

北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 31 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 2024 年 8 月 29 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38

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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	41
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 ..	42
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 ..	42
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	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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	44
§ 9 开放式基金份额变动	44
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8 其他重大事件	47
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§ 12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

§ 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	4,395,779.46 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	2,236,531.25 份	2,159,248.21 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	1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、股票投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、权证投资策略；6、其他金融工具的投资策略
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	夏彬
	联系电话	010-68619341
	电子邮箱	service@bxrfund.com
客户服务电话	400-061-7297	95526
传真	010-68619300	010-89661115
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	北京市丰台区开阳路 8 号京印国际中心 A 栋 4 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	《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	北京市丰台区开阳路 8 号京印国际中心 A 栋 4 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

基金类别	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（2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）	报告期（2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-60,064.04	-55,816.36
本期利润	-85,170.14	-138,173.02
加权平均基金份额本期利润	-0.0398	-0.0530
本期加权平均净值利润率	-3.78%	-5.06%
本期基金份额净值增长率	-0.57%	-0.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 6 月 30 日）	
期末可供分配利润	46,667.68	27,778.33
期末可供分配基金份额利润	0.0209	0.0129
期末基金资产净值	2,367,781.24	2,268,721.78
期末基金份额净值	1.0587	1.0507
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 6 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	17.11%	14.91%

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未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

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	-2.53%	0.73%	0.46%	0.05%	-2.99%	0.68%
过去三个月	1.25%	0.57%	1.37%	0.08%	-0.12%	0.49%
过去六个月	-0.57%	0.68%	3.62%	0.09%	-4.19%	0.59%
过去一年	4.40%	0.57%	4.36%	0.09%	0.04%	0.48%
过去三年	7.15%	0.33%	9.94%	0.11%	-2.79%	0.22%
自基金合同生效起至今	17.11%	0.31%	31.63%	0.12%	-14.52%	0.19%

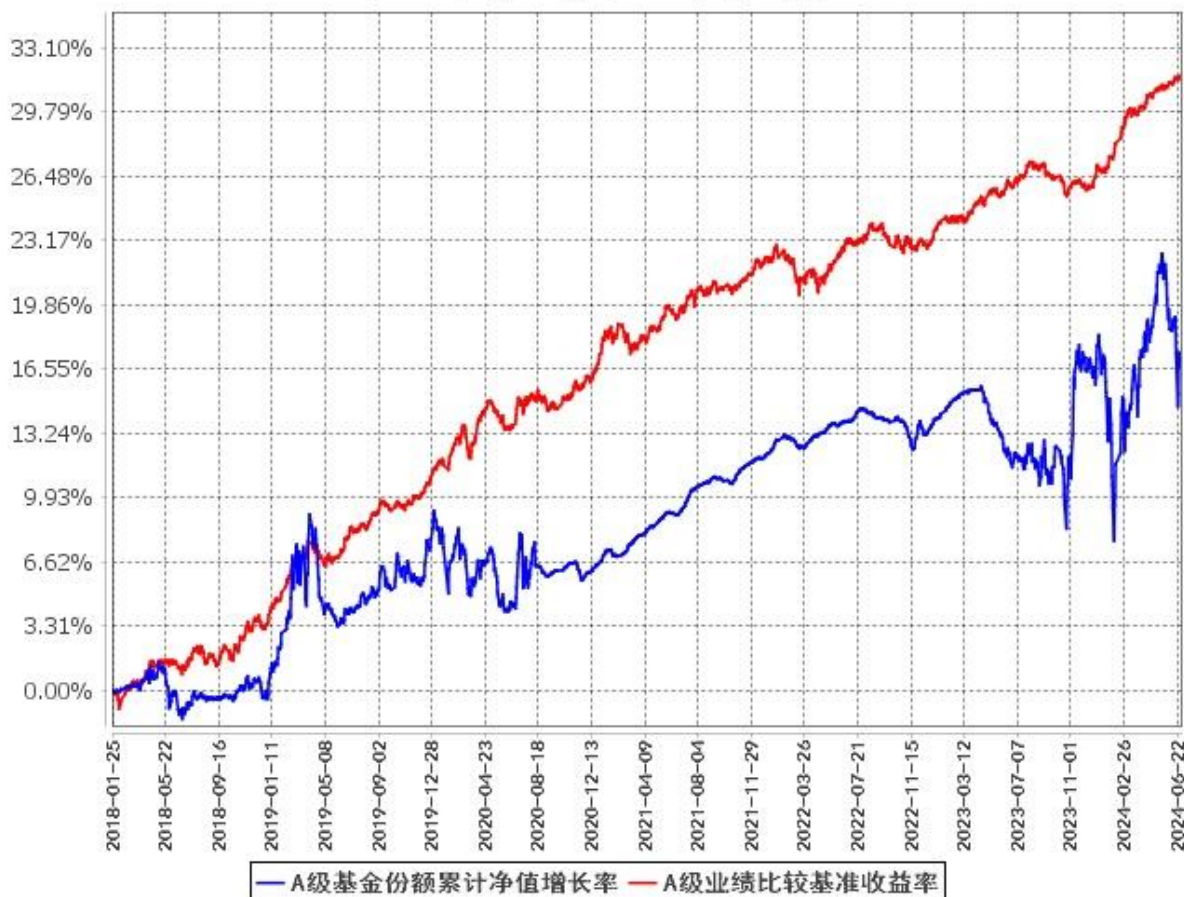
北信瑞丰鼎利债券 C

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	-2.50%	0.72%	0.46%	0.05%	-2.96%	0.67%
过去三个月	1.26%	0.56%	1.37%	0.08%	-0.11%	0.48%
过去六个月	-0.56%	0.68%	3.62%	0.09%	-4.18%	0.59%
过去一年	4.38%	0.57%	4.36%	0.09%	0.02%	0.48%
过去三年	6.30%	0.33%	9.94%	0.11%	-3.64%	0.22%
自基金合同生效起至今	14.91%	0.31%	31.63%	0.12%	-16.72%	0.19%

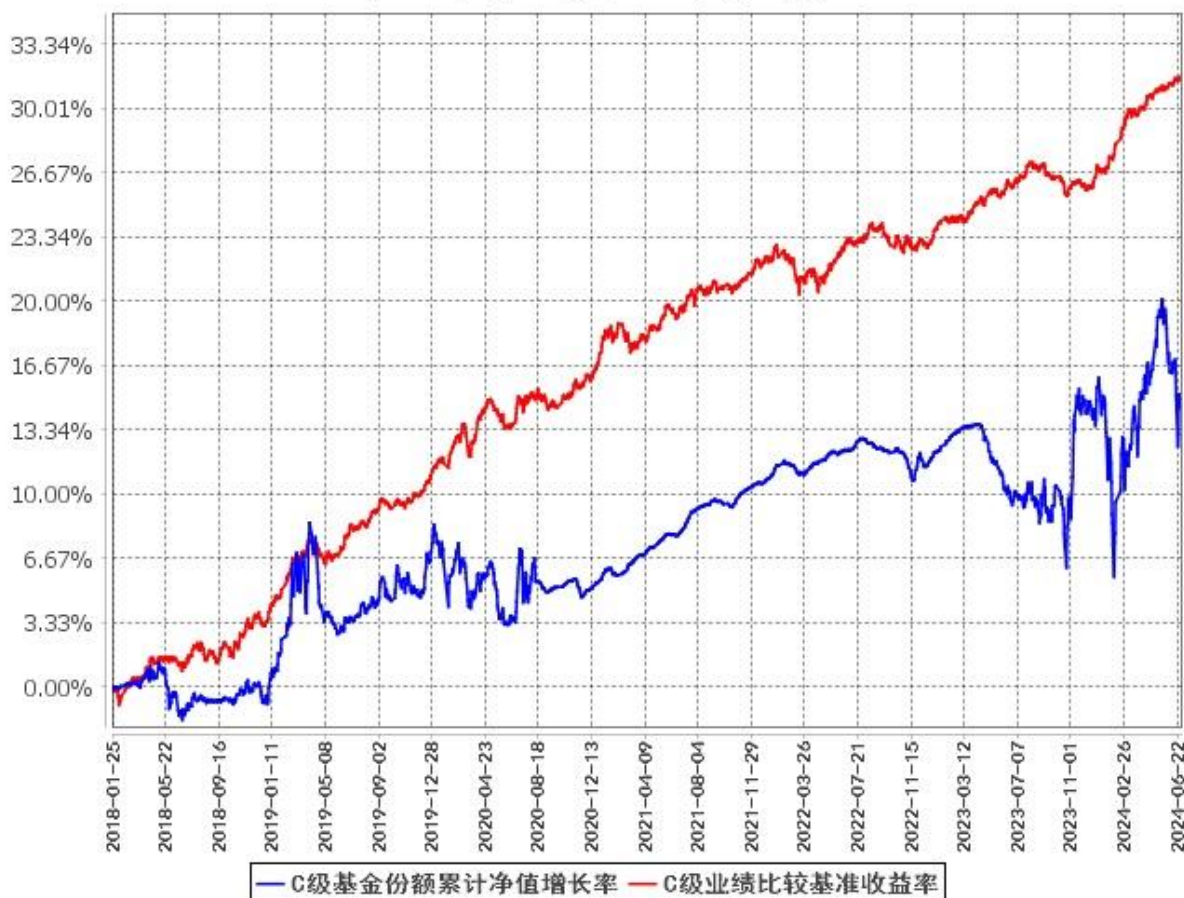
注: 中证综合债指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。中证综合债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央行及短融整体走势的跨市场债券指数。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势, 为债券投资者提供更切合的市场基准。根据本基金的投资范围和投资比例, 选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。沪深 300 指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数, 是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好, 同时公信力较好的股票指数, 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
(2018年1月25日至2024年6月30日)



C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
(2018年1月25日至2024年6月30日)



注：报告期内基金的各项投资比例符合基金合同的有关规定。

§ 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。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。

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		

林翟	本基金基金经理	2020 年 1 月 10 日	-	14	林翟先生，厦门大学应用经济学硕士，从事证券业 14 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、证券从业的含义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

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合规守信情况的说明

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，不存在损害基金持有人利益的情形。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制度》、《北信瑞丰基金管理有限公司异常交易管理办法》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。公司要求投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应该做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差。在交

易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，合理分配投资指令。公司通过系统严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。在事后监控环节，本基金管理人对公平交易制度的遵守、相关业务流程的执行情况以及不同投资组合的同向交易价差和反向交易价差进行检查和分析，对发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。本报告期内本基金管理人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

一季度，经济基本面并未经历根本性的变化。1 月上半月，北向资金持续净流出，导致股指持续下跌。在这一过程中，权重股扮演了稳定市场的角色，进而引导市场风格倾向于中字头和高股息股票。随着市场参与者从小市值股票转向高股息股票，中小盘股票面临更大的抛售压力，导致市场出现集中卖出现象。此后，由于现货风险敞口过多集中在小市值股票上，而对冲操作则偏向中大市值指数，采用 DMA 等杠杆类中性策略的投资者遭受了重创，多空双杀现象导致止损操作引发市场踩踏，流动性危机随之发酵。2 月初，随着市场出清以及汇金开始购买中证 2000 ETF，流动性危机得到缓解，市场企稳反弹。债券投资者认为经济前景不明朗，股市波动又比较大，风险偏好始终没有起色，在此背景下，债市持续走高。二季度，经济基本面乏力，物价指数、社融累计同比、M1、汇率等指标均走弱。但随着市场参与者对“国九条”的解读不断深入，4 月下旬权益市场迎来一波反弹，其后经济数据的不断走弱又对投资者信心形成打击，权益市场继续下行。在此背景下债券市场持续上涨，4 月央行提到无风险利率并没有反应实体经济并不弱的基本面，债券市场迎来短暂的回调后继续高歌猛进。转债市场方面，1 月受到股票市场持续走弱影响，转债亦跟随下行，5 月下旬部分发行人退市预期发酵，低价转债调整幅度较大，随着恐慌情绪缓解，转债进入估值修复环节。报告期内，本产品主要配置于可转债和股票，二者均波动较大，同时少了纯债的收益增厚，相较二级债基同类产品显得收益波动更大了。但考虑到目前股市的悲观预期可能已经过度定价，本产品未来将继续保持可转债和股票较高仓位运作。

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 的基金份额净值为 1.0587 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.57%；截至本报告期末北信瑞丰鼎利债券 C 的基金份额净值为 1.0507 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.56%；同期业绩比较基准收益率为 3.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来积极因素：中周期和库存周期都位于底部，随着财政政策发力，地产政策持续放松，未来经济会逐步企稳；AI 相关领域投资也在加速；金融、企业和居民的负债周期已开始掉头向上。消极因素：地缘政治存在不确定性；经济高频数据还在底部。

从股票风险溢价角度看，权益性价比更高。为巩固经济复苏成果，财政政策和货币政策环境还会比较宽松，对债券市场整体的影响偏多；但纵向看，利率债已经非常贵了，5 年以上利率债收益率水平位于历史 3%分位以下，期限结构也比较扁平；信用债绝对收益更低，信用利差也位于历史较低位置。保持短久期、无杠杆操作为宜。

目前中信风格指数金融、周期、消费和成长的估值水平分别位于历史 38%、35%、17%和 12%分位。相较年初金融、周期估值有所修复，消费估值大幅下行，成长亦有所下行。金融估值水平虽然较低，但受到让利实体政策影响，长期可能机会也不大。考虑到国家战略转型和估值水平，成长股占优。考虑到相对于其他板块的业绩稳定性，可以适当配置消费。综合来看，目前还属于存量博弈，短期可能大盘价值风格占优，但更长期来看，随着美联储降息预期发酵，超跌的成长风格可能会反弹。在此判断基础上，权益配置结构如下：成长股为主，小盘股为辅，再加少量价值股分散风险。

借此中报发布之机，跟大家分享一下经典 PB-ROE 投资框架，有助于我们在迷茫的投资阶段拨云见日。市净率反映了投资者对公司净资产的估值，可能有投资者认为市净率不适合对成长股进行估值，诚然，2019-2021 年机构抱团大盘成长阶段，市净率因子失效，而其他时间段，尤其在熊市阶段对于指示底部是较为有效的。下图蓝线为过去二十年万得全 A 指数（剔除金融、石化）的市净率走势图，红点线为市净率两年移动平均，红色区域为 2 倍标准差。在大牛市区间蓝线可能会一直超越红色区域运行，指示意义不大。熊市时蓝线可能贴着红色区域下限甚至穿过下限运行，穿过红色区域则可能预示着超跌了。可以看出，在 2013 年和 2018 年熊尾时，蓝线都是贴着红色区域下限运行的，且 pb 在 1.9 附近就跌不动了。目前所处阶段与 2013 和 2018 年极为相似，绝大多数股票已经非常便宜了，但库存周期和上市公司盈利尚未见底，导致情绪很弱，风险偏好极低，进而股票市场缩量震荡，持股体验较差。而投资是一种展现我们个人远见的行为，与其沉浸在过去悲伤的氛围中不能自拔，不如着手理性研究，为诸如 2013 年后的 2014-2015 或者 2018 后的 2019-2020 等牛市阶段打好地基。

ROE 衡量了公司的盈利能力，投资最终投的是公司，而公司的盈利能力是重中之重。市净率因子对于指数的指示意义不言而喻，对个股同样是一个较好的指标。PB-ROE 框架通过将这两个指标结合起来，可以帮助我们识别那些具有高盈利能力但市场估值较低的股票。另外除了关注盈利能力

外，我们还需要关注 ROE 的改善趋势，有时边际的改善相较较高的 ROE 更具有指示意义。市净率和 ROE 都是可得性较好的因子，投资者可以结合自己对投资的理解，自行回测基于上面思路的策略，相信一定能够使大家在股市的寒冬中更加从容。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国基金业协会提供的相关估值指引等相关规定以及基金合同的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同完成，本基金管理人完成账务处理、基金份额净值的计算，与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术，建立了投资决策委员会，下设估值小组。估值小组成员由具备丰富的证券研究、合规风控、估值经验的公司相关领导、基金经理、研究人员、交易人员、监察稽核人员及基金运营人员组成。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。

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

本基金在 2023 年 4 月 11 日至 2024 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

在本报告期内，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合规守信、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：北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	135,030.54	691,964.91
结算备付金		43,258.24	43,566.84
存出保证金		3,829.63	1,977.08
交易性金融资产	6.4.7.2	4,688,259.05	8,386,290.19
其中：股票投资		922,662.80	1,667,084.00
基金投资		-	-
债券投资		3,765,596.25	6,719,206.19
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	-	-
应收清算款		20,474.44	190,626.13
应收股利		-	-
应收申购款		2,916.37	9,719.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		4,893,768.27	9,324,144.52

负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		150,000.00	99,974.67
应付清算款		97,604.14	-
应付赎回款		-	828,383.13
应付管理人报酬		2,526.74	5,016.93
应付托管费		421.15	836.15
应付销售服务费		818.93	1,683.10
应付投资顾问费		-	-
应交税费		34.40	55.29
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	5,859.89	28,235.69
负债合计		257,265.25	964,184.96
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	4,395,779.46	7,884,611.95
未分配利润	6.4.7.8	240,723.56	475,347.61
净资产合计		4,636,503.02	8,359,959.56
负债和净资产总计		4,893,768.27	9,324,144.52

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 4,395,779.46 份，其中北信瑞丰鼎利债券 A 基金份额净值 1.0587 元，基金份额总额 2,236,531.25 份；北信瑞丰鼎利债券 C 基金份额净值 1.0507 元，基金份额总额 2,159,248.21 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-195,576.33	5,721,821.34
1. 利息收入		538.82	46,801.35
其中：存款利息收入	6.4.7.9	538.82	46,801.35
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-96,747.46	3,123,497.67
其中：股票投资收益	6.4.7.10	30,994.53	-604,089.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-139,564.45	3,725,330.48
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	11,822.46	2,256.30
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-107,462.76	2,546,237.28
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	8,095.07	5,285.04
减：二、营业总支出		27,766.83	934,999.39
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	14,819.91	431,709.63
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,470.05	71,951.58
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,726.96	1,242.42
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,745.32	315,682.35
其中：卖出回购金融资		1,745.32	315,682.35
产支出			
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		19.94	7,044.62
8. 其他费用	6.4.7.19	3,984.65	107,368.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-223,343.16	4,786,821.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-223,343.16	4,786,821.95
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-223,343.16	4,786,821.95

6.3 净资产变动表

会计主体：北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	7,884,611.95	-	475,347.61	8,359,959.56
二、本期期初净资产	7,884,611.95	-	475,347.61	8,359,959.56
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,488,832.49	-	-234,624.05	-3,723,456.54
（一）、综合收益总额	-	-	-223,343.16	-223,343.16
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-3,488,832.49	-	-11,280.89	-3,500,113.38
其中：1. 基金申购款	5,544,945.62	-	381,958.15	5,926,903.77
2. 基金赎回款	-9,033,778.11	-	-393,239.04	-9,427,017.15
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,395,779.46	-	240,723.56	4,636,503.02
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	326,314,773.24	-	8,928,504.37	335,243,277.61
二、本期期初净资产	326,314,773.24	-	8,928,504.37	335,243,277.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-324,773,945.25	-	-8,909,888.61	-333,683,833.86
（一）、综合收益总额	-	-	4,786,821.95	4,786,821.95

(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-324,773,945.25	-	-13,696,710.56	-338,470,655.81
其中：1. 基金申购款	3,966,257.71	-	153,739.07	4,119,996.78
2. 基金赎回款	-328,740,202.96	-	-13,850,449.63	-342,590,652.59
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,540,827.99	-	18,615.76	1,559,443.75

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：

刘晓玲	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。

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

本基金财务报表以基金持续经营为基础编制，执行财政部颁布的企业会计准则及其应用指南、解释及其他有关规定（统称“企业会计准则”）和中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、财政部发布的《资产管理产品相关会计处理规定》、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>》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。

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 2024 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

本基金基于上述编制基础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本报告期末的财务状况以及本报告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

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、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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	135,030.54
等于：本金	135,023.15
加：应计利息	7.39
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	135,030.54

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
----	------------------------

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	896,324.15	-	922,662.80	26,338.65
贵金属投资-金交所黄金 合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	3,842,040.42	3,765,596.25	-112,880.42
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,842,040.42	3,765,596.25	-112,880.42
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,738,364.57	36,436.25	4,688,259.05	-86,541.77

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

本期末本基金无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末本基金无从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本期末本基金无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	3,203.17
其中：交易所市场	3,203.17
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	2,656.72
合计	5,859.89

6.4.7.7 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,556,136.78	3,556,136.78
本期申购	1,483,106.58	1,483,106.58
本期赎回(以“-”号填列)	-2,802,712.11	-2,802,712.11
本期末	2,236,531.25	2,236,531.25

金额单位：人民币元

北信瑞丰鼎利债券 C		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,328,475.17	4,328,475.17
本期申购	4,061,839.04	4,061,839.04
本期赎回(以“-”号填列)	-6,231,066.00	-6,231,066.00
本期末	2,159,248.21	2,159,248.21

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 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	127,593.44	102,777.28	230,370.72
本期期初	127,593.44	102,777.28	230,370.72
本期利润	-60,064.04	-25,106.10	-85,170.14
本期基金份额交易产生的变动数	-20,861.72	6,911.13	-13,950.59
其中：基金申购款	48,299.79	56,048.36	104,348.15
基金赎回款	-69,161.51	-49,137.23	-118,298.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	46,667.68	84,582.31	131,249.99

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	119,588.92	125,387.97	244,976.89
本期期初	119,588.92	125,387.97	244,976.89
本期利润	-55,816.36	-82,356.66	-138,173.02

本期基金份额交易产生的变动数	-35,994.23	38,663.93	2,669.70
其中：基金申购款	99,916.61	177,693.39	277,610.00
基金赎回款	-135,910.84	-139,029.46	-274,940.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,778.33	81,695.24	109,473.57

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
活期存款利息收入	281.36
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	227.27
其他	30.19
合计	538.82

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
卖出股票成交总额	3,713,234.16
减：卖出股票成本总额	3,674,264.71
减：交易费用	7,974.92
买卖股票差价收入	30,994.53

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	24,322.51
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-163,886.96

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	-139,564.45

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	14,600,276.09
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	14,689,602.01
减：应计利息总额	73,774.32
减：交易费用	786.72
买卖债券差价收入	-163,886.96

6.4.7.12 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本期本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本期本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	11,822.46
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	11,822.46

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-107,462.76
——股票投资	24,919.23
——债券投资	-132,381.99
——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	-107,462.76

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	7,705.61
基金转换费收入	389.46
合计	8,095.07

6.4.7.18 信用减值损失

本期本基金无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	480.92
信息披露费	-
证券出借违约金	-
账户维护费	2,175.80
银行费用	727.93
其他	600.00
合计	3,984.65

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 2024年1月1日 至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日 至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,819.91	431,709.63
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,149.62	2,676.61
应支付基金管理人的净管理费	8,670.29	429,033.02

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 × 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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日 至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,470.05	71,951.58

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 × 0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	-	-
北京银行	-	185.80	185.80
合计	-	185.80	185.80
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	14.26	14.26
北京银行	-	121.62	121.62
合计	-	135.88	135.88

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日北信瑞丰鼎利 C 基金份额的基金资产净值 0.35% 的年费率计提，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。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日北信瑞丰鼎利 C 基金份额的基金资产净值 × 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		上年度可比期间	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		2023 年 1 月 1 日至 2023 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	135,030.54	281.36	80,436.95	12,706.56

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（2024 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 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购

证券款余额 150,000.00 元，截至 2024 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人北京银行股份有限公司，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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	223,767.68	-
AAA 以下	1,608,039.39	2,300,170.29
未评级	-	-
合计	1,831,807.07	2,300,170.29

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 2024 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 150,000.00 元将在一个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他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（净资产）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时间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未来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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	135,030.54	-	-	-	135,030.54
结算备付金	43,258.24	-	-	-	43,258.24
存出保证金	3,829.63	-	-	-	3,829.63
交易性金融资产	3,765,596.25	-	-	922,662.80	4,688,259.05
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	20,474.44	20,474.44
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,916.37	2,916.37
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,947,714.66	-	-	946,053.61	4,893,768.27
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	150,000.00	-	-	-	150,000.00
应付清算款	-	-	-	97,604.14	97,604.14
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,526.74	2,526.74
应付托管费	-	-	-	421.15	421.15
应付销售服务费	-	-	-	818.93	818.93
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	34.40	34.40
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	5,859.89	5,859.89
负债总计	150,000.00	-	-	107,265.25	257,265.25
利率敏感度缺口	3,797,714.66	-	-	838,788.36	4,636,503.02
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	691,964.91	-	-	-	691,964.91
结算备付金	43,566.84	-	-	-	43,566.84
存出保证金	1,977.08	-	-	-	1,977.08
交易性金融资产	6,719,206.19	-	-	1,667,084.00	8,386,290.19
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	190,626.13	190,626.13
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	9,719.37	9,719.37
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,456,715.02	-	-	1,867,429.50	9,324,144.52
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	99,974.67	-	-	-	99,974.67

应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	828,383.13	828,383.13
应付管理人报酬	-	-	-	5,016.93	5,016.93
应付托管费	-	-	-	836.15	836.15
应付销售服务费	-	-	-	1,683.10	1,683.10
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	55.29	55.29
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	28,235.69	28,235.69
负债总计	99,974.67	-	-	864,210.29	964,184.96
利率敏感度缺口	7,356,740.35	-	-	1,003,219.21	8,359,959.56

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 市场利率下降25个基点	1,108.84	4,971.04
2. 市场利率上升25个基点	-1,107.04	-4,961.48	

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。

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	922,662.80	19.90	1,667,084.00	19.94
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	3,765,596.25	81.22	6,719,206.19	80.37
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	4,688,259.05	101.12	8,386,290.19	100.31

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(2024 年 6 月 30 日)	上年度末(2023 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	52,915.74	52,825.11
2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-52,915.74	-52,825.11	

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	2,754,469.87	3,963,265.53
第二层次	1,933,789.18	4,423,024.66
第三层次	-	-
合计	4,688,259.05	8,386,290.19

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金融工具，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金融工具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，确定相关金融工具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

本基金于本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金不以公允价值计量的金融资产和金融负债主要包括：货币资金、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、卖出回购金融资产和其他各类应收应付款项等，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	922,662.80	18.85
	其中：股票	922,662.80	18.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,765,596.25	76.95
	其中：债券	3,765,596.25	76.95
	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	178,288.78	3.64
8	其他各项资产	27,220.44	0.56
9	合计	4,893,768.27	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	147,004.00	3.17
C	制造业	590,108.00	12.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	95,191.00	2.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	45,709.00	0.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,650.80	0.96
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	922,662.80	19.90

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	300775	三角防务	1,700	52,020.00	1.12
2	002938	鹏鼎控股	1,300	51,688.00	1.11
3	603556	海兴电力	1,100	51,513.00	1.11
4	002463	沪电股份	1,400	51,100.00	1.10
5	603298	杭叉集团	2,600	51,064.00	1.10
6	688092	爱科科技	2,380	50,813.00	1.10
7	688100	威胜信息	1,300	49,595.00	1.07
8	600938	中国海油	1,500	49,500.00	1.07
9	603993	洛阳钼业	5,800	49,300.00	1.06
10	603187	海容冷链	4,200	48,972.00	1.06
11	002588	史丹利	6,500	48,945.00	1.06
12	600968	海油发展	11,700	48,204.00	1.04
13	600023	浙能电力	6,700	47,637.00	1.03
14	600236	桂冠电力	6,200	47,554.00	1.03
15	603699	纽威股份	2,700	46,224.00	1.00
16	600548	深高速	4,300	45,709.00	0.99
17	688819	天能股份	1,900	45,334.00	0.98
18	301153	中科江南	1,580	44,650.80	0.96
19	688278	特宝生物	800	42,840.00	0.92

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	600297	广汇汽车	91,999.08	1.10
2	603515	欧普照明	90,108.00	1.08
3	688425	铁建重工	74,400.00	0.89
4	603508	思维列控	74,377.00	0.89
5	600998	九州通	74,084.00	0.89
6	601139	深圳燃气	73,920.00	0.88
7	603277	银都股份	73,904.00	0.88
8	002463	沪电股份	62,298.00	0.75
9	301153	中科江南	61,020.00	0.73
10	600258	首旅酒店	60,475.00	0.72
11	002668	TCL 智家	59,745.00	0.71
12	600968	海油发展	59,040.00	0.71
13	603328	依顿电子	57,464.00	0.69
14	603529	爱玛科技	57,306.00	0.69
15	600905	三峡能源	57,147.00	0.68
16	601038	一拖股份	57,084.00	0.68
17	601857	中国石油	56,994.00	0.68
18	600956	新天绿能	56,869.00	0.68
19	688100	威胜信息	55,968.00	0.67
20	600900	长江电力	55,867.00	0.67

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	601899	紫金矿业	136,529.00	1.63
2	601126	四方股份	126,456.00	1.51
3	601512	中新集团	117,978.00	1.41
4	603043	广州酒家	108,805.00	1.30
5	601827	三峰环境	106,018.00	1.27
6	601369	陕鼓动力	103,656.00	1.24
7	603920	世运电路	99,937.00	1.20
8	002498	汉缆股份	98,529.00	1.18
9	600297	广汇汽车	95,332.38	1.14
10	605166	聚合顺	94,176.00	1.13
11	603515	欧普照明	93,545.00	1.12
12	600989	宝丰能源	92,801.00	1.11
13	600461	洪城环境	92,591.00	1.11
14	601098	中南传媒	91,676.00	1.10

15	603100	川仪股份	84,708.00	1.01
16	600998	九州通	81,018.00	0.97
17	603337	杰克股份	80,809.00	0.97
18	605183	确成股份	79,113.00	0.95
19	603277	银都股份	76,694.00	0.92
20	002266	浙富控股	76,305.00	0.91

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	2,904,924.28
卖出股票收入（成交）总额	3,713,234.16

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	1,933,789.18	41.71
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,831,807.07	39.51
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,765,596.25	81.22

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	019727	23 国债 24	16,000	1,629,104.66	35.14
2	019709	23 国债 16	3,000	304,684.52	6.57
3	127103	东南转债	1,500	141,896.55	3.06
4	127019	国城转债	1,400	126,411.56	2.73
5	113044	大秦转债	1,000	120,265.10	2.59

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是否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

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	3,829.63
2	应收清算款	20,474.44
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,916.37

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,220.44

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	127019	国城转债	126,411.56	2.73
2	113044	大秦转债	120,265.10	2.59
3	123147	中辰转债	115,404.36	2.49
4	123063	大禹转债	112,123.48	2.42
5	113058	友发转债	110,013.84	2.37
6	123168	惠云转债	105,879.32	2.28
7	127049	希望转 2	103,502.58	2.23
8	127034	绿茵转债	97,603.84	2.11
9	123146	中环转 2	93,442.74	2.02
10	127068	顺博转债	92,894.77	2.00
11	123190	道氏转 02	92,303.15	1.99
12	110086	精工转债	89,133.42	1.92
13	123149	通裕转债	80,787.29	1.74
14	118034	晶能转债	78,098.50	1.68
15	111009	盛泰转债	76,366.90	1.65
16	118023	广大转债	70,906.03	1.53
17	128130	景兴转债	21,567.89	0.47

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

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	323	6,924.25	466,904.69	20.88%	1,769,626.56	79.12%
北信瑞丰鼎利债券 C	272	7,938.41	758,418.97	35.12%	1,400,829.24	64.88%
合计	595	7,387.86	1,225,323.66	27.88%	3,170,455.80	72.12%

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	37.12	0.0017%
	北信瑞丰鼎利债券 C	368.32	0.0171%
	合计	405.44	0.0092%

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、基金投资和相关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	0
	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	0
	北信瑞丰鼎利债券 C	0
	合计	0

§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	3,556,136.78	4,328,475.17
本报告期基金总申购份额	1,483,106.58	4,061,839.04
减：本报告期基金总赎回份额	2,802,712.11	6,231,066.00
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	2,236,531.25	2,159,248.21

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

§ 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

基金管理人：本报告期内，无涉及基金管理人的重大人事变动。

基金托管人：报告期内，史学通先生 2024 年 4 月 25 日起不再担任本基金托管人的专门基金托管部门负责人，暂由闫朝女士代为履职，2024 年 6 月 28 日，资产托管部总经理贺凌女士高管任职资格已完成证监会备案。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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

为进一步维护基金份额持有人的利益，促进会计师事务所提供更优质的服务，自 2024 年 1 月 1 日起，本基金改聘了审计服务机构，由普华永道会计师事务所（特殊普通合伙）变更为致同会计师事务所（特殊普通合伙），该变更事项已履行相关程序，于 2024 年 1 月 3 日进行信息披露公告，并已按照相关规定及合同约定通知基金托管人。

致同会计师事务所（特殊普通合伙）已连续为本基金提供 1 年审计服务，本报告期内应支付会计师事务所的审计费为 480.92 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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
中信建投证券	2	4,160,058.66	63.74%	3,934.92	69.04%	-
国联证券	2	2,366,100.70	36.26%	1,764.83	30.96%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信建投证券	18,735,003.71	71.06%	10,800,000.00	58.32%	-	-	-	-
国联证券	7,629,292.13	28.94%	7,720,000.00	41.68%	-	-	-	-

东吴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证 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	北信瑞丰基金管理有限公司基金改聘会计师事务所公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024年1月3日
2	北信瑞丰基金管理有限公司基金产品风险等级划分规则说明(2024年1月更新)	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024年1月12日
3	北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金2023年第4季度报告	、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024年1月22日
4	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金增加国金证券为代销机构的公告	基金管理人网站	2024年3月4日
5	北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金2023年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024年3月30日

6	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 22 日
7	北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 22 日
8	北信瑞丰鼎利债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 29 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 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

北京市丰台区开阳路 8 号京印国际中心 A 栋 4 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 查阅。

北信瑞丰基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日