

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  
报告送出日期：2018年7月19日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期未进行财务费用审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

## § 2 基金的基本情况

基金简称	北信瑞丰平安中国主题灵活配置
交易代码	003194
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10月11日
报告期末基金资产总额	61,696,886.949

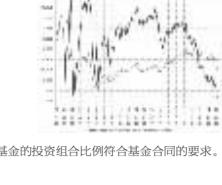
注：本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

## § 3 其他指标

注：无。

## 北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金

## 2018年第二季度报告



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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理时间	证券从业年限	说明
宇华伟	基金经理	2018年05月6日	8	中国人民大学世界经济系学士，中国科学院研究生院金融与产业经济学硕士，具有基金从业资格，通过了基金业协会组织的基金销售从业人员考试，具备基金从业资格；具有基金从业资格，通过了基金业协会组织的基金销售从业人员考试，具备基金从业资格；具有基金从业资格，通过了基金业协会组织的基金销售从业人员考试，具备基金从业资格。
黄海琳	基金经理	2018年04月11日	11	毕业于中国农业大学，获农学学士学位，后获美国威斯康星大学麦迪逊分校农业经济系硕士学位，后获美国威斯康星大学麦迪逊分校农业经济系博士学位，现就职于北信瑞丰基金管理有限公司，具有基金从业资格。

注：1、本基金的基金经理“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，即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含义从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 基金经理对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 平交交易专项说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《公司公平交易管理办法》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、特定客户资产管理组合等。

具体如下：

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

4.4 平交交易制度的执行情况

本基金报告期内，基金管理人严格按照《公司公平交易管理办法》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、特定客户资产管理组合等。

具体如下：

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

4.5 平交交易专项说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《公司公平交易管理办法》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、特定客户资产管理组合等。

具体如下：

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

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 5 投资组合报告

## 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权证投资	40,206,271.72	64.89%
2	基金投资	40,206,271.72	64.89%
3	固定收益投资	-	-
4	股票投资	-	-
5	货币市场基金	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,274,889.69	13.26%
8	其他资产	898,271.03	1.57%
9	合计	47,369,431.34	100.00%

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	净利润	3,136,130	6.60%
2	营业收入	3,136,130	6.60%
3	营业利润	3,136,130	6.60%
4	利润总额	3,136,130	6.60%
5	归属于上市公司股东的净利润	3,136,130	6.60%
6	归属于上市公司股东的营业收入	3,136,130	6.60%
7	归属于上市公司股东的营业利润	3,136,130	6.60%
8	归属于上市公司股东的利润总额	3,136,130	6.60%
9	扣除非经常性损益后的净利润	3,136,130	6.60%
10	扣除非经常性损益后的营业收入	3,136,130	6.60%
11	扣除非经常性损益后的营业利润	3,136,130	6.60%

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）和扣除非经常性损益后的净利润，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；  
2、所列企业绩效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示数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	① - ③	② - ④
过去三个月	-3.76%	0.09%	-6.05%	0.09%	-2.29%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

注：以上图表以2018年6月30日证监会行业分类标准为准。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的其他资产

5.2.4 报告期末按行业分类的平均市值

5.2.5 报告期末按行业分类的平均市盈率

5.2.6 报告期末按行业分类的平均市净率

5.2.7 报告期末按行业分类的平均总市值

5.2.8 报告期末按行业分类的平均流通市值

5.2.9 报告期末按行业分类的平均自由流通市值

5.2.10 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.11 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.12 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.13 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.14 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.15 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.16 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.17 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.18 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.19 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.20 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.21 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.22 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.23 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.24 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.25 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.26 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.27 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.28 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.29 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.30 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.31 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.32 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.33 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.34 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.35 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.36 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.37 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.38 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.39 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.40 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.41 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.42 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.43 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.44 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.45 报告期末按行业分类的平均流通股数

5.2.46 报告期末按行业分类的平均流通股数