

北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金

[2016] 第一季度报告

基金管理人:北信瑞丰基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2016年4月21日

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。

基金托管人和信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年04月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	北信瑞丰新成长
交易代码	000966
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月1日
报告期末基金份额总额	40,161,460.02份

本基金在严格的风控前提下,通过对灵活的资产配置,追求在控制风险的前提下,实现基金资产的长期稳健增值。

本基金的投资范围分为三个层面,首先,依赖基金管理人的大类资产配置能力,通过资产配置,在不同资产类别之间进行资产配置,追求资产增值;其次,通过大类资产配置,股票投资策略,股票投资策略,固定收益策略及权证投资策略四部分组成。

中证500指数收益率*30%+上证综合指数收益率*70%。

本基金为混合型基金,具有较高的风险,较低的预期收益特征,其预期风险和预期收益水平略高于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

基金管理人:北信瑞丰基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

报告期中财务资料未经审计。

报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2016年1月1日~2016年3月31日)

1.本期已实现收益 368,699.70

2.本期利润 -1,016,374.46

3.期初至报告期末基金期间 -0.0188

4.期末基金净值 -39,979,503.60

5.期末基金份额净值 0.9966

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

2.所述基金业绩指标不包括任何认购或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平将低于所示数据。

3.本基金合同生效日期为2015年11月1日,截止本报告期末本基金成立未满一年。

3.1 基金价值表现

报告期未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组合

注:本基金报告期末未持有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组合。

3.2.1 报告期本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

报告期(2016年1月1日~2016年3月31日)

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 -1.20% 0.48% -3.70% 0.80% 2.41% -0.32%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

报告期(2016年1月1日~2016年3月31日)

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 -1.20% 0.48% -3.70% 0.80% 2.41% -0.32%

注:以上数据分类以2016年03月31日的证监会行业分类标准为准。

5.2 报告期未按行业分类的债券投资组合

注:本基金报告期末未持有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组合。

5.3 报告期未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

报告期(2016年1月1日~2016年3月31日)

序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000002 万科A 145,000 0.36%

2 600032 中国宝安 61,000 0.15%

3 600629 联通A 190,000 0.46%

4 002119 武钢股份 60,000 0.14%

5 300042 高能环境 25,000 0.06%

6 300205 理工控股 5,000 0.01%

7 000027 深物业A 14,000 0.00%

8 合计 2,722,460.00 0.62%

注:本基金报告期末未持有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组合。

5.4 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期间 证券从业年限 说明

于军华 基金经理 2015年11月11日 - 6 CFA,中国科学院世界经济与政治研究所金融学硕士,曾任基金经理,现任公司总经理助理,公司董事,中行国际金融租赁有限公司董事,信建投证券股份有限公司董事,信建投证券股份有限公司监事长,信建投证券股份有限公司总经理助理,信建投证券股份有限公司总经理,信建投证券股份有限公司风控总监,信建投证券股份有限公司合规总监,信建投证券股份有限公司风险管理总监,信建投证券股份有限公司合规总监,信建投证券股份有限公司风控总监,信建投证券股份有限公司总经理助理,信建投证券股份有限公司总经理。

北京大学经济学硕士,7年从业经验,曾任公司中行国际金融租赁有限公司风控总监,信建投证券股份有限公司风控总监,信建投证券股份有限公司总经理助理,信建投证券股份有限公司总经理,信建投证券股份有限公司风控总监,信建投证券股份有限公司总经理助理,信建投证券股份有限公司总经理。

4.2 管理人对报告期内基金运作指标的说明

本报告期内,本基金管理人按照《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施细则,本基金合同和其他有关法律法规、监管部门的有关规定,诚实信用,勤勉尽责的原则管理运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司严格执行《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,本基金管理人构建了研究平台,旗下所有投资组合公平地使用该研究平台的研究成果,在各基金之间公平地分享研究成果。

在交易执行环节,在公平交易制度、公平交易流程、公平交易监控和公平交易预警等方面执行定期和不定期的检查,并对外定期披露公平交易报告。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人在公平交易制度、公平交易流程、公平交易监控和公平交易预警等方面执行定期和不定期的检查,并对外定期披露公平交易报告。

4.4 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人在公平交易制度、公平交易流程、公平交易监控和公平交易预警等方面执行定期和不定期的检查,并对外定期披露公平交易报告。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期净值增长率-1.29%,波动率0.48%,业绩比较基准收益率-3.70%,波动率0.80%。

4.6 报告期内基金份额持有人数或基金资产净值/净值预警说明

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

2.所述基金业绩指标不包括任何认购或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平将低于所示数据。

3.本基金合同生效日期为2016年1月1日,截止本报告期末本基金成立未满一年。

4.7 报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

报告期(2016年1月1日~2016年3月31日)

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 2.10% 0.46% 6.27% 0.80% 1.21% -0.17% -0.70%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

报告期(2016年1月1日~2016年3月31日)

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 2.10% 0.46% 6.27% 0.80% 1.21% -0.17% -0.70%

注:以上数据分类以2016年03月31日的证监会行业分类标准为准。

5.8 报告期内基金份额净值的月度表现

本基金报告期未出现单月净值下跌的情况。

5.9 报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

报告期(2016年1月1日~2016年3月31日)

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 2.10% 0.46% 6.27% 0.80% 1.21% -0.17% -0.70%

注:以上数据分类以2016年03月31日的证监会行业分类标准为准。

5.10 报告期内基金份额净值的月度表现

本基金报告期未出现单月净值下跌的情况。

5.11 报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

报告期(2016年1月1日~2016年3月31日)

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 2.10% 0.46% 6.27% 0.80% 1.21% -0.17% -0.70%

注:以上数据分类以2016年03月31日的证监会行业分类标准为准。

5.12 报告期内基金份额净值的月度表现

本基金报告期未出现单月净值下跌的情况。

5.13 报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

报告期(2016年1月1日~2016年3月31日)

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 2.10% 0.46% 6.27% 0.80% 1.21% -0.17% -0.70%

注:以上数据分类以2016年03月31日的证监会行业分类标准为准。

5.14 报告期内基金份额净值的月度表现

本基金报告期未出现单月净值下跌的情况。

5.15 报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

报告期(2016年1月1日~2016年3月31日)

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 2.10% 0.46% 6.27% 0.80% 1.21% -0.17% -0.70%

注:以上数据分类以2016年03月31日的证监会行业分类标准为准。

5.16 报告期内基金份额净值的月度表现

本基金报告期未出现单月净值下跌的情况。

5.17 报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

报告期(2016年1月1日~2016年3月31日)

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 2.10% 0.46% 6.27% 0.80% 1.21% -0.17% -0.70%

注:以上数据分类以2016年03月31日的证监会行业分类标准为准。

5.18 报告期内基金份额净值的月度表现

本基金报告期未出现单月净值下跌的情况。

5.19 报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

报告期(2016年1月1日~2016年3月31日)

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 2.10% 0.46% 6.27% 0.80% 1.21% -0.17% -0.70%

注:以上数据分类以2016年03月31日的证监会行业分类标准为准。

5.20 报告期内基金份额净值的月度表现

本基金报告期未出现单月净值下跌的情况。

5.21 报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较