北信瑞丰丰利混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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:2018年8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的法律责任。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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018年8月22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。

北信瑞丰丰利混合型证券投资基金(以下简称“北信瑞丰丰利”)根据《北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,由北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后转型而来。自2018年6月27日起,“北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金”转型为“北信瑞丰丰利混合型证券投资基金”,并自该日起《北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金基金合同》失效且《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金合同》同时生效。

本报告中财务资料未经审计。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

自2018年6月27日起原北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金转型为北信瑞丰丰利混合型证券投资基金。原北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金本报告期自2018年1月1日起至2018年6月26日止, 北信瑞丰丰利混合型证券投资基金本报告期自2018年6月27日(基金合同生效日)起至2018年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况(转型后)

基金简称	北信瑞丰丰利
基金主代码	002745
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年6月27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	76,139,669.47份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况(转型前)

基金简称	北信瑞丰丰利保本
基金主代码	002745
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年6月21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	93,444,368.84份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明(转型后)

投资目标	本基金主要投资于股票等权益类资产和债券等固定收益类金融工具,通过科学的资产配置与严谨的风险管理,力争超越业绩比较基准,实现基金资产持续稳定增值。
投资策略	1.资产配置策略 本基金采用自上而下的策略,通过对宏观经济基本面(包括经济运行周期、财政及货币政策、产业政策等)的分析判断,和对资产性水平(包括资金供需情况、证券市场长期水平等)的深入研究,分析股票市场、债券市场、货币市场三大资产的预期风险和收益,并据此对本基金资产在股票、债券、现金之间的投资比例进行动态调整。 2.股票投资策略 本基金的股票投资策略包括行业配置策略和个股投资策略。 3.债券投资策略 对于固定收益类资产的选择,本基金将以价值分析为主线,在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理,并主要通过类属配置与债券选择两个层次进行投资管理。在类属配置层次,结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析,根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征,定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整,确定各类资产的最优权重。在券种选择上,本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济趋势,货币政策及不同债券品种的收益率水平,商品性和信用风险等因素,重点选择那些高流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。 4.权证投资策略 本基金管理人将充分考虑权证期限价值的波动性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择、组合管理进行投资,旨在通过投资期货实现基金的套期保值。 5.股证投资策略 股证为本基金辅助性投资工具。其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在股证投资方面将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其内在定价的基础上,立足于大风险套利,尽量减少组合外部波动率,力求稳健的超额收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*20%+中债总财富指数收益率*80%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中高风险、中高预期收益的品种。

2.2 基金产品说明(转型前)

投资目标	本基金通过稳健资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理,在严格控制风险的基础上,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金运用恒定比例组合保险策略(Constant Proportion Portfolio Insurance,以下简称CPPI策略),动态调整稳健资产与风险资产在基金组合中的投资比例,以确保本基金在保本期到期时的本金安全,并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。具体运用,本基金的投资策略包括大类资产配置策略、稳健资产投资策略和风险资产投资策略。
业绩比较基准	两年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。

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	郭征	刘静
	联系电话	010-68619941	010-66223586
	电子邮箱	service@bxfund.com	liuyie14@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		4006617297	96526
传真		010-68619900	010-66226045

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bxrfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年6月27日(基金合同生效日)至2018年6月30日
本期已实现收益	26,487.97
本期利润	37,466.00
加权平均基金份额本期利润	0.0005
本期基金份额净值增长率	0.04%
3.1.2 期末数据和指标	2018年6月30日
期末可供分配基金份额利润	0.0354
期末基金资产净值	78,836,886.04
期末基金份额净值	1.0354

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末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。

4、报告期自2018年6月27日至2018年6月30日止。

转型前

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年1月1日至2018年6月26日
本期已实现收益	2,704,607.77
本期利润	4,419,369.05
加权平均基金份额本期利润	0.0153
本期基金份额净值增长率	1.47%
3.1.2 期末数据和指标	2018年6月26日
期末可供分配基金份额利润	0.0349
期末基金资产净值	96,709,752.81
期末基金份额净值	1.036

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末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。

4、报告期自2018年1月1日至2018年6月26日止。

3.2 基金净值表现(转型后)

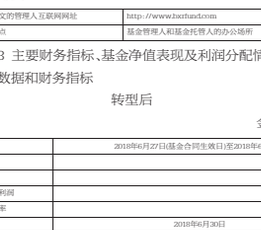
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
自基金合同生效起至今	0.04%	0.01%	0.35%	0.46%	-0.31%	-0.45%

注:1、本基金由北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金转型而来并与2018年6月27日起合同生效,因此上表报告期间的起始日为2018年6月27日。截止本报告期末本基金合同生效未满一个季度。

2、本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*20%+中债总财富指数收益率*80%

3.2.2 自基金转型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



注:1、本基金由北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金转型而来并与2018年6月27日起合同生效,因此上表报告期间的起始日为2018年6月27日。截止本报告期末本基金合同生效未满一个季度。

2、本基金建仓期为自基金合同生效日起的六个月。截至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

3.2 基金净值表现(转型前)

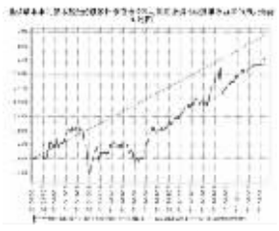
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.19%	0.06%	0.15%	0.01%	0.04%	0.04%
过去三个月	0.58%	0.04%	0.52%	0.01%	0.06%	0.03%
过去六个月	1.47%	0.07%	1.04%	0.01%	0.43%	0.06%
过去一年	2.58%	0.06%	2.11%	0.01%	0.47%	0.05%
自基金合同生效起至今	3.50%	0.08%	4.34%	0.01%	-0.84%	0.07%

注:根据《北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,2018年6月21日为本基金的第一个保本周期到期日。

在本基金保本周期到期期间,即自2018年6月21日(含)起至2018年6月26日(含)止本基金接受赎回、转换转出申请,不接受申购和转换转入申请。自2018年6月27日,“北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金”转型为“北信瑞丰丰利混合型证券投资基金”,因此上表报告期间的结束日为2018年6月26日。本基金转型前以两年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准。

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



注:根据《北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,2018年6月21日为本基金的第一个保本周期到期日。

在本基金保本周期到期期间,即自2018年6月21日(含)起至2018年6月26日(含)止本基金接受赎回、转换转出申请,不接受申购和转换转入申请。自2018年6月27日,“北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金”转型为“北信瑞丰丰利混合型证券投资基金”,因此上表报告期间的结束日为2018年6月26日。

§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。公司结合基金行业特点改善公司治理结构,积极推进股权激励,并在专户业务及子公司各业务条线进行事业部制改革。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。

截至报告期末,公司共有16只公募产品,保有140只专户产品,资产管理规模超过370亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介(转型后)

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		
邓猛	基金经理	2017年6月15日	-	8	CFA、FRM持证人。南开大学理学学士、北京大学工程硕士。2010年7月至2012年8月在国家开发银行天津市分行,任一级业务员(副科级);2012年9月至2014年10月在国网英大保险资产管理公司(原英大财投资管),担任固定收益投资经理;2014年11月至2016年8月,在中国工商银行总行,资产管理部固定收益处,担任投资经理,现任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理。
董馨洋	基金经理	2018年4月4日	-	7	英国圣安德鲁斯金融管理硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。2011年至2015年曾任联合资信评估有限公司高级分析师。从事中国债券市场工商企业信用评级工作。2015年8月加入北信瑞丰基金管理有限公司,曾任研究员、基金经理助理。

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、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介(转型前)

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		
邓猛	基金经理	2017年6月15日	-	8	CFA、FRM持证人。南开大学理学学士、北京大学工程硕士。2010年7月至2012年8月在国家开发银行天津市分行,任一级业务员(副科级);2012年9月至2014年10月在国网英大保险资产管理公司(原英大财投资管),担任固定收益投资经理;2014年11月至2016年8月,在中国工商银行总行,资产管理部固定收益处,担任投资经理,现任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理。
董馨洋	基金经理	2018年4月4日	-	7	英国圣安德鲁斯金融管理硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。2011年至2015年曾任联合资信评估有限公司高级分析师。从事中国债券市场工商企业信用评级工作。2015年8月加入北信瑞丰基金管理有限公司,曾任研究员、基金经理助理。

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、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《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,本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效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 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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合, 制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《北信瑞丰基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定。

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

回顾上半年,海外方面,美国特朗普不断对中国进行施压,挑起和加码贸易战,给国内经济造成较大的外围压力;此外,美国处于加息周期,对人民币汇率造成一定的压力;国内经济方面,在国内去杠杆政策的大背景下,银行非标回表,城投平台和房地产的融资渠道受到一定影响,社融、M2均下滑,通胀较低,工业增加值、社会零售总额明显下滑,中国经济增速缓慢下行。资金面边际转向宽松,3个月存单利率大幅下行,下行幅度将近80bp,流动性溢价大幅降低。利率债方面,受到资金面宽松和避险情绪的影响,利率债上半年全面下行,短端下行幅度大于长端下行幅度,期限利差有所上升; 信用债方面,5月初资管新规出台、叠加年初以来风险事件频发,信用利差有所分化。可转债方面,受到股市走熊的影响,上半年中证转债指数在1月底以后震荡下行。

权益市场,2018年以来A股市场受到了内部去杠杆和外部贸易战等一系列冲击,走出了明显的弱市特征。上半年119个交易日中,上证综指、深证成指和创业板指分别累计下跌13.90%、15.04%和8.33%,在全球主要市场中处于垫底位置。沪深两市总市值较2017年底缩水7.24万亿元。按行业来看,两市仅休闲服务、医药生物和食品饮料三个行业指数上涨,其余均不同程度下跌。从当前两市PE、PB的国际比较及历史比较来看,A股整体估值已到达低点位置, 但尚不能简单判断为见底,市场仍需经历一波对上半年各种负面事件的业绩落地。

在报告期内,我们本着保本的投资策略,持续进行稳健的债券投资。通过合理控制债券组合久期,动态调整债券品种。保障组合的流动性和收益率的稳定性在波动中寻找高性价比的债券产品,以期为投资者提供稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至转型后报告期末,本基金份额净值为1.0354元,本报告期(2018年6月27日至2018年6月30日)份额净值增值率为0.04%,业绩比较基准增长率为0.35%。截至转型前报告期末,本基金份额净值为1.0350元,本报告期(2018年1月1日至2018年6月26日)份额净值增值率为1.47%,业绩比较基准增长率为1.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2018年下半年,中国债券市场外部发展环境较好。海外方面,贸易争端持续发酵、避险情绪阶段性利好债券市场;国内经济方面,经济增速或将逐步放缓、稳中趋降,固定资产投资缓慢下行,房地产受宏观政策调控显著、基建尚待发力托底,消费尚难以支撑,进出口贸易受贸易争端及海外需求影响较大。货币政策方面,受到国内外经济、利率形势影响,中国货币政策将维持稳健格局,保持流动性合理充裕,积极引导资金向信贷投放。我们预计今年年内,债券市场将走出震荡上涨格局,其中短端资金价格波动、中期经济基本面预期差可能会给债券市场带来短时扰动。在投资策略上,我们建议适度拉长久期,进行波动操作,以便给投资者带来稳定、长期的回报。

权益方面,放眼下半年,内部政策有逐渐趋暖的迹象,“补短板”大概率成为下半年的投资主线。除了基建、水利、精准扶贫及乡村振兴等传统板块之外,通信、计算机、制造业升级等新兴维度也有望成为发力点。但外部扰动仍将是市场的主要风向标, 美联储的货币收缩及贸易战扩散导致的全球避险情绪加剧可能共同对新兴市场的货币回流和汇率造成压迫。在机构预期高度一致且趋势性机会不明朗的背景下,市场或通过中短期的反弹来洗刷投资机会,从指数轮动逐渐向龙头行业及个股分化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本管理人根据中国证监会[2017]13号公告《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、[2008]38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(2017年9月5日废止)等相关规定,继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设有基金估值工作小组,由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、研究人员、市场人员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成(具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定)。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件, 发现估值问题; 提议基金估值调整的相关方案并进行校验; 根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案。

基金运营部根据基金估值工作小组的决定进行相关具体的估值调整或处理,并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的,由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果,基金运营部业务人员复核后使用。

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。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》, 并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值(适用非货币基金)或影子定价(适用货币基金和理财类基金)。

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

无。

§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

本报告期内,本基金托管人在托管北信瑞丰丰利混合型证券投资基金(原北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金)(以下称“本基金”)的过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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、基金费用开支等方面进行了认真地复核,对本基金的投资运作进行了监督, 未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、收益分配情况、投资组合报告的内容(“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内),保证复核内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)(转型后)

6.1 资产负债表

会计主体:北信瑞丰丰利混合型证券投资基金

报告截止日: 2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日
资产:	
银行存款	5,829,024.20
结算备付金	39,674.74
存出保证金	38,003.70
交易性金融资产	40,132,940.50
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	40,132,940.50
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	31,500,000.00
应收证券清算款	-
应收利息	1,744,280.81
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	79,274,923.96
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日
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	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	199,967.57
应付托管费	32,869.88
应付销售服务费	-
应付交易费用	15,719.72
应交税费	65,549.41
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	123,972.33
负债合计	438,068.91
所有者权益:	
实收基金	76,139,669.47
未分配利润	2,697,185.57
所有者权益合计	78,836,886.04
负债和所有者权益总计	79,274,923.96

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.0354元,基金份额总额76,139,669.47份。

6.2 利润表

会计主体:北信瑞丰丰利混合型证券投资基金

本报告期:2018年6月27日(基金合同生效日)至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年6月27日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、收入	56,236.56
1.利息收入	45,284.52
其中:存款利息收入	1,632.31
债券利息收入	19,251.57
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	24,374.64
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	10,976.03
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-
减:二、费用	18,770.56
1. 管理人报酬	13,691.02
2. 托管费	1,825.47
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	0.12
5. 利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6. 税金及附加	34.22
7. 其他费用	3,219.72
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	37,466.00
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	37,466.00

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:北信瑞丰丰利混合型证券投资基金

本报告期:2018年6月27日(基金合同生效日)至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年6月27日(基金合同生效日)至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	93,444,368.84	3,295,383.97	96,709,752.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	37,466.00	37,466.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-17,304,699.37	-635,664.40	-17,940,363.77
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-17,304,699.37	-635,664.40	-17,940,363.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	76,139,669.47	2,697,185.57	78,836,886.04

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:

_____朱彦_____ _____朱彦_____ _____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

北信瑞丰丰利混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金转型而来。北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金的基金管理人北信瑞丰基金管理有限公司于2018年6月15日发布《北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型相关业务规则的公告》。根据公告,北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金转型为非保本的混合型证券投资基金, 基金名称相应变更为“北信瑞丰丰利混合型证券投资基金”, 北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金份额转换为北信瑞丰丰利混合型证券投资基金份额。转型后,基金的托管人、登记机构、基金代码不变。自2018年6月27日起《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金合同》、《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金托管协议》生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。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(以下简称“北京银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资对象是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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具,债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)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的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的0%-40%;其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款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。权证投资占基金资产净值的比例不超过3%; 每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后,现金或到期日在一年以内的政府债券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:沪深300指数收益率*20%+中债总财富指数收益率*80%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表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2018半年度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2018年6月30日的财务状况以及2018年6月27日(基金转型日)至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2018年6月27日(基金转型日)至2018年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准