

北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金

基金管理人：北信瑞丰基金管理有限公司
基金托管人：中信建投证券股份有限公司
基金合同生效日期：2018年03月29日

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责任。

本半年度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。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年6月24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。

本半年度报告摘编自半年度报告正文，投资者欲了解详细信息，应阅读半年度报告全文。

本报告自2018年1月1日起至6月30日止。

2 基金基本情况

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	中信建投证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名：朱明 电话：010-69619341 邮箱：news@bxrfund.com	姓名：朱明 电话：0086-108-108 邮箱：news@ccit.com.cn
客户服务热线	400017287	95527
网址	010-69619300	010-65612075

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金力争在严格控制风险的前提下，通过相对灵活的资产配置，重点投资于具有良好成长性的上市公司股票，追求基金资产的长期增值。

投资策略 本基金的投资策略分为两个方面：首先，根据基金合同约定的资产配置比例确定股票、固定收益类资产、现金类资产的大类资产配置比例；其次，在大类资产配置比例的基础上，根据宏观经济、行业景气度、个股估值等因素，对股票、固定收益类资产进行进一步配置。

业绩比较基准 中证800指数收益率×30%+中债综合财富指数收益率×70%

风险收益特征 本基金为混合型基金，具有中等预期风险、较高预期收益的特征，其风险和收益预期低于股票型基金、高于债券型基金和货币型基金。

2.3 基金管理人

北信瑞丰基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区望京阜通东大街10号
法定代表人：朱明
总经理：朱明
督察长：朱明
基金经理：朱明

2.4 信息披露方式

信息披露网址：<http://www.bxrfund.com>
基金年度报告备置地点：基金管理人及基金托管人的办公场所

3 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

项目	本报告期	上年同期
3.1 本期基金份额净值增长率	22.96%	12.56%
3.2 本期基金份额净值增长率标准差	1.37%	1.37%
3.3 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度	0.96%	0.96%

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

项目	本报告期	上年同期
营业收入	10,141,173.17	3,504,749.79
公允价值变动损益	2,324,563.10	-
利润总额	229,963.38	12,516.76
净利润	68,299,625.00	138,901,241.48
归属于母公司的净利润	68,431,928.00	70,679,201.48
基本每股收益	0.43	0.43
稀释每股收益	0.43	0.43
其他综合收益	8,966,700.00	68,221,000.00
综合收益总额	77,268,625.00	147,122,241.48
归属于母公司的综合收益总额	77,268,625.00	147,122,241.48
期末归属于母公司的所有者权益	96,423,589.01	-
期末基金资产净值	96,423,589.01	-
期末基金份额净值	0.969	-

3.2 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中证800指数收益率×30%+中债综合财富指数收益率×70%。

3.3 基金业绩评价

本基金业绩评价采用业绩比较基准法。业绩比较基准由中证800指数收益率和中债综合财富指数收益率组成。本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。

4 基金管理人及基金托管人

4.1 基金管理人

北信瑞丰基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区望京阜通东大街10号
法定代表人：朱明
总经理：朱明
督察长：朱明
基金经理：朱明

4.2 基金托管人

中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号
法定代表人：王常青
总经理：王常青
督察长：王常青
基金经理：王常青

4.1 基金管理人

北信瑞丰基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区望京阜通东大街10号
法定代表人：朱明
总经理：朱明
督察长：朱明
基金经理：朱明

4.2 基金托管人

中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号
法定代表人：王常青
总经理：王常青
督察长：王常青
基金经理：王常青

4.1 基金管理人

北信瑞丰基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区望京阜通东大街10号
法定代表人：朱明
总经理：朱明
督察长：朱明
基金经理：朱明

4.2 基金托管人

中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号
法定代表人：王常青
总经理：王常青
督察长：王常青
基金经理：王常青

5 基金投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

项目	金额	占基金资产净值比例(%)
权益投资	69,431,928.00	65.13
其中：股票	69,431,928.00	65.13
固定收益投资	8,966,700.00	9.83
其中：债券	8,966,700.00	9.83
金融衍生品投资	-	-
其他资产	10,000,000.00	10.96
其中：买入返售金融资产	10,000,000.00	10.96
其他	14,966,224.44	16.04
其中：应收款项	14,966,224.44	16.04
其他	159,570.76	1.37
其中：应收股利	159,570.76	1.37
其他	519.08	-
其中：其他资产	519.08	-
其他	91,246,424.40	158,703,210.88
其中：银行存款	91,246,424.40	158,703,210.88
其他	12,466,742.27	13.64
其中：其他负债	381,054.13	0.42
其他	91,246,424.40	100.00

5.1 报告期末基金资产组合情况

本基金本报告期末持有股票200只。

5.2 报告期末基金资产组合情况

本基金本报告期末持有股票200只。

5.3 报告期末基金资产组合情况

本基金本报告期末持有股票200只。

5.1 报告期末基金资产组合情况

本基金本报告期末持有股票200只。

5.2 报告期末基金资产组合情况

本基金本报告期末持有股票200只。

5.3 报告期末基金资产组合情况

本基金本报告期末持有股票200只。

6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	基金份额
期初	146,198,726.40
申购	452,488,720.30
赎回	327,698.08
期末	62,463,828.62

6.1 开放式基金份额变动

单位：份

项目	基金份额
期初	146,198,726.40
申购	452,488,720.30
赎回	327,698.08
期末	62,463,828.62

6.1 开放式基金份额变动

单位：份

项目	基金份额
期初	146,198,726.40
申购	452,488,720.30
赎回	327,698.08
期末	62,463,828.62

7 基金管理人及基金托管人

7.1 基金管理人

北信瑞丰基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区望京阜通东大街10号
法定代表人：朱明
总经理：朱明
督察长：朱明
基金经理：朱明

7.2 基金托管人

中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号
法定代表人：王常青
总经理：王常青
督察长：王常青
基金经理：王常青

7.1 基金管理人

北信瑞丰基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区望京阜通东大街10号
法定代表人：朱明
总经理：朱明
督察长：朱明
基金经理：朱明

7.2 基金托管人

中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号
法定代表人：王常青
总经理：王常青
督察长：王常青
基金经理：王常青

7.1 基金管理人

北信瑞丰基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区望京阜通东大街10号
法定代表人：朱明
总经理：朱明
督察长：朱明
基金经理：朱明

7.2 基金托管人

中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号
法定代表人：王常青
总经理：王常青
督察长：王常青
基金经理：王常青

8 基金投资组合报告

8.1 报告期末基金资产组合情况

项目	金额	占基金资产净值比例(%)
权益投资	69,431,928.00	65.13
其中：股票	69,431,928.00	65.13
固定收益投资	8,966,700.00	9.83
其中：债券	8,966,700.00	9.83
金融衍生品投资	-	-
其他资产	10,000,000.00	10.96
其中：买入返售金融资产	10,000,000.00	10.96
其他	14,966,224.44	16.04
其中：应收款项	14,966,224.44	16.04
其他	159,570.76	1.37
其中：应收股利	159,570.76	1.37
其他	519.08	-
其中：其他资产	519.08	-
其他	91,246,424.40	158,703,210.88
其中：银行存款	91,246,424.40	158,703,210.88
其他	12,466,742.27	13.64
其中：其他负债	381,054.13	0.42
其他	91,246,424.40	100.00

8.1 报告期末基金资产组合情况

本基金本报告期末持有股票200只。

8.2 报告期末基金资产组合情况

本基金本报告期末持有股票200只。

8.3 报告期末基金资产组合情况

本基金本报告期末持有股票200只。

8.1 报告期末基金资产组合情况

本基金本报告期末持有股票200只。

8.2 报告期末基金资产组合情况

本基金本报告期末持有股票200只。

8.3 报告期末基金资产组合情况

本基金本报告期末持有股票200只。

9 基金管理人及基金托管人

9.1 基金管理人

北信瑞丰基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区望京阜通东大街10号
法定代表人：朱明
总经理：朱明
督察长：朱明
基金经理：朱明

9.2 基金托管人

中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号
法定代表人：王常青
总经理：王常青
督察长：王常青
基金经理：王常青

9.1 基金管理人

北信瑞丰基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区望京阜通东大街10号
法定代表人：朱明
总经理：朱明
督察长：朱明
基金经理：朱明

9.2 基金托管人

中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号
法定代表人：王常青
总经理：王常青
督察长：王常青
基金经理：王常青

9.1 基金管理人

北信瑞丰基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区望京阜通东大街10号
法定代表人：朱明
总经理：朱明
督察长：朱明
基金经理：朱明

9.2 基金托管人

中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号
法定代表人：王常青
总经理：王常青
督察长：王常青
基金经理：王常青

10 基金投资组合报告

10.1 报告期末基金资产组合情况

项目	金额	占基金资产净值比例(%)
权益投资	69,431,928.00	65.13
其中：股票	69,431,928.00	65.13
固定收益投资	8,966,700.00	9.83
其中：债券	8,966,700.00	9.83
金融衍生品投资	-	-
其他资产	10,000,000.00	10.96
其中：买入返售金融资产	10,000,000.00	10.96
其他	14,966,224.44	16.04
其中：应收款项	14,966,224.44	16.04
其他	159,570.76	1.37
其中：应收股利	159,570.76	1.37
其他	519.08	-
其中：其他资产	519.08	-
其他	91,246,424.40	158,703,210.88
其中：银行存款	91,246,424.40	158,703,210.88
其他	12,466,742.27	13.64
其中：其他负债	381,054.13	0.42
其他	91,246,424.40	100.00

10.1 报告期末基金资产组合情况

本基金本报告期末持有股票200只。

10.2 报告期末基金资产组合情况

本基金本报告期末持有股票200只。

10.3 报告期末基金资产组合情况

本基金本报告期末持有股票200只。

10.1 报告期末基金资产组合情况

本基金本报告期末持有股票200只。

10.2 报告期末基金资产组合情况

本基金本报告期末持有股票200只。

10.3 报告期末基金资产组合情况

本基金本报告期末持有股票200只。

2018年半年度报告摘要

注：至本报告期末，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。

6.4.3.2 交易所市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的事项

(1)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开始

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报价。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(2)持续的以公允价值计量的金融工具

(a)各层次公允价值计量

于2018年6月30日，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中属于第一层次的余额为9,431,928.00元，属于第二层次的余额为9,966,700.00元，无属于第三层次的余额。2017年6月30日，属于第一层次的余额为120,717,682.29元，无属于第二、三层次的余额。

(b)公允价值所属层次间的大变动

对于证券交易上市中的股票和债券，若出现重大事件停牌、交易不活跃(包括涨停或跌停、交易不属于非公开交易等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复之日期间、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调整程度，确定后续公允价值计量所属的层次(第二层次至第三层次)。

(c)第三层次公允价值余额和本期变动金额

(d)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018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(2017年6月30日)。

(e)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融工具金额主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差不多。

(f)减值

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[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》的规定，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。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.2 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货合约

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.4 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国债期货合约

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.5 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股票投资

注：本基金本报告期末持有股票200只。

7.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资

注：本基金本报告期末持有债券200只。

7.7 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资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.1 报告期末基金资产组合情况

单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	69,431,928.00	65.13
2	其中：股票	69,431,928.00	65.13
3	固定收益投资	8,966,700.00	9.83
4	其中：债券	8,966,700.00	9.83
5	金融衍生品投资	-	-
6	其他资产	10,000,000.00	10.96
7	其中：买入返售金融资产	10,000,000.00	10.96
8	其他	14,966,224.44	16.04
9	其中：应收款项	14,966,224.44	16.04
10	其他	159,570.76	1.37
11	其中：应收股利	159,570.76	1.37
12	其他	519.08	-
13	其中：其他资产	519.08	-
14	其他	91,246,424.40	158,703,210.88
15	其中：银行存款	91,246,424.40	158,703,210.88
16	其他	12,466,742.27	13.64
17	其中：其他负债	381,054.13	0.42
18	其他	91,246,424.40	100.00

8 报告期末基金管理人及基金托管人

8.1 基金管理人

北信瑞丰基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区望京阜通东大街10号
法定代表人：朱明
总经理：朱明
督察长：朱明
基金经理：朱明

8.2 基金托管人

中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号
法定代表人：王常青
总经理：王常青
督察长：王常青
基金经理：王常青

7.1 报告期末基金资产组合情况

单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	69,431,928.00	65.13
2	其中：股票	69,431,928.00	65.13
3	固定收益投资	8,966,700.00	9.83
4	其中：债券	8,966,700.00	9.83
5	金融衍生品投资	-	-
6	其他资产	10,000,000.00	10.96
7	其中：买入返售金融资产	10,000,000.00	10.96
8	其他	14,966,224.44	16.04
9	其中：应收款项	14,966,224.44	16.04
10	其他	159,570.76	1.37
11	其中：应收股利	159,570.76	1.37
12	其他	519.08	-
13	其中：其他资产	519.08	-
14	其他	91,246,424.40	158,703,210.88
15	其中：银行存款	91,246,424.40	158,703,210.88
16	其他	12,466,742.27	13.64
17	其中：其他负债	381,054.13	0.42
18	其他	91,246,424.40	100.00

8.1 报告期末基金管理人及基金托管人

8.1 基金管理人

北信瑞丰基金管理有限公司
住所：北京市朝阳区望京阜通东大街10号
法定代表人：朱明
总经理：朱明
督察长：朱明
基金经理：朱明

8.2 基金托管人

中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号
法定代表人：王常青
总经理：王常青
督察长：王常青
基金经理：王常青

7.1 报告期末基金资产组合情况

单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	69,431,928.00	65.13
2	其中：股票	69,431,928.00	65.13
3	固定收益投资	8,966,700.00	9.83
4	其中：债券	8,966,700.00	9.83
5	金融衍生品投资	-	-
6	其他资产	10,000,000.00	10.96
7	其中：买入返售金融资产	10,000,000.00	10.96
8	其他	14,966,224.44	16.04
9	其中：应收款项	14,966,224.44	16.04
10	其他	159,570.76	1.37
11	其中：应收股利	159,570.76	1.37
12	其他	519.08	-
13	其中：其他资产	519.08	-
14	其他	91,246,424.40	158,703,210.88
15	其中：银行存款	91,246,424.40	158,703,210.88
16			