总额 141,131,710.80 份。

## 6.2 利润表

会计主体：北信瑞丰丰利混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021<br>年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>    |          | 5,220,188.45                             | -45,645.11                                    |
| 1. 利息收入           |          | 55,719.00                                | 18,761.22                                     |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.10 | 17,656.45                                | 9,654.04                                      |
| 债券利息收入            |          | -  | 8,666.28                                      |
| 资产支持证券利息收入        |          | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入        |          | 38,062.55                                | 440.90  |
| 证券出借利息收入          |          | -  | -   |
| 其他利息收入            |          | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 2,520,698.96                             | 553,037.83                                    |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.11 | 390,679.26                               | 394,118.71                                    |

|                                 |            |              |             |
|---------------------------------|------------|--------------|-------------|
| 基金投资收益                          |            | -            | -           |
| 债券投资收益                          | 6.4.7.12   | 1,996,152.89 | 153,641.32  |
| 资产支持证券投资<br>收益                  | 6.4.7.13   | -            | -           |
| 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   | 133,866.81   | 5,277.80    |
| 以摊余成本计量的<br>金融资产终止确认产<br>生的收益   |            | -            | -           |
| 其他投资收益                          |            | -            | -           |
| 3. 公允价值变动收益<br>(损失以“-”号填列)      | 6.4.7.17   | 2,643,662.25 | -618,524.46 |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”<br>号填列)          |            | -            | -           |
| 5. 其他收入(损失以“-”<br>号填列)          | 6.4.7.18   | 108.24       | 1,080.30    |
| <b>减：二、营业总支出</b>                |            | 436,602.58   | 71,916.12   |
| 1. 管理人报酬                        | 6.4.10.2.1 | 273,575.47   | 17,045.61   |
| 2. 托管费                          | 6.4.10.2.2 | 45,595.93    | 2,840.90    |
| 3. 销售服务费                        | 6.4.10.2.3 | -            | -           |
| 4. 投资顾问费                        |            | -            | -           |
| 5. 利息支出                         |            | 17,407.39    | -           |
| 其中：卖出回购金融资<br>产支出               |            | 17,407.39    | -           |
| 6. 信用减值损失                       |            | -            | -           |
| 7. 税金及附加                        |            | 3,232.55     | 6.52        |
| 8. 其他费用                         | 6.4.7.19   | 96,791.24    | 52,023.09   |
| <b>三、利润总额(亏损总<br/>额以“-”号填列)</b> |            | 4,783,585.87 | -117,561.23 |
| 减：所得税费用                         |            | -            | -           |
| <b>四、净利润(净亏损以<br/>“-”号填列)</b>   |            | 4,783,585.87 | -117,561.23 |
| <b>五、其他综合收益的税<br/>后净额</b>       |            | -            | -           |
| <b>六、综合收益总额</b>                 |            | 4,783,585.87 | -117,561.23 |

### 6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：北信瑞丰丰利混合型证券投资基金

本报告期：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日      |        |               |                |
|--|--|--------|---------------|----------------|
|  | 实收基金                                       | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产（基金净值）                          | 3,736,490.45                               | -      | 393,720.88    | 4,130,211.33   |
| 加：会计政策变更                                 | -  | -      | -             | -              |
| 前期差错更正                                   | -  | -      | -             | -              |
| 其他                                       | -  | -      | -             | -              |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 3,736,490.45                               | -      | 393,720.88    | 4,130,211.33   |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 137,395,220.35                             | -      | 17,254,546.75 | 154,649,767.10 |
| （一）、综合收益总额                               | -  | -      | 4,783,585.87  | 4,783,585.87   |
| （二）、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）      | 137,395,220.35                             | -      | 12,470,960.88 | 149,866,181.23 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 137,534,048.60                             | -      | 12,484,651.33 | 150,018,699.93 |
| 2. 基金赎回款                                 | -138,828.25                                | -      | -13,690.45    | -152,518.70    |
| （三）、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） | -  | -      | -             | -              |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -  | -      | -             | -              |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 141,131,710.80                             | -      | 17,648,267.63 | 158,779,978.43 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |        |               |                |
|  | 实收基金                                       | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产（基金净值）                          | 7,721,242.91                               | -      | 768,866.85    | 8,490,109.76   |
| 加：会计政策变更                                 | -  | -      | -             | -              |
| 前期差错更正                                   | -  | -      | -             | -              |
| 其他                                       | -  | -      | -             | -              |

|  |               |   |             |               |
|--|---------------|---|-------------|---------------|
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 7,721,242.91  | - | 768,866.85  | 8,490,109.76  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -3,302,878.30 | - | -464,661.71 | -3,767,540.01 |
| （一）、综合收益总额                               | -             | - | -117,561.23 | -117,561.23   |
| （二）、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）      | -3,302,878.30 | - | -347,100.48 | -3,649,978.78 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 234,856.64    | - | 21,126.78   | 255,983.42    |
| 2. 基金赎回款                                 | -3,537,734.94 | - | -368,227.26 | -3,905,962.20 |
| （三）、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） | -             | - | -           | -             |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -             | - | -           | -             |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 4,418,364.61  | - | 304,205.14  | 4,722,569.75  |

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：

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| 赵远峰      | 李惠军       | 姜晴      |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

北信瑞丰丰利混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后转型而来。根据北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金的基金管理人北信瑞丰基金管理有限公司于 2018 年 6 月 15 日发布《关于北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型相关业务规则的公告》，北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金转型为非保本的混合型证券投资基金，基金名称相应变更为“北信瑞丰丰利混合型证券投资基金”，北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金份额转换为北信瑞丰丰利混合型证券投资基金份额。转型后，基金的托管

人、登记机构、基金代码不变。自 2018 年 6 月 27 日起《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金合同》、《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金托管协议》生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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《中华人民共和国证券投资基金法》和《北信瑞丰丰利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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具，债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金持有股票资产占基金资产的 0%-40%；其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款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。权证投资占基金资产净值的比例不超过 3%；每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，现金或到期日在一年以内的政府债券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：沪深 300 指数收益率×20%+中债总财富指数收益率×80%。

#### 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》、《北信瑞丰丰利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。

本财务报表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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金本报告期会计报表所采用的会计

政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

## 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融资产和金融负债的分类

##### 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

## 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (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、债券投资和资产支持证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。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。

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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (b) 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损

益的金融资产和金融负债，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或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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；对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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或资产支持证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。

#### (c) 收入/(损失)的确认和计量

##### 新金融工具准则

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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，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。

##### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。债券投资和资产支持证券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发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值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。

#### (d) 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。

以摊余成本计量的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。

#### (e) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收利息，金额分别为 3,862,787.88 元、3,206.60 元、3,510.94 元和 5,303.07 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和其他资产-应收利息，金额分别为 3,863,204.66 元、3,208.25 元、3,512.70 元和 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 307,712.30 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 312,595.18 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 15.61 元、2,149.97 元、358.30 元、785.57 元和 49,000.01 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 15.61 元、2,149.97 元、

358.30 元、785.57 元和 49,000.01 元。

(ii) 于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日, 本基金根据新金融工具准则下的计量类别, 将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示, 无期初留存收益影响。

(f) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》, 本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露, 这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 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)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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<br>2022 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------|
| 活期存款            | 525,924.07             |
| 等于: 本金          | 525,753.47             |
| 加: 应计利息         | 170.60                 |
| 减: 坏账准备         | -                      |
| 定期存款            | -                      |
| 等于: 本金          | -                      |
| 加: 应计利息         | -                      |
| 减: 坏账准备         | -                      |
| 其中: 存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月     | -                      |
| 存款期限 3 个月以上     | -                      |
| 其他存款            | -                      |
| 等于: 本金          | -                      |
| 加: 应计利息         | -                      |
| 减: 坏账准备         | -                      |
| 合计              | 525,924.07             |

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022年6月30日 |                |                |                |
|---------------|-------------------|----------------|----------------|----------------|
|               | 成本                | 应计利息           | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | 14,147,684.99     | -              | 15,471,091.90  | 1,323,406.91   |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                 | -              | -              | -              |
| 债券            | 交易所市场             | 134,870,747.89 | 2,432,629.47   | 138,616,309.47 |
|               | 银行间市场             | -              | -              | -              |
|               | 合计                | 134,870,747.89 | 2,432,629.47   | 138,616,309.47 |
| 资产支持证券        | -                 | -              | -              | -              |
| 基金            | -                 | -              | -              | -              |
| 其他            | -                 | -              | -              | -              |
| 合计            | 149,018,432.88    | 2,432,629.47   | 154,087,401.37 | 2,636,339.02   |

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末本基金无衍生金融资产或负债。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 4,000,000.00      | -         |
| 银行间市场 | -                 | -         |
| 合计    | 4,000,000.00      | -         |

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.5 债权投资

本期末本基金无债权投资。

## 6.4.7.6 其他资产

本期末本基金无其他资产。

## 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | 11,961.42              |
| 其中：交易所市场    | 11,961.42              |
| 银行间市场       | -                      |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 93,091.24              |
| 合计          | 105,052.66             |

## 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 3,736,490.45                          | 3,736,490.45   |
| 本期申购          | 137,534,048.60                        | 137,534,048.60 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -138,828.25                           | -138,828.25    |
| 本期末           | 141,131,710.80                        | 141,131,710.80 |

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.9 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       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期期初           | 628,202.96    | -234,482.08   | 393,720.88    |
| 本期利润           | 2,139,923.62  | 2,643,662.25  | 4,783,585.87  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 21,119,360.14 | -8,648,399.26 | 12,470,960.88 |
| 其中：基金申购款       | 21,141,401.11 | -8,656,749.78 | 12,484,651.33 |
| 基金赎回款          | -22,040.97    | 8,350.52      | -13,690.45    |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 23,887,486.72 | -6,239,219.09 | 17,648,267.63 |

## 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日<br>至 2022 年 6 月 30 日 |
|----|---|
|    |   |

|           |           |
|-----------|-----------|
| 活期存款利息收入  | 13,250.42 |
| 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 | 4,288.65  |
| 其他        | 117.38    |
| 合计        | 17,656.45 |

#### 6.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2022年1月1日<br>至2022年6月30日 |
|------------|--------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 2,855,548.82                   |
| 减：卖出股票成本总额 | 2,446,218.68                   |
| 减：交易费用     | 18,650.88                      |
| 买卖股票差价收入   | 390,679.26                     |

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2022年1月1日<br>至2022年6月30日 |
|------------------------------|--------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 1,215,708.46                   |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 780,444.43                     |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                              |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                              |
| 合计                           | 1,996,152.89                   |

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2022年1月1日<br>至2022年6月30日 |
|------------------------|--------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 43,280,252.14                  |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 41,486,587.33                  |
| 减：应计利息总额               | 1,011,887.64                   |
| 减：交易费用                 | 1,332.74                       |
| 买卖债券差价收入               | 780,444.43                     |

**6.4.7.13 资产支持证券投资收益**

本期本基金无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本期本基金无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本期本基金无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022年1月1日<br>至2022年6月30日 |
|---------------|--------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 133,866.81                     |
| 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            | 133,866.81                     |

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2022年1月1日<br>至2022年6月30日 |
|------------------------|--------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 2,643,662.25                   |
| ——股票投资                 | 1,323,406.91                   |
| ——债券投资                 | 1,320,255.34                   |
| ——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                     | 2,643,662.25                   |

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022年1月1日 |
|----|-----------------|
|----|-----------------|

|         | 至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------|-------------------|
| 基金赎回费收入 | 108.24            |
| 合计      | 108.24            |

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日<br>至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------|---|
| 审计费用    | 19,927.19                                 |
| 信息披露费   | 73,164.05                                 |
| 证券出借违约金 | -   |
| 账户维护费   | 3,100.00                                  |
| 银行费用    | 300.00                                    |
| 其他      | 300.00                                    |
| 合计      | 96,791.24                                 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期及上年度可比期间，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022年1月1日<br>至2022年6月30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日<br>至2021年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 273,575.47                     | 17,045.61                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 5,955.09                       | 8,326.49                            |

注：1. 自2020年1月1日至2020年12月29日，支付基金管理人北信瑞丰基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

2. 根据基金管理人北信瑞丰基金于2020年12月30日发布的《关于北信瑞丰丰利混合型证券投资基金调整基金管理费率及托管费率的公告》，自2020年12月30日起，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 × 0.60% / 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。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022年1月1日<br>至2022年6月30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日<br>至2021年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 45,595.93                      | 2,840.90                            |

注：1. 自2020年1月1日至2020年12月29日，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0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

2. 根据基金管理人北信瑞丰基金于2020年12月30日发布的《关于北信瑞丰丰利混合型证券投资基金调整基金管理费率及托管费率的公告》，自2020年12月30日起，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 × 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本期及上年度可比期间，本基金未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期及上年度可比期间，本基金基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末及上年度末，其他关联方未持有本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021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  | 525,924.07                 | 13,250.42 | 4,250,170.00                    | 9,541.35 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人北京银行保管，按约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期及上年度可比期间，本基金未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本期及上年度可比期间，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本期本基金未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2022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

本期末本基金无暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本期末本基金无银行间市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，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 200,000.00 元，于 2022 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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

本基金为混合型证券投资基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过相对灵活的资产配置，追求实现基金资产的持续稳定增值。

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

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

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

靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人北京银行，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，本基金无按短期信用评级列示的债券投资。

##### 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，本基金无按短期信用评级列示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，本基金无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 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<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 99,287,013.08     | -                   |
| AAA 以下 | 30,685,767.49     | -                   |
| 未评级    | -                 | -                   |
| 合计     | 129,972,780.57    | -                   |

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、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，本基金无按长期信用评级列示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，本基金无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 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、存出保证金和债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022 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                   | 525,924.07 | -     | -     | -   | 525,924.07 |
| 结算备付金                  | 842,821.95 | -     | -     | -   | 842,821.95 |

|                          |               |               |       |               |                |
|--------------------------|---------------|---------------|-------|---------------|----------------|
| 存出保证金                    | 30,621.06     | -             | -     | -             | 30,621.06      |
| 交易性金融资产                  | 56,553,151.93 | 82,063,157.54 | -     | 15,471,091.90 | 154,087,401.37 |
| 买入返售金融资产                 | 4,000,000.00  | -             | -     | -             | 4,000,000.00   |
| 应收证券清算款                  | -             | -             | -     | 1,002,148.75  | 1,002,148.75   |
| 应收申购款                    | -             | -             | -     | 99.92         | 99.92          |
| 资产总计                     | 61,952,519.01 | 82,063,157.54 | -     | 16,473,340.57 | 160,489,017.12 |
| 负债                       |               |               |       |               |                |
| 卖出回购金融资产款                | 200,000.00    | -             | -     | -             | 200,000.00     |
| 应付证券清算款                  | -             | -             | -     | 1,304,121.58  | 1,304,121.58   |
| 应付赎回款                    | -             | -             | -     | 30.75         | 30.75          |
| 应付管理人报酬                  | -             | -             | -     | 77,403.62     | 77,403.62      |
| 应付托管费                    | -             | -             | -     | 12,900.62     | 12,900.62      |
| 应交税费                     | -             | -             | -     | 9,529.46      | 9,529.46       |
| 其他负债                     | -             | -             | -     | 105,052.66    | 105,052.66     |
| 负债总计                     | 200,000.00    | -             | -     | 1,509,038.69  | 1,709,038.69   |
| 利率敏感度缺口                  | 61,752,519.01 | 82,063,157.54 | -     | 14,964,301.88 | 158,779,978.43 |
| 上年度末<br>2021 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                     | 3,862,787.88  | -             | -     | -             | 3,862,787.88   |
| 结算备付金                    | 3,206.60      | -             | -     | -             | 3,206.60       |
| 存出保证金                    | 3,510.94      | -             | -     | -             | 3,510.94       |
| 交易性金融资产                  | -             | 307,712.30    | -     | -             | 307,712.30     |
| 其他资产                     | -             | -             | -     | 5,303.07      | 5,303.07       |
| 资产总计                     | 3,869,505.42  | 307,712.30    | -     | 5,303.07      | 4,182,520.79   |
| 负债                       |               |               |       |               |                |
| 应付赎回款                    | -             | -             | -     | 15.61         | 15.61          |
| 应付管理人报酬                  | -             | -             | -     | 2,149.97      | 2,149.97       |
| 应付托管费                    | -             | -             | -     | 358.30        | 358.30         |
| 其他负债                     | -             | -             | -     | 49,785.58     | 49,785.58      |
| 负债总计                     | -             | -             | -     | 52,309.46     | 52,309.46      |
| 利率敏感度缺口                  | 3,869,505.42  | 307,712.30    | -     | -47,006.39    | 4,130,211.33   |

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 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（2022 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2021 年 12 月 31 日） |
|           | 1. 市场利率下降 25 个基点   |                             | 547,841.65             |
| 2. 市场利率上升 |                    | -542,250.80                 | -96.37                 |

|  |        |  |  |
|--|--------|--|--|
|  | 25 个基点 |  |  |
|--|--------|--|--|

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 80%-95%，债券以及中国证监会允许基金投资的其他资产占基金资产的比例不高于 20%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；资产支持证券投资比例不得超过基金资产净值的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。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<br>2022 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>2021 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  | 15,471,091.90          | 9.74          | -                        | -             |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                      | -             | -                        | -             |
| 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 | 15,471,091.90 | 9.74 | - | - |
|----|---------------|------|---|---|

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设                       | 除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变 |                             |                   |
|--------------------------|--------------------------------|-----------------------------|-------------------|
| 分析                       | 相关风险变量的变动                      | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元) |                   |
|                          |                                | 本期末(2022年6月30日)             | 上年度末(2021年12月31日) |
|                          | 1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%       | -                           | 7,436.45          |
| 2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5% | -                              | -7,436.45                   |                   |

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次          | 32,429,169.17     | -                   |
| 第二层次          | 121,658,232.20    | 307,712.30          |
| 第三层次          | -                 | -                   |
| 合计            | 154,087,401.37    | 307,712.30          |

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 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(2021 年 12 月 31 日:同)。

### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 15,471,091.90  | 9.64          |
|    | 其中:股票             | 15,471,091.90  | 9.64          |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 138,616,309.47 | 86.37         |
|    | 其中:债券             | 138,616,309.47 | 86.37         |
|    | 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          | 4,000,000.00   | 2.49          |
|    | 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      | 1,368,746.02   | 0.85          |
| 8  | 其他各项资产            | 1,032,869.73   | 0.64          |
| 9  | 合计                | 160,489,017.12 | 100.00        |

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

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别     | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | -             | -             |
| B  | 采矿业      | -             | -             |
| C  | 制造业      | 13,535,991.90 | 8.52          |

|   |                  |               |      |
|---|------------------|---------------|------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 314,500.00    | 0.20 |
| E | 建筑业              | -             | -    |
| F | 批发和零售业           | -             | -    |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 567,000.00    | 0.36 |
| 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              | 671,000.00    | 0.42 |
| K | 房地产业             | -             | -    |
| L | 租赁和商务服务业         | -             | -    |
| M | 科学研究和技术服务业       | -             | -    |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 279,600.00    | 0.18 |
| 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        | 103,000.00    | 0.06 |
| S | 综合               | -             | -    |
|   | 合计               | 15,471,091.90 | 9.74 |

注：以上行业分类以 2022 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港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的港股通投资股票投资组合。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 000858 | 五粮液  | 30,000 | 6,057,900.00 | 3.82         |
| 2  | 600702 | 舍得酒业 | 8,000  | 1,631,920.00 | 1.03         |
| 3  | 600887 | 伊利股份 | 20,000 | 779,000.00   | 0.49         |
| 4  | 600009 | 上海机场 | 10,000 | 567,000.00   | 0.36         |
| 5  | 300059 | 东方财富 | 22,000 | 558,800.00   | 0.35         |
| 6  | 600309 | 万华化学 | 5,000  | 484,950.00   | 0.31         |
| 7  | 603043 | 广州酒家 | 15,000 | 378,300.00   | 0.24         |
| 8  | 603501 | 韦尔股份 | 2,000  | 346,060.00   | 0.22         |
| 9  | 002078 | 太阳纸业 | 28,000 | 344,680.00   | 0.22         |
| 10 | 603899 | 晨光股份 | 6,000  | 336,480.00   | 0.21         |
| 11 | 600905 | 三峡能源 | 50,000 | 314,500.00   | 0.20         |
| 12 | 603486 | 科沃斯  | 2,000  | 243,780.00   | 0.15         |
| 13 | 600745 | 闻泰科技 | 2,000  | 170,220.00   | 0.11         |
| 14 | 000301 | 东方盛虹 | 10,000 | 169,100.00   | 0.11         |
| 15 | 601330 | 绿色动力 | 20,000 | 156,600.00   | 0.10         |
| 16 | 605007 | 五洲特纸 | 8,000  | 155,520.00   | 0.10         |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 17 | 002415 | 海康威视 | 4,000  | 144,800.00 | 0.09 |
| 18 | 002833 | 弘亚数控 | 8,000  | 133,440.00 | 0.08 |
| 19 | 688526 | 科前生物 | 5,000  | 129,950.00 | 0.08 |
| 20 | 000951 | 中国重汽 | 10,000 | 129,900.00 | 0.08 |
| 21 | 000596 | 古井贡酒 | 500    | 124,830.00 | 0.08 |
| 22 | 002867 | 周大生  | 8,000  | 124,240.00 | 0.08 |
| 23 | 600323 | 瀚蓝环境 | 6,000  | 123,000.00 | 0.08 |
| 24 | 603690 | 至纯科技 | 3,000  | 120,900.00 | 0.08 |
| 25 | 688186 | 广大特材 | 3,600  | 114,840.00 | 0.07 |
| 26 | 000776 | 广发证券 | 6,000  | 112,200.00 | 0.07 |
| 27 | 300715 | 凯伦股份 | 8,000  | 112,000.00 | 0.07 |
| 28 | 003006 | 百亚股份 | 9,000  | 111,060.00 | 0.07 |
| 29 | 300871 | 回盛生物 | 5,000  | 110,600.00 | 0.07 |
| 30 | 300951 | 博硕科技 | 2,250  | 105,997.50 | 0.07 |
| 31 | 688257 | 新锐股份 | 2,600  | 103,012.00 | 0.06 |
| 32 | 300788 | 中信出版 | 5,000  | 103,000.00 | 0.06 |
| 33 | 688093 | 世华科技 | 5,320  | 102,782.40 | 0.06 |
| 34 | 601233 | 桐昆股份 | 6,000  | 95,280.00  | 0.06 |
| 35 | 300852 | 四会富仕 | 2,500  | 92,000.00  | 0.06 |
| 36 | 688181 | 八亿时空 | 2,000  | 86,600.00  | 0.05 |
| 37 | 688388 | 嘉元科技 | 1,000  | 84,870.00  | 0.05 |
| 38 | 688155 | 先惠技术 | 800    | 83,360.00  | 0.05 |
| 39 | 002851 | 麦格米特 | 3,000  | 78,780.00  | 0.05 |
| 40 | 002493 | 荣盛石化 | 5,000  | 76,950.00  | 0.05 |
| 41 | 601686 | 友发集团 | 10,000 | 76,400.00  | 0.05 |
| 42 | 300529 | 健帆生物 | 1,000  | 50,890.00  | 0.03 |
| 43 | 000060 | 中金岭南 | 10,000 | 44,600.00  | 0.03 |

## 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  | 000858 | 五粮液  | 5,218,714.00 | 126.35          |
| 2  | 600702 | 舍得酒业 | 1,400,460.00 | 33.91           |
| 3  | 600887 | 伊利股份 | 772,777.00   | 18.71           |
| 4  | 600009 | 上海机场 | 526,816.00   | 12.76           |
| 5  | 300059 | 东方财富 | 506,470.00   | 12.26           |
| 6  | 600309 | 万华化学 | 490,000.00   | 11.86           |
| 7  | 002078 | 太阳纸业 | 355,260.00   | 8.60            |
| 8  | 603501 | 韦尔股份 | 345,785.03   | 8.37            |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 9  | 603043 | 广州酒家 | 339,083.60 | 8.21 |
| 10 | 603899 | 晨光股份 | 336,634.00 | 8.15 |
| 11 | 600905 | 三峡能源 | 310,000.00 | 7.51 |
| 12 | 603305 | 旭升股份 | 307,064.00 | 7.43 |
| 13 | 688006 | 杭可科技 | 268,495.86 | 6.50 |
| 14 | 688390 | 固德威  | 254,315.00 | 6.16 |
| 15 | 688598 | 金博股份 | 248,810.00 | 6.02 |
| 16 | 603486 | 科沃斯  | 244,980.00 | 5.93 |
| 17 | 688559 | 海目星  | 232,267.74 | 5.62 |
| 18 | 300763 | 锦浪科技 | 224,952.00 | 5.45 |
| 19 | 688599 | 天合光能 | 221,933.94 | 5.37 |
| 20 | 000301 | 东方盛虹 | 201,830.00 | 4.89 |
| 21 | 601330 | 绿色动力 | 175,800.00 | 4.26 |
| 22 | 600745 | 闻泰科技 | 164,418.00 | 3.98 |
| 23 | 002415 | 海康威视 | 145,200.00 | 3.52 |
| 24 | 605007 | 五洲特纸 | 139,536.00 | 3.38 |
| 25 | 002833 | 弘亚数控 | 136,198.60 | 3.30 |
| 26 | 300450 | 先导智能 | 135,672.00 | 3.28 |
| 27 | 688499 | 利元亨  | 126,163.47 | 3.05 |
| 28 | 688526 | 科前生物 | 125,839.48 | 3.05 |
| 29 | 000951 | 中国重汽 | 122,300.00 | 2.96 |
| 30 | 300788 | 中信出版 | 121,443.00 | 2.94 |
| 31 | 688518 | 联赢激光 | 119,819.00 | 2.90 |
| 32 | 603690 | 至纯科技 | 116,451.00 | 2.82 |
| 33 | 300715 | 凯伦股份 | 115,519.00 | 2.80 |
| 34 | 688388 | 嘉元科技 | 114,774.00 | 2.78 |
| 35 | 688093 | 世华科技 | 109,521.40 | 2.65 |
| 36 | 300457 | 赢合科技 | 109,200.00 | 2.64 |
| 37 | 300871 | 回盛生物 | 109,000.00 | 2.64 |
| 38 | 600323 | 瀚蓝环境 | 108,253.00 | 2.62 |
| 39 | 003006 | 百亚股份 | 108,184.00 | 2.62 |
| 40 | 002867 | 周大生  | 108,106.50 | 2.62 |
| 41 | 000776 | 广发证券 | 106,980.00 | 2.59 |
| 42 | 601233 | 桐昆股份 | 105,540.00 | 2.56 |
| 43 | 300852 | 四会富仕 | 102,240.00 | 2.48 |
| 44 | 688257 | 新锐股份 | 101,243.98 | 2.45 |
| 45 | 300951 | 博硕科技 | 99,872.00  | 2.42 |
| 46 | 688186 | 广大特材 | 99,629.07  | 2.41 |
| 47 | 603233 | 大参林  | 91,991.00  | 2.23 |
| 48 | 601686 | 友发集团 | 86,265.00  | 2.09 |
| 49 | 000596 | 古井贡酒 | 85,740.00  | 2.08 |

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

## 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额   | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|------------|-----------------|
| 1  | 603305 | 旭升股份 | 395,512.00 | 9.58            |
| 2  | 688006 | 杭可科技 | 340,931.90 | 8.25            |
| 3  | 688559 | 海目星  | 301,050.00 | 7.29            |
| 4  | 688390 | 固德威  | 300,634.00 | 7.28            |
| 5  | 688598 | 金博股份 | 277,208.68 | 6.71            |
| 6  | 688599 | 天合光能 | 244,123.22 | 5.91            |
| 7  | 300763 | 锦浪科技 | 238,774.00 | 5.78            |
| 8  | 688499 | 利元亨  | 158,202.20 | 3.83            |
| 9  | 300450 | 先导智能 | 146,216.00 | 3.54            |
| 10 | 688518 | 联赢激光 | 120,963.82 | 2.93            |
| 11 | 603233 | 大参林  | 98,755.00  | 2.39            |
| 12 | 300457 | 赢合科技 | 95,323.00  | 2.31            |
| 13 | 000301 | 东方盛虹 | 94,850.00  | 2.30            |
| 14 | 688388 | 嘉元科技 | 43,005.00  | 1.04            |

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 | 16,593,903.67 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,855,548.82  |

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      | 8,643,528.90   | 5.44          |
|    | 其中：政策性金融债 | 8,643,528.90   | 5.44          |
| 4  | 企业债券      | 104,617,045.77 | 65.89         |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -             |
| 6  | 中期票据      | -              | -             |
| 7  | 可转债（可交换债） | 25,355,734.80  | 15.97         |
| 8  | 同业存单      | -              | -             |
| 9  | 其他        | -              | -             |

|    |    |                |       |
|----|----|----------------|-------|
| 10 | 合计 | 138,616,309.47 | 87.30 |
|----|----|----------------|-------|

## 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  | 175244 | 20 淮矿 01 | 110,000 | 11,379,686.85 | 7.17         |
| 2  | 149286 | 20 鄂交 Y3 | 100,000 | 10,437,316.71 | 6.57         |
| 3  | 149191 | 20 广物 02 | 100,000 | 10,423,740.82 | 6.56         |
| 4  | 175305 | 20 鲁高 Y1 | 100,000 | 10,417,145.21 | 6.56         |
| 5  | 143082 | 18 陕燃 01 | 100,000 | 10,400,010.96 | 6.55         |

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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 | 30,621.06    |
| 2  | 应收清算款 | 1,002,148.75 |
| 3  | 应收股利  | -            |
| 4  | 应收利息  | -            |
| 5  | 应收申购款 | 99.92        |
| 6  | 其他应收款 | -            |
| 7  | 待摊费用  | -            |
| 8  | 其他    | -            |
| 9  | 合计    | 1,032,869.73 |

## 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  | 132018 | G 三峡 EB1 | 8,397,657.53 | 5.29          |
| 2  | 113051 | 节能转债     | 3,538,969.18 | 2.23          |
| 3  | 110079 | 杭银转债     | 2,255,083.40 | 1.42          |
| 4  | 110075 | 南航转债     | 1,398,370.68 | 0.88          |
| 5  | 123107 | 温氏转债     | 1,312,930.14 | 0.83          |
| 6  | 110048 | 福能转债     | 1,051,686.30 | 0.66          |
| 7  | 127032 | 苏行转债     | 681,600.82   | 0.43          |
| 8  | 113616 | 韦尔转债     | 638,610.96   | 0.40          |
| 9  | 113052 | 兴业转债     | 558,357.67   | 0.35          |
| 10 | 110081 | 闻泰转债     | 492,736.33   | 0.31          |
| 11 | 113626 | 伯特转债     | 485,184.38   | 0.31          |
| 12 | 127030 | 盛虹转债     | 472,735.64   | 0.30          |
| 13 | 110053 | 苏银转债     | 377,938.44   | 0.24          |
| 14 | 127018 | 本钢转债     | 353,989.73   | 0.22          |
| 15 | 110043 | 无锡转债     | 353,739.29   | 0.22          |
| 16 | 110047 | 山鹰转债     | 339,329.59   | 0.21          |
| 17 | 128029 | 太阳转债     | 325,195.89   | 0.20          |
| 18 | 118000 | 嘉元转债     | 281,356.66   | 0.18          |

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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 |
| 230          | 613,616.13    | 137,512,537.25 | 97.44% | 3,619,173.55 | 2.56%  |

### 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 | 9.57      | 0.0000%  |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员，基金投资和研发部门负责人持有本基金份额总量的数据区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数据区间为 0。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                |                |
|--------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2018 年 6 月 27 日）基金份额总额 | 76,139,669.47  |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 3,736,490.45   |
| 本报告期基金总申购份额                    | 137,534,048.60 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 138,828.25     |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）       | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 141,131,710.80 |

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，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

本报告期内，深圳市前海喜乐佳投资有限公司以管理人管理的资管产品的投资顾问与管理人共同对其持有的基金侵权等为由向广东省深圳市中级人民法院提起诉讼，要求投资顾问上海耀之资产管理中心(有限合伙)及管理人共同承担赔偿责任。

报告期内，未发生涉及基金财产、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 19,927.19 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

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易          |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 国盛证券 | 2      | 19,449,452.49 | 100.00%      | 14,223.30 | 100.00%    |    |
| 国联证券 | 2      | -             | -            | -         | -          |    |
| 联储证券 | 1      | -             | -            | -         | -          |    |
| 中信建投 | 2      | -             | -            | -         | -          |    |

|      |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - |
|------|---|---|---|---|---|

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

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

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

- ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本基金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 |
| 国盛证券 | 204,858,725.20 | 100.00%      | 597,900,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 国联证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 联储证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中信建投 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 东吴证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
- ii 公司财务状况良好。
- iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。
- iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，

并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本基金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  | 关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为代销机构的公告 | 中国证券报、公司网站 | 2022 年 1 月 21 日 |
| 2  | 关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金增加北京新浪仓石基金销售有限公司代销机构的公告  | 中国证券报、公司网站 | 2022 年 1 月 21 日 |
| 3  | 北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下部分基金招募说明书及基金产品资料概要更新的提示性公告   | 中国证券报、公司网站 | 2022 年 1 月 22 日 |
| 4  | 北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金产品资料概要更新                    | 公司网站       | 2022 年 1 月 22 日 |
| 5  | 北信瑞丰丰利混合型证券投资基金招募说明书更新                       | 公司网站       | 2022 年 1 月 22 日 |
| 6  | 北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告       | 中国证券报、公司网站 | 2022 年 1 月 24 日 |
| 7  | 北信瑞丰丰利混合型证券投资基金 2021 年第四季度报告                 | 公司网站       | 2022 年 1 月 24 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                      | 中国证券报、公司网站 | 2022 年 3 月 8 日  |
| 9  | 北信瑞丰丰利混合型证券投资基金招募说明书更新                       | 公司网站       | 2022 年 3 月 10 日 |
| 10 | 北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)                  | 公司网站       | 2022 年 3 月 10 日 |
| 11 | 北信瑞丰丰利混合型证券投资基金更新招募说明书及基金产品资料概要的提示性公告        | 中国证券报、公司网站 | 2022 年 3 月 10 日 |
| 12 | 关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下                             | 中国证券报、公司网站 | 2022 年 3 月 11 日 |

|    |  |            |                 |
|----|--|------------|-----------------|
|    | 全部基金增加北京创金启富基金销售有限公司为代销机构的公告             |            |                 |
| 13 | 关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下部分基金增加中国人寿为代销机构的公告       | 中国证券报、公司网站 | 2022 年 3 月 21 日 |
| 14 | 北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年度报告提示性公告        | 中国证券报、公司网站 | 2022 年 3 月 31 日 |
| 15 | 北信瑞丰丰利混合型证券投资基金 2021 年年度报告               | 公司网站       | 2022 年 3 月 31 日 |
| 16 | 北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告   | 中国证券报、公司网站 | 2022 年 4 月 22 日 |
| 17 | 北信瑞丰丰利混合型证券投资基金 2022 年第一季度报告             | 公司网站       | 2022 年 4 月 22 日 |
| 18 | 北信瑞丰基金管理有限公司董事变更情况的公告                    | 中国证券报、公司网站 | 2022 年 4 月 30 日 |
| 19 | 北信瑞丰基金管理有限公司关于终止部分代销机构代理销售旗下基金的公告        | 中国证券报、公司网站 | 2022 年 5 月 12 日 |
| 20 | 关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下基金增加和讯信息科技有限公司为代销机构的公告   | 中国证券报、公司网站 | 2022 年 5 月 13 日 |
| 21 | 关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下部分基金增加玄元保险代理有限公司为代销机构的公告 | 中国证券报、公司网站 | 2022 年 5 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              | 20220316-20220630       | -    | 45,837,000.37 | -    | 45,837,000.37 | 32.48% |
|        | 2              | 20220316-20220630       | -    | 45,837,000.37 | -    | 45,837,000.37 | 32.48% |
| 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。

## § 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丰利混合型证券投资基金的文件。
- 2、北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金合同。
- 3、北信瑞丰丰利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，也可登录基金管理人网站 [www.bxrfund.com](http://www.bxrfund.com) 查阅。

北信瑞丰基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日