

北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人:北信瑞丰基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月21日

§1 重要提示

基金管理人及基金托管人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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年01月19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预示其未来表现,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。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

基金简称	北信瑞丰无限互联主题灵活配置
交易代码	000898
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月24日
报告期末基金份额总额	111,016,288.79份
投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置,重点投资于具有独特商业模式、深刻影响人们生活方式的快速成长的互联网公司,为互联网提供提供基础服务、硬件设备等的公司,以及使用互联网技术、互联网工具、互联网思维带动传统产业升级和商业模式创新的公司,在严格控制风险的前提下,谋求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面:首先,依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例;而后,进行各大类资产中的个股、个债精选。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和衍生品投资策略四部分组成。在资产配置策略风险的前提下,动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例,力求超越市场回报,实现配置增值。
业绩比较基准	中证500指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型偏股基金,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型基金。
基金管理人	北信瑞丰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	19,157,338.96
2.本期利润	27,072,376.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.3474
4.期末基金资产净值	141,887,202.23
5.期末基金份额净值	1.278

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

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

3、2.2 本基金业绩表现

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准③	业绩比较基准收益率基准④	①-③	②-④
过去三个月	7.57%	1.75%	12.18%	1.03%	2.60%	0.72%

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:1、本基金投资于股票资产占基金资产净值比例不低于60%。

2、本基金投资于债券资产占基金资产净值比例不高于40%。

3、本基金投资于货币市场工具占基金资产净值比例不高于10%。

4、本基金投资于权证占基金资产净值比例不高于3%。

5、本基金投资于股指期货占基金资产净值比例不高于10%。

6、本基金投资于国债期货占基金资产净值比例不高于10%。

7、本基金投资于商品期货占基金资产净值比例不高于10%。

8、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

9、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

10、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

11、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

12、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

13、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

14、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

15、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

16、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

17、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

18、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

19、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

20、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

21、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

22、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

23、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

24、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

25、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

26、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

27、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

28、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

29、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

30、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

31、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

32、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

33、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

34、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

35、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

36、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

37、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

38、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

39、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

40、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

41、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

42、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

43、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

44、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

45、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

46、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

47、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

48、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

49、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

50、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

51、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

52、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

53、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

54、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

55、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

56、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

57、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

58、本基金投资于其他金融工具占基金资产净值比例不高于10%。

§2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	31,307,584.00	22.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,035,614.30	4.96
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	55,240,058.00	38.94
J	金融业	8,047,200.00	5.67
K	房地产业	7,108,740.00	5.01
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	4,628,000.00	3.26
S	综合	-	-
	合计	113,367,196.30	79.91

注:以上行业分类以2015年12月31日的证监会行业分类标准为依据。

§2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

§3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600891	亚细亚集团	1,198,900	8,680,030.00	6.12
2	002230	科大讯飞	220,000	8,151,000.00	5.75
3	002285	世联行	438,000	7,108,740.00	5.01
4	002024	苏宁云商	523,094	7,035,614.30	4.96
5	600037	歌华有线	325,000	6,397,250.00	4.53
6	002273	千科科技	150,000	6,382,500.00	4.49
7	000063	中兴通讯	350,000	4,943,800.00	3.44
8	300165	安诺信	260,000	4,680,000.00	3.28
9	300394	中文在线	26,000	4,628,000.00	3.26
10	600570	恒生电子	70,000	4,287,000.00	3.01

注:本基金本报告期末持有的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

§4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

§5 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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

§6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

§7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

§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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

§9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有股指期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

§10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有国债期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

§11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有股指期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

§12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有国债期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

§13 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有股指期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

§14 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有国债期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

§15 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有股指期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

§16 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有国债期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

§17 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有股指期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

§18 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有国债期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

§19 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有股指期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

§20 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有国债期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

§21 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有股指期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

§22 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有国债期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

§23 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有股指期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

§24 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有国债期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

§25 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有股指期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

§26 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有国债期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

§27 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有股指期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

§28 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有国债期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

§29 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有股指期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

§30 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有国债期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

§31 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有股指期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

§32 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有国债期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

§33 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有股指期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

§34 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有国债期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

§35 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有股指期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

§36 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有国债期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

§37 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有股指期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

§38 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有国债期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

§39 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有股指期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

§40 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有国债期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

§41 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有股指期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。

§42 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有国债期货头寸。

2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

§43 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:1)本基金本报告期末未持有股指期货头寸。

2)本基金本报告