北信瑞丰现金添利货币市场基金

2019 第二季度 报告

2019年6月30日

基金管理人:北信瑞丰基金管理有限公司
基金托管人:华夏银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月18日

§1 重要提示

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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年07月15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2019年04月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	北信瑞丰现金添利	
交易代码	000981	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年1月20日	
报告期末基金份额总额	1,150,965,332.22份	
投资目标	在力求基金资产安全性、流动性的基础上,追求超过业绩比较基准的稳定收益。	
投资策略	本基金通过资产配置策略、债券筛选策略、现金流管理策略、资产支持证券投资策略、其他金融工具的投资策略。在有效风险管理的前提下,通过对标的品种的基本面研究,结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险,谨慎投资。	
业绩比较基准	按税后计算的中国人民银行公布的人民币活期存款基准利率	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
基金管理人	北信瑞丰基金管理有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	北信瑞丰现金添利A	北信瑞丰现金添利B
下属分级基金的交易代码	000981	000982
报告期末下属分级基金的份额总额	34,263,824.81份	1,116,701,507.41份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 — 2019年6月30日)	
	北信瑞丰现金添利A	北信瑞丰现金添利B
1. 本期已实现收益	239,198.39	5,236,870.39
2. 本期利润	239,198.39	5,236,870.39
3. 期末基金资产净值	34,263,824.81	1,116,701,507.41

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入本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

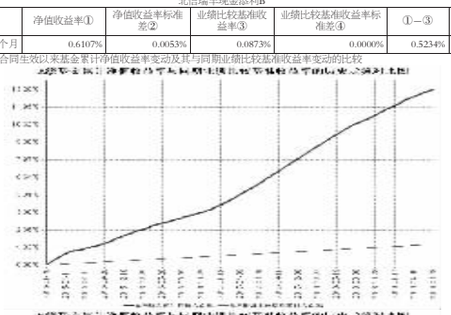
北信瑞丰现金添利A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.5501%	0.0053%	0.0873%	0.0000%	0.4628%	0.0053%

北信瑞丰现金添利B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.6107%	0.0053%	0.0873%	0.0000%	0.5234%	0.0053%

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



注:本报告期,本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁大吉	基金经理	2017年6月13日	2019年4月24日	8	梁大吉先生,中国人民大学经济学学士,中国人民大学理论经济学硕士。2011年7月至2016年4月曾任中德信用增进投资股份有限公司投资部交易员,投资经理等。2016年5月加入北信瑞丰基金管理有限公司投资研究部,任基金经理助理,现任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理。
董鑫洋	基金经理	2018年5月15日	-	8	董鑫洋女士,英国圣安德鲁斯金融管理硕士。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。现任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理。

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 公平交易专项说明

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《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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年二季度,债券市场的核心焦点仍在于国内经济,在对经济未来走势不确定下,债券市场横盘整理,配酿方向选择。二季度,固定资产投资略有回落,制造业投资乏力,房地产投资处于相对高位但不可持续,进出口受贸易战影响逐步显现,整体经济增速或有所放缓;但我们同时注意到,地方政府专项债发行提速、基建或成为拉动经济的主要力量之一,减税降费效应逐步体现,带动企业利润有所提升,G20后贸易谈判重启,中国推动形成全球多边贸易体系,都将为中国经济发展贡献出一定的力量。在多空交杂的格局下,债券市场横盘整理选择方向。央行,突发的包商银行事件,打破银行刚兑信仰,避险情绪引发资金、债券、金融机构结构性分层,信用利差亦有所扩张。

本基金在2019年一度坚持货币基金作为流动性管理工具的定位,继续保持投资组合较好 的流动性和合适的剩余期限。基金投资类属配置以同业存单、逆回购、金融债和信用相对较好的短期融资券为主,追求相对稳定的投资收益。本基金管理人始终将基金资产安全和基金收益稳定的重要性置于高收益的追求之上,在综合考虑基本面、货币政策和资金面变化的具体情况下,结合考虑流动性需求,抓住重要时点进行配置相对低风险和高收益的产品,并根据债券市场的波动合理地进行交易操作。本基金管理人始终将基金资产安全和基金收益稳定的重要性置于高收益的追求之上,坚持规范运作、审慎投资,勤勉尽责地为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期北信瑞丰现金添利A的基金份额净值收益率为0.5501%,本报告期北信瑞丰现金添利B的基金份额净值收益率为0.6107%,同期业绩比较基准收益率为0.0873%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	693,557,609.58	60.23
	其中:债券	663,407,516.14	57.61
	资产支持证券	30,150,093.44	2.62
2	买入返售金融资产	447,229,130.87	38.84
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,530,729.22	0.13
4	其他资产	9,263,455.97	0.80
5	合计	1,151,580,925.64	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		0.31
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	38
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	58
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	38

注:本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内,未发生投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	56.63	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	22.62	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	6.96	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	6.96	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	6.08	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.25	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,074,182.85	5.22
	其中:政策性金融债	60,074,182.85	5.22
4	企业债券	3,000,591.17	0.26
5	企业短期融资券	450,436,181.38	39.14
6	中期票据	30,060,307.56	2.61
7	同业存单	119,836,253.18	10.41
8	其他	-	-
9	合计	663,407,516.14	57.64
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111916081	19上海银行CD081	500,000	49,995,848.30	4.34
2	111814228	18江苏银行CD228	500,000	49,873,251.89	4.33
3	120235	12国开35	300,000	30,057,785.88	2.61
4	011900842	19华能水电SCP008	300,000	30,009,093.87	2.61
5	071900047	19招商CP005	300,000	30,000,107.26	2.61
6	011802530	18华晨SCP004	300,000	30,000,045.55	2.61
7	011901232	19大唐新能SCP001	300,000	29,986,051.54	2.61
8	041800379	18央投集团CP001	200,000	20,100,757.39	1.75
9	011802217	18比亚迪SCP005	200,000	20,052,223.28	1.74
10	011802315	18金地SCP003	200,000	20,050,387.28	1.74

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1097%
报告期内偏离度的最低值	0.0198%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0698%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内没有负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内没有正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	139053	深信银2A	300,000	30,039,000.00	2.61

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提摊益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.00元。

5.8.2 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被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	15,264.97
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	9,247,670.00
4	应收申购款	521.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	9,263,455.97

5.8.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	北信瑞丰现金添利A	北信瑞丰现金添利B
报告期期初基金份额总额	60,100,216.24	898,513,716.78
报告期期间基金总申购份额	13,224,244.34	1,045,091,509.55
报告期期间基金总赎回份额	39,060,635.77	826,903,718.92
报告期期末基金份额总额	34,263,824.81	1,116,701,507.41

注:申购含红利再投、转换入及基金份额自动升降级调增份额,赎回含转换出及基金份额自动升降级调减份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2019年5月15日	1.00	1.00	-
2	赎回	2019年5月16日	1.00	1.00	-
3	申购	2019年5月22日	4.00	4.00	-
4	赎回	2019年5月24日	1.50	1.50	-
5	赎回	2019年5月24日	0.50	0.50	-
6	赎回	2019年5月27日	1.00	1.00	-
合计			9.00	9.00	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	序号	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
		持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190401-20190620	274,687,334.81	1,640,818.66	100,000,000.00	176,328,153.47	15.32%
	2	20190401-20190616 20190620-20190623	208,447,787.68	1,279,802.92	-	209,727,590.60	18.22%
	3	20190606-20190630	-	250,330,879.25	-	250,330,879.25	21.75%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品持有风险							
无。							

注:1、管理人按照基金合同独立进行投资决策,不存在通过投资顾问或其他方式让渡投资决策权的情况;

2、管理人已制定投资者集中度管理制度,根据该制度管理人将不再接受份额占比已经达到或超过50%的单一投资者的新增申购;管理人将严格按照相关法规及基金合同审慎确认大额申购与大额赎,加强流动性管理;

3、因本基金存在单一投资者持有基金份额比例较为集中(超过20%)的情况,持有基金份额比例集中的投资者(超过20%)申请全部或大比例赎回时,会给基金资产变现带来压力,进而造成基金净值下跌压力。因此,提醒投资者本产品存在单一投资者持有基金份额比较集中(超过20%)而转有的流动性风险。但在巨额赎回情况下管理人将采取相应赎回限制等措施,以保障中小投资者合法权益。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息披露。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《北信瑞丰现金添利货币市场基金基金合同》。

2、《北信瑞丰现金添利货币市场基金招募说明书》。

3、《北信瑞丰现金添利货币市场基金托管协议》。

4、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所,并登载于基金管理人网站www.bxrfund.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住所免费查阅,也可登陆基金管理人网站www.bxrfund.com查阅。

北信瑞丰基金管理有限公司
2019年7月18日

北信瑞丰外延增长主题灵活配置混合型发起式证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019年6月30日

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:2019年7月18日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年07月15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2019年04月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	北信瑞丰外延增长主题灵活配置
交易代码	002123
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5月17日
报告期末基金份额总额	124,077,724.99份
投资目标	本基金通过积极灵活的资产配置,采用自下而上的投资方法,以基本面分析为立足点,重点投资于外延增长主题的上市公司,优中选优,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、个券精选。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权证投资策略四部分组成。在严格控制投资组合风险的前提下,动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例,力图规避市场风险,提高配置效率。
业绩比较基准	中证800指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益低于股票型基金、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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 — 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	1,079,749.35
2.本期利润	2,945,464.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.0358
4.期末基金资产净值	122,975,268.55
5.期末基金份额净值	0.991

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;

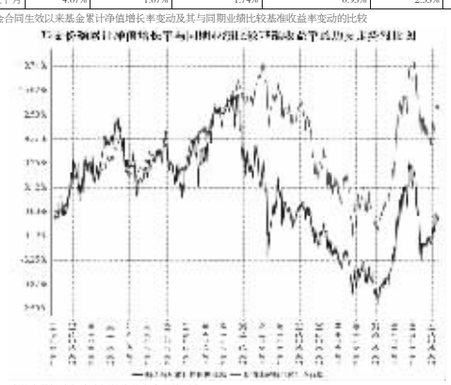
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	-4.07%	1.07%	-1.74%	0.93%	-2.33%	0.14%

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:本报告期,本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

3.3 其他指标

无。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
程敏	基金经理	2018年3月26日	-	9	程敏先生,清华大学数学学士、概率统计专业硕士,9年证券基金行业从业经历。历任中航证券资产管理分公司量化研究员、投资主办、方正证券资产管理分公司投资主办、量化团队负责人。2017年3月加入北信瑞丰基金管理有限公司,现任北信瑞丰外延增长混合基金基金经理。

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

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责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 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统一的研究平台,为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时,在投资决策过程中,各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度,保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节,本基金管理人实行集中交易制度,按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节,本基金管理人定期对股票交易情况进行分析,并出具公平交易执行情况分析报告;另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查,并对发现的问题进行及时报告。

综上所述,本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,由于经济增长预期不明朗、贸易摩擦加剧等因素作用,市场再次陷入震荡;结构上同样出现较大分化,包括消费、金融等板块得到市场较高的关注度,大市值因子同样获得更高的估值溢价,中小市值公司则出现较大波动,上证50期间上涨3.24%,中证500、中证1000、创业板指均有10%左右的下跌。板块表现方面,食品饮料、家电、非银等核心资产类的个股表现相对更为强势,而以计算机、传媒、电子为首的科技类个股相对跌幅较大。分析其原因,贸易战带来的不确定性导致投资者的风险偏好有较大幅度的下降,另外,包商银行事件带来的风险也引起了投资者情绪上的波动。

在整体货币政策宽松、利率处在历史低位的环境下,A股权益类资产风险补偿依旧具备较高吸引力;另一方面,在贸易摩擦、结构转型等因素作用下,经济整体增速依然面临一定的放缓压力。

本基金严格按照量化投资模型进行选股和资产配置,在有效控制主动投资风险的前提下,力求继续获得超越市场的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.991元;本报告期基金份额净值增长率为-4.07%,业绩比较基准收益率为-1.74%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从2019年5月17日至2019年6月30日基金持有人数连续超过20个工作日低于200人。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	72,144,613.21	58.45
	其中:股票	72,144,613.21	58.45
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	38,000,000.00	30.79
	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	12,989,430.89	10.52
8	其他资产	300,557.38	0.24
9	合计	123,434,601.48	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	7,190,438.00	5.85
C	制造业	14,480,171.45	11.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,557,781.00	4.52
E	建筑业	4,785,750.00	3.89
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	5,867,667.00	4.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.03
J	金融业	31,563,702.00	25.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,659,500.00	2.16
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	72,144,613.21	58.67

注:以上行业分类以2019年06月30日证监会行业分类标准为依据。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有按行业分类的港股通投资股票。

5.3 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	600036	招商银行	170,000	6,116,600.00	4.97
2	601988	中国银行	1,489,800	5,571,852.00	4.53
3	601288	农业银行	1,534,900	5,525,640.00	4.49
4	601939	建设银行	484,900	3,607,656.00	2.93
5	600377	宁沪高速	325,800	3,499,092.00	2.85
6	601328	交通银行	564,900	3,457,188.00	2.81
7	600011	华能国际	513,700	3,200,351.00	2.60
8	601888	中国国旅	30,000	2,659,500.00	2.16
9	601318	中国平安	29,000	2,569,690.00	2.09
10	601628	中国人寿	89,300	2,528,976.00	2.06

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货,无相关投资政策。

5.10 报告期末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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

(1)本基金本报告期末未持有国债期货。

(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资,无相关投资评价。

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被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金所投资的前十名股票中没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	36,046.40
2	应收证券清算款	86,934.10
3	应收股利	-
4	应收利息	4,603.66
5	应收申购款	172,973.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	300,557.38

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	12,249,314.11
报告期期间基金总申购份额	216,352,407.84
减:报告期期间基金总赎回份额	104,523,996.96
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	124,077,724.99

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,999,291.66
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,999,291.66
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	8.06

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,本公司未运用固有资金申购、赎回本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,999,291.66	8.06	9,999,291.66	8.06	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	49,975.09	0.04	-	-	3年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,049,266.75	8.10	9,999,291.66	8.06	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	序号	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
		持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190101-20190331	9,999,291.66	-	-	9,999,291.66	8.06%
	2	20190516-20190630	-	104,383,089.77	52,191,545.00	52,191,544.77	42.06%
	3	20190513-20190515	-	20,875,782.88	10,437,891.44	10,437,891.44	8.41%
	4	20190513-20190515	-	31,208,768.27	10,332,985.00	20,875,783.27	16.82%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品持有风险							
无。							

注:1、上述单一投资者持有基金份额比例超过20%,该投资者的认(申)购发生于《证基监2017年第02期总第15期机构监管情况通报》发布之前,按照基金合同约定本基金为发起式基金,发起资金提供方认购本基金的总额不少于1000万元,且持有期限不少于3年;

2、管理人按照基金合同独立进行投资决策,不存在通过投资顾问或其他方式让渡投资决策权的情况;

3、管理人已制定投资者集中度管理制度,根据该制度管理人将不再接受份额占比已经达到或超过50%的单一投资者的新增申购;管理人将严格按照相关法规及基金合同审慎确认大额申购与大额赎,加强流动性管理;

4、因本基金存在单一投资者持有基金份额比例较为集中(超过20%)的情况,持有基金份额比例集中的投资者(超过20%)申请全部或大比例赎回时,会给基金资产变现带来压力,进而造成基金净值下跌压力。因此,提醒投资者本产品存在单一投资者持有基金份额比较集中(超过20%)而转有的流动性风险。但在巨额赎回情况下管理人将采取相应赎回限制等措施,以保障中小投资者合法权益。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息披露。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、《北信瑞丰外延增长主题灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》。

2、《北信瑞丰外延增长主题灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》。

3、《北信瑞丰外延增长主题灵活配置混合型发起