

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

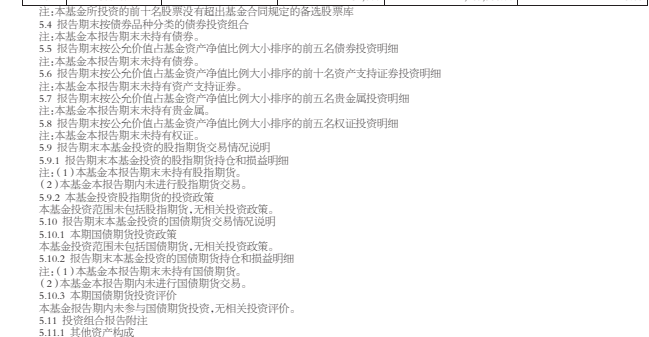
2016 第一季度 报告

2016年3月31日

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	47,592,664.66	70.55
	其中：股票	47,592,664.66	70.55
2	基金投资	--	--
3	固定收益投资	--	--
	其中：债券	--	--
	资产支持证券	--	--
4	贵金属投资	--	--
5	金融衍生品投资	--	--
6	买入返售金融资产	--	--
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	--	--
7	银行存款和结算备付金合计	3,760,504.35	5.57
8	其他资产	16,102,417.12	23.87
9	合计	67,455,586.13	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,653,153.00	2.78
B	采矿业	25,060.10	0.04
C	制造业	19,111,093.94	32.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	31,654.62	0.05
F	批发和零售业	—	—
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	10,833,388.00	18.23
J	金融业	13,053,488.00	21.96
K	房地产业	633,435.00	1.07
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	2,251,392.00	3.79
S	合计	47,592,664.66	80.08

序号	股票代码	公司简称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300076	国瓷材料	176,219	3,987,835.97	6.71
2	002664	金利科技	58,985	3,624,628.25	6.10
3	002574	明牌珠宝	315,000	3,622,500.00	6.10
4	600715	松辽汽车	79,636	2,766,336.00	5.51
5	300059	东方财富	70,000	3,101,000.00	5.32
6	600857	赛迪信息	200,000	2,838,000.00	4.81
7	600712	康恩贝股份	125,000	2,742,500.00	4.61
8	000540	纳思达	40,000	2,333,000.00	3.95
9	600302	北京文化	83,200	2,251,902.00	3.78
10	000809	国金证券	151,600	2,187,580.00	3.69



报告期期初基金份额总额		单位:份
报告期期间基金总申购份额	11,110,296.78	
报告期期间基金总赎回份额	13,113,286.83	
减:报告期期间基金总拆入份额	61,806,164.96	
报告期期间基金总拆出份额(拆入减少以“-”填列)	-	
报告期期末基金份额总额	64,251,414.35	

注:总申购份额含转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

7.1 基金管理人持有本基金基金份额情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期期初管理人持有的本基金份额	14,653,762.38	单位:份
报告期期间买入/申购总份额	0.00	
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	
报告期期末管理人持有的本基金份额	14,653,762.38	
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	22.81	

7.3 基金管理人运用固有资金投资本基金其他款项

注:本报告期,本公司未运用固有资金购买、赎回本基金。

8 报告期末发起式基金基金合同持有份额情况

项目	持有份额占基金总份额比例(%)	发起式份额占基金总份额比例(%)	发起式份额占基金总份额比例(%)	发起式份额期末持有份额
基金管理人发起基金	14,653,762.38	22.81	9,999,200.00	15.56

基金管理人高级管理人员	1,290,552.19	2.01	1,290,552.19	2.03	3年
基金经理等人员	254,451.65	0.40	254,451.65	0.40	3年
基金管理人股东	0.00	0.00	0.00	0.00	-
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	-
合计	16,201,766.22	25.22	11,547,203.84	17.97	-

无。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

§10 备查文件目录

10.1 《信邦瑞丰无固定期限主题灵活配置混合型发起式证券投资基金合同》。
 2. 《信邦瑞丰无固定期限主题灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》。
 3. 《信邦瑞丰无固定期限主题灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》。
 4. 中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地
 基金管理人和本基金托管人的住所,并开放于基金管理人网站: www.hbsfund.com。

10.3 查阅方式
 投资者可以在开放时间内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅,也可登陆基金管理人网站: www.hbsfund.com 查阅。

信邦瑞丰基金管理有限公司
 2016年04月21日

注：本基金跟踪标的指数成份券的债券投资组合

9.4 报告期末基金资产组合中持有的国债公允价值情况表

注：本基金本报告期未持有国债。

9.5 报告期末按公允价值占基金净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：本基金本报告期未持有资产支持证券。

9.6 报告期末按公允价值占基金净资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期未有贵金属。

9.7 报告期末按公允价值占基金净资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期未有权证交易。

9.8 报告期末基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期未参与股指期货交易。

5.9.1 报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细见本报告期末“股指期货投资”。

5.9.2 本基金股指期货投资的持仓政策。

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

5.10 报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资的政策。

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

5.10.2 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细见附注（1）本基金本报告期末未持有国债期货。

（2）本基金本报告期末未进行国债期货交易。

5.10.3 本基金国债期货投资的政策。

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资政策。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现在监管部门立案调查，或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同约定的备选证券库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	689,645.64
2	应收证券清算款	3,932,361.41
3	应收资产	

4	应收利息			8,479.53
5	应收申购款			234,962.91
6	其他应收款			
7	持摊费用			
8	其他			
9	合计			4,865,649.49

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分公允价值 (元)	占基金资产净值比 例(%)	流通受限情况说明
1	002200	科大讯飞	7,456,600.00	4.83	筹划重大事项

注：本基金截至 2016 年 3 月 31 日止持有以上因公司的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票得在所在市场事项重大影响期间，经交易场所恢复交易。

5.11.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

由于计算中四舍五入的原因，本报告各分项之和与合计数之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金资产变动

报告期初基金份额总额	151,718,651.12
报告期基金总申购份额	18,158,174.04

单位：元

减:报告期前基金总额扣除份额	14,452,072.03
报告期前基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	155,424,753.13

注:已申购份额扣除转入份额,已赎回份额扣除转出份额。

7.3 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.3.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本基金管理人、本公司未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

7.3.2 基金管理人运用固有资金投资本基金之明细情况

注:本报告期内,本公司未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

7.4 8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金合同;
2. 北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书;
3. 北信瑞丰平安中国主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议;
4. 中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所,并载于基金管理人网站www.bxfund.com。

9.3 查阅方式

投资者可以在开放时间内至基金管理人或基金托管人处免费查阅,也可登陆基金管理人网站 www.bxfund.com 查询。

北信瑞丰基金管理有限公司
