

北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本中期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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 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。

本报告期自 2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	9
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 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.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
7.8 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贵金属投资明细.....	41
7.9 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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.11 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息.....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	43
§9 开放式基金份额变动.....	44
§10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
11.1 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.....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	48

§12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金	
基金简称	北信瑞丰鼎盛中短债	
基金主代码	009196	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 29 日	
基金管理人	北信瑞丰基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	474,745,253.48 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	北信瑞丰鼎盛中短债 A	北信瑞丰鼎盛中短债 C
下属分级基金的交易代码:	009196	009197
报告期末下属分级基金的份额总额	473,288,300.94 份	1,456,952.54 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，重点投资中短债主题证券，力争使基金份额持有人获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金重点投资于中短债主题证券，在充分考虑基金资产的安全性、收益性及流动性及严格控制风险的前提下，通过分析经济周期变化、货币政策、债券供求等因素，持续研究债券市场运行状况、研判市场风险，制定债券投资策略，挖掘价值被低估的标的券种，力争实现超越业绩基准的投资收益。 （一）债券资产配置策略 1、久期策略 本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化，对 GDP、CPI、国际收支等引起利率变化的相关因素进行深入研究，通过对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，在预期利率下降时，提高组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，降低组合久期，以规避债券价格下降的风险。以达到利用利率波动和债券组合久期的调整提高债券组合收益目的。 2、收益率曲线策略 本基金根据对收益率曲线形状变动的预期建立或改变组合期限结构。先预测收益率曲线变动的方向，然后根据收益率曲线形状变动的情景分析，构建组合的期限结构。 本基金应用骑乘策略，基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整。当收益率曲线比较陡峭时，即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平相对较高的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券收益率的下滑来获得资本利得收益。 3、类属配置策略 类属配置主要包括资产类别选择、各类资产的适当组合以及对资产组合的管理。本基金将根据对金融债、企业债、公司债、中期票据等债券品种与同期限国债之间收益率利差的扩大和收窄的预期，增加预期利差将收窄的债券类属品

	种的投资比例，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，进而确定具有最优风险收益特征的资产组合。 （二）个券精选策略 本基金主要投资于中短债主题证券，根据债券市场收益率数据，运用利率模型对单个债券进行估值分析，并结合债券的内外部信用评级结果、流动性、信用利差水平、息票率、税赋政策等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。 （1）利率债：主要考虑绝对收益水平和利率变动趋势，配置目标以获取资本利得为主，在信用环境出现恶化及投资组合必须保持相当的流动性时，作为次要防御目标。 （2）信用债：在风险可控前提下，配置信用类债券以获取较高的息票收益和骑乘收益。本基金投资的信用类债券需经国内评级机构进行信用评估，在此基础上，依据公司建立的内部信用评价模型对外部评级结果进行检验和修正，并基于公司对宏观和行业研究的优势，深入分析发行人所处行业发展前景、竞争状况、市场地位、财务状况、管理水平、债务水平、抵押物质量、担保情况、增信方式等因素，评价债券发行人在预期投资期内的信用风险，进一步识别外部评级高估的信用债潜在风险，发掘外部评级低估的信用债投资机会。本基金还将利用交易所和银行间两个投资市场的利差不同，密切关注两个市场之间的利差波动情况，积极寻找跨市场中现券和回购操作的套利机会。 （三）息差策略 本基金可以通过债券回购融入和滚动短期资金作为杠杆，投资于收益率高于融资成本的其它获利机会，从而获得杠杆放大收益。本基金进入银行间同业市场进行债券回购的资金余额不超过基金资产净值的 40%。 （四）资产支持证券投资策略 本基金通过对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，评估资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估值。本基金投资资产支持证券时，还将充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性，控制资产支持证券投资的风险，获取较高的投资收益。
业绩比较基准	中债总财富(1-3 年)指数收益率*85%+一年期定期存款利率(税后)*15%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭亚	许俊
	联系电话	010-68619341	010-66594319
	电子邮箱	service@bxrfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4000617297	95566
传真		010-68619300	010-66594942
注册地址		北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址	北京市海淀区西三环北路 100 号光耀东方中心 A 座 6 层、25 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100048	100818
法定代表人	李永东	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bxrfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	北信瑞丰基金管理有限公司	北京市海淀区西三环北路 100 号光耀东方中心 A 座 6 层、25 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	北信瑞丰鼎盛中短债 A	北信瑞丰鼎盛中短债 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 4 月 29 日 - 2020 年 6 月 30 日)	报告期(2020 年 4 月 29 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	866,298.41	4,020.72
本期利润	-121,702.71	-3,090.19
加权平均基金份额本期利润	-0.0004	-0.0007
本期加权平均净值利润率	-0.04%	-0.07%
本期基金份额净值增长率	0.00%	-0.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-17,197.98	-1,060.10
期末可供分配基金份额利润	0.0000	-0.0007
期末基金资产净值	473,271,102.96	1,455,892.44
期末基金份额净值	1.0000	0.9993
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	0.00%	-0.07%

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. 本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 29 日，截止本报告期末本基金成立未满一年。

3.2 基金净值表现

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

北信瑞丰鼎盛中短债 A

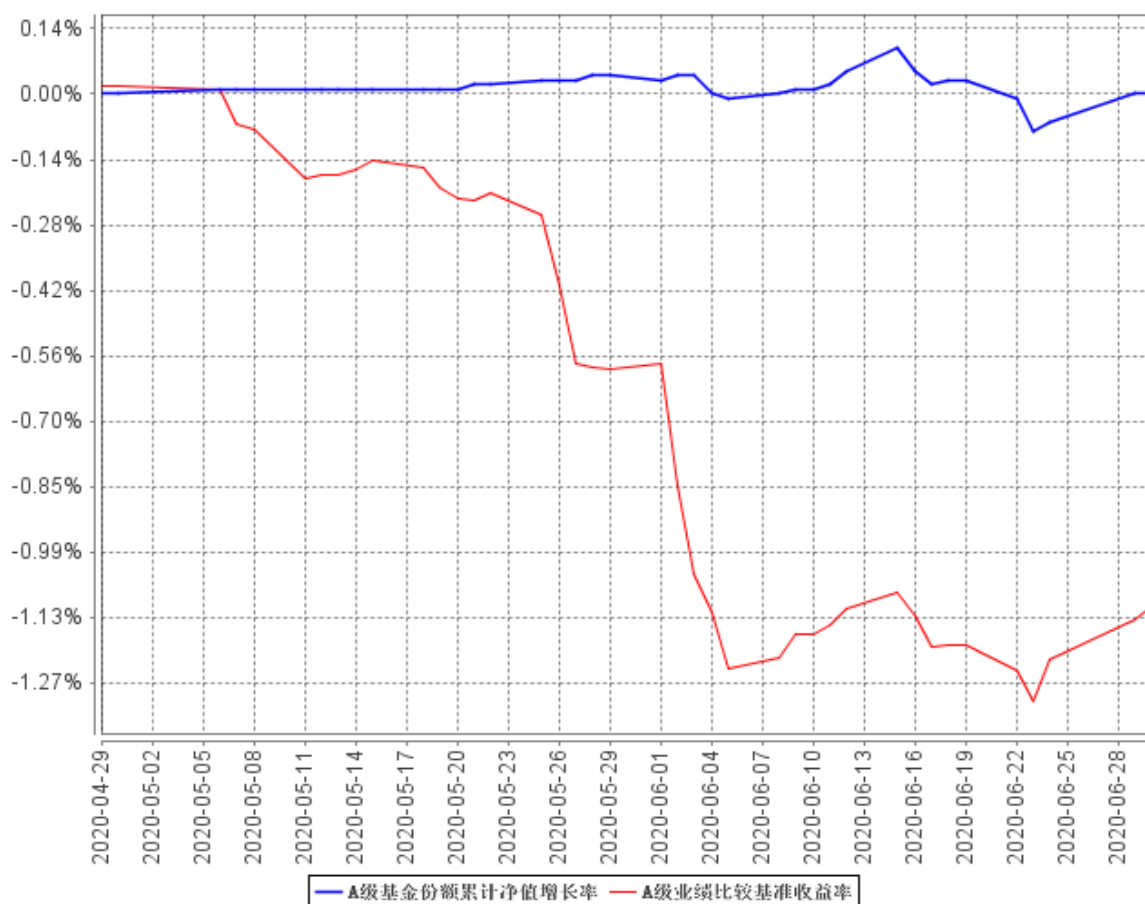
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.04%	0.03%	-0.51%	0.09%	0.47%	-0.06%
自基金合同生效起至今	0.00%	0.02%	-1.10%	0.07%	1.10%	-0.05%

北信瑞丰鼎盛中短债 C

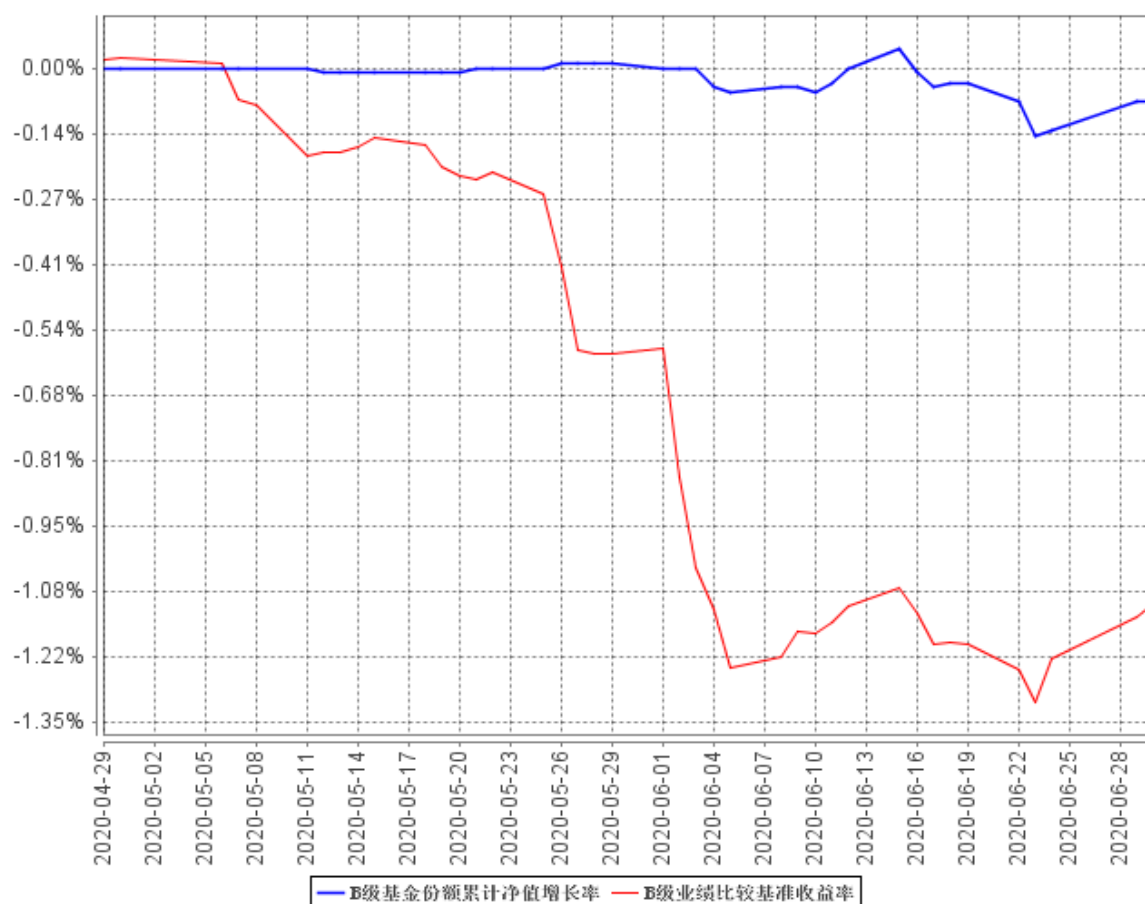
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增长 率标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.08%	0.03%	-0.51%	0.09%	0.43%	-0.06%
自基金合同 生效起至今	-0.07%	0.02%	-1.10%	0.07%	1.03%	-0.05%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 29 日，截止本报告期末本基金成立未满一年，基金成立当年净值增长率以实际存续期计算。报告期内基金的各项投资比例符合基金合同的有关规定。

§ 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。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，公司共成立 18 只公募产品，保有 82 只专户产品，资产管理规模 297.60 亿元，其中公募资产管理规模 110.44 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

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		
肇大吉	基金经理	2020 年 4 月 29 日	-	9 年	肇大吉先生，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 月曾任中债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。

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合规守信情况的说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

今年年初国内爆发新冠疫情，受此影响一季度各项生产活动基本停滞。二季度随着国内疫情缓解和结束，经济缓慢恢复。但是二季度海外疫情又继续爆发，全球经济受到较大影响。伴随着衰退预期的发酵，各国央行都加大了刺激力度，全球各大央行都维持货币政策相对宽松，同时继续推出各种财政政策托底经济。我国央行在经济逐渐恢复的情况下，继续保持流动性合理充裕，但是6月末货币市场边际收紧。预计未来收益率曲线上行压力较大。

报告期内，本基金采取相对稳健的操作策略。主要配置1年左右信用债，通过期限利差获取部分骑乘收益，同时通过一、二级债券市场定价差异等交易性机会增厚收益，也会在资金成本较低的时候，获取一定的杠杆收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末北信瑞丰鼎盛中短债A基金份额净值为1.0000元，本报告期基金份额净值增长率为0.00%；截至本报告期末北信瑞丰鼎盛中短债C基金份额净值为0.9993元，本报告期基金份额净值增长率为-0.07%；同期业绩比较基准收益率为-1.10%。

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 2020 年下半年，货币政策大概率保持合理充裕，但是疫情后经济复苏节奏或有所减缓。预计市场的整体利率水平保持震荡，短端收益率曲线短期继续上行的调整压力依旧存在。

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

本基金本报告期内基金持有人数或基金资产净值无预警说明。

§ 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	4,974,149.19
结算备付金		2,456,184.69
存出保证金		618.11
交易性金融资产	6.4.7.2	424,844,472.40
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		424,844,472.40
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	36,000,174.00
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	6,824,556.25
应收股利		-
应收申购款		160.00
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		475,100,314.64
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		156,968.49
应付管理人报酬		114,501.91
应付托管费		19,083.64
应付销售服务费		856.54
应付交易费用	6.4.7.7	6,388.12
应交税费		44,913.25

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	30,607.29
负债合计		373,319.24
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	474,745,253.48
未分配利润	6.4.7.10	-18,258.08
所有者权益合计		474,726,995.40
负债和所有者权益总计		475,100,314.64

注：1. 报告截止日 2020 年 6 月 30 日，北信瑞丰鼎盛中短债 A 类基金份额单位净值 1.0000 元，基金份额总额 473,288,300.94 份；北信瑞丰鼎盛中短债 C 类基金份额单位净值 0.9993 元，基金份额总额 1,456,952.54 份。北信瑞丰鼎盛中短债份额总额合计为 474,745,253.48 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020年4月29日(基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		156,662.40
1.利息收入		1,868,416.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	126,122.31
债券利息收入		1,582,614.81
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		159,679.02
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-722,940.62
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-722,940.62
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-995,112.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	6,298.91

减：二、费用		281,455.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	177,127.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	29,521.19
3. 销售服务费		2,845.79
4. 交易费用	6.4.7.19	5,712.99
5. 利息支出		24,541.36
其中：卖出回购金融资产支出		24,541.36
6. 税金及附加		4,101.62
7. 其他费用	6.4.7.20	37,605.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-124,792.90
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-124,792.90

注：本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 29 日，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 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）	226,228,755.55	-	226,228,755.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 （本期利润）	-	-124,792.90	-124,792.90
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）	248,516,497.93	106,534.82	248,623,032.75
其中：1.基金申购款	339,890,333.70	135,941.49	340,026,275.19
2. 基金赎回款	-91,373,835.77	-29,406.67	-91,403,242.44
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）	474,745,253.48	-18,258.08	474,726,995.40

注：本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 29 日，无上年度可比期间。

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

北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]308 号文《关于准予北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金注册的批复》核准,由北信瑞丰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 226,220,589.02 元,业经中喜会计师事务所(特殊普通合伙)中喜验字[2020]第[00031]号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 226,228,755.55 份基金份额,其中认购资金利息折合 8,166.53 份基金份额。本基金的基金管理人为北信瑞丰基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金基金合同》和《北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金自募集期起根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用,称为 A 类基金份额;不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括债券(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金的投资组合比例为:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%,其中投资于中短债主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金所指的中短债主题证券是指剩余期限不超过三年的债券资产,包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分等金融工具。对于可变利率

债或浮动利率债，剩余期限按计算日至下一利率调整日的实际剩余天数计算。本基金的业绩比较基准为中债总财富(1-3 年)指数收益率*85%+一年期定期存款利率(税后)*15%。

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<年度报告和中期报告>》、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》、《北信瑞丰鼎盛中短债债券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 2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 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。本基金本报告期为 2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 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、资产支持证券投资和衍生工具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当期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或资产支持证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的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。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项, 根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分, 将本金部分冲减资产支持证券投资成本, 并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益; 于处置时, 其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益, 其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算, 实际利率法与直线法差异较小的则

按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若基金份额类别期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则基金份额类别期末可供分配利润的金额为各自基金份额类别所对应的期末未分配利润中的已实现部分；若基金份额类别期末未分配利润的未实现部分为负数，则基金份额类别期末可供分配利润的金额为各自基金份额类别所对应的期末未分配利润，即各自基金份额类别所对应的已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》

提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	4,974,149.19
定期存款	—
其他存款	—
合计：	4,974,149.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		—	—	—
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	111,332,902.12	110,877,972.40	-454,929.72
	银行间市场	314,506,682.31	313,966,500.00	-540,182.31
	合计	425,839,584.43	424,844,472.40	-995,112.03

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	425,839,584.43	424,844,472.40	-995,112.03

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末本基金无衍生金融资产或负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	36,000,174.00	-
合计	36,000,174.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,636.76
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,105.30
应收债券利息	6,816,090.80
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	3,723.09
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	0.30
合计	6,824,556.25

6.4.7.6 其他资产

本期末本基金无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	6,388.12
合计	6,388.12

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
预提费用	30,607.29
应付赎回费	-
合计	30,607.29

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

北信瑞丰鼎盛中短债 A		
项目	本期 2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	219,728,043.00	219,728,043.00
本期申购	339,884,472.10	339,884,472.10
本期赎回(以“-”号填列)	-86,324,214.16	-86,324,214.16
本期末	473,288,300.94	473,288,300.94

金额单位：人民币元

北信瑞丰鼎盛中短债 C		
项目	本期 2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	6,500,712.55	6,500,712.55
本期申购	5,861.60	5,861.60
本期赎回(以“-”号填列)	-5,049,621.61	-5,049,621.61
本期末	1,456,952.54	1,456,952.54

注：1. 申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2020 年 4 月 7 日至 2020 年 4 月 24 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 226,220,589.02 元，折合为 226,220,589.02 份基金份额。根据《北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 8,166.53

元在本基金成立后，折合为 8,166.53 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金基金合同》、《北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金招募说明书》及《北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于 2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 年 5 月 27 日止期间暂不向投资人开放，基金交易申购业务、赎回业务、转换业务和定期定额投资业务自 2020 年 5 月 28 日起开始办理。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

北信瑞丰鼎盛中短债 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	866,298.41	-988,001.12	-121,702.71
本期基金份额交易产生的变动数	122,226.93	-17,722.20	104,504.73
其中：基金申购款	165,511.54	-29,568.45	135,943.09
基金赎回款	-43,284.61	11,846.25	-31,438.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	988,525.34	-1,005,723.32	-17,197.98

单位：人民币元

北信瑞丰鼎盛中短债 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,020.72	-7,110.91	-3,090.19
本期基金份额交易产生的变动数	-1,986.47	4,016.56	2,030.09
其中：基金申购款	4.01	-5.61	-1.60
基金赎回款	-1,990.48	4,022.17	2,031.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,034.25	-3,094.35	-1,060.10

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	62,920.86
定期存款利息收入	59,995.28
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,205.34
其他	0.83
合计	126,122.31

6.4.7.12 股票投资收益

本期本基金无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月29日(基金合同生效日)至 2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	232,772,842.08
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	230,722,940.62
减：应收利息总额	2,772,842.08
买卖债券差价收入	-722,940.62

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本期本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本期本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本期本基金无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本期本基金无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年4月29日(基金合同生效日) 至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-995,112.03
——股票投资	-
——债券投资	-995,112.03
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-995,112.03

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	15.00
其他	6,283.91
合计	6,298.91

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	112.99
银行间市场交易费用	5,600.00
合计	5,712.99

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
信息披露费	20,405.07
审计费用	10,202.22
银行费用	6,997.74
合计	37,605.03

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
北信瑞丰基金管理有限公司（“北信瑞丰基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易，无上年度可比期间。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	177,127.32
其中：支付销售机构的客户维护费	11,636.03

注：1. 支付基金管理人北信瑞丰基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.30%/当年天数。

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产里列支的费用项目。

3. 本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 29 日，无上年度可比期间。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	29,521.19

注：1. 支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计

至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X0.05%/当年天数。

2. 本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 29 日，无上年度可比期间。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	北信瑞丰鼎盛中短债 A	北信瑞丰鼎盛中短债 C	合计
北信瑞丰基金	-	1,961.04	1,961.04
中国银行	-	699.38	699.38
合计	-	2,660.42	2,660.42

注：1. 支付基金销售机构的销售服务费按前一日北信瑞丰鼎盛中短债 C 类基金份额的基金资产净值 0.35%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给北信瑞丰基金，再由北信瑞丰基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.35%。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.35%/当年天数。

2. 本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 29 日，无上年度可比期间。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期本基金未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本期本基金未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本期本基金未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期本基金基金管理人未运用固有资金投资本基金，无上年度可比期间。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末其他关联方未持有本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	4,974,149.19	62,920.86

注：1. 本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按约定利率计息。

2. 本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 29 日，无上年度可比期间。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期本基金未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况，无上年度可比期间。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本期本基金无须作说明的其他关联交易事项，无上年度可比期间。

6.4.11 利润分配情况

本期本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本期末本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末本基金无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末本基金无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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本期末本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债

债的纯债部分)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%,其中投资于中短债主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金保持不低于基金资产净值的 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金所指的中短债主题证券是指剩余期限不超过三年的债券资产,包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分等金融工具。对于可变利率债或浮动利率债,剩余期限按计算日至下一利率调整日的实际剩余天数计算。本基金不投资于股票,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险的基础上,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,在董事会下设立风险管理委员会,根据公司总体战略负责拟订公司风险战略和风险管理政策,并对其实施情况及效果进行监督和评价,指导公司的风险管理和内控制度建设;对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估;监督公司的财务状况,审计公司的财务报表,评估公司的财务表现,保证公司的财务运作符合法律的要求和通行的会计标准。在业务操作层面,监察稽核部承担其他风险的管理职责,负责在各业务部门一线风险控制的基础上实施风险再控制。

本基金的基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

存放在本基金的托管行中国银行，因此与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	30,117,000.00
合计	30,117,000.00

注：以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、同业存单及央行票据等。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末本基金无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末本基金无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日
AAA	285,933,646.40
AAA 以下	59,355,826.00
未评级	-
合计	345,289,472.40

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、同业存单及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末本基金无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末本基金无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%，本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动

投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,974,149.19	-	-	-	4,974,149.19
结算备付金	2,456,184.69	-	-	-	2,456,184.69
存出保证金	618.11	-	-	-	618.11
交易性金融资产	108,002,626.00	316,841,846.40	-	-	424,844,472.40
买入返售金融资产	36,000,174.00	-	-	-	36,000,174.00

应收利息	-	-	-	6,824,556.25	6,824,556.25
应收申购款	-	-	-	160.00	160.00
资产总计	151,433,751.99	316,841,846.40	-	6,824,716.25	475,100,314.64
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	156,968.49	156,968.49
应付管理人报酬	-	-	-	114,501.91	114,501.91
应付托管费	-	-	-	19,083.64	19,083.64
应付销售服务费	-	-	-	856.54	856.54
应付交易费用	-	-	-	6,388.12	6,388.12
应交税费	-	-	-	44,913.25	44,913.25
其他负债	-	-	-	30,607.29	30,607.29
负债总计	-	-	-	373,319.24	373,319.24
利率敏感度缺口	151,433,751.99	316,841,846.40	-	6,451,397.01	474,726,995.40

注：1. 表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

2. 本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 29 日，截止本报告期末本基金成立未满一年。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2020 年 6 月 30 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	4,248,444.72
	2. 市场利率上升 25 个基点	-4,248,444.72

注：本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 29 日，截止本报告期末本基金成立未满一年。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

低层次决定：

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输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 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二层次的余额为 424,844,472.40 元，无属于第一和第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、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影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 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。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债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很小。

(2) 其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	424,844,472.40	89.42
	其中：债券	424,844,472.40	89.42
	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	36,000,174.00	7.58
	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	7,430,333.88	1.56
8	其他各项资产	6,825,334.36	1.44
9	合计	475,100,314.64	100.00

注：1. 由于四舍五入的原因报告期末基金资产组合各项目公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

2. 本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 29 日，截止本报告期末本基金成立未满一年。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未参与股票投资。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未参与股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未参与股票投资。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,438,000.00	10.41
	其中：政策性金融债	49,438,000.00	10.41
4	企业债券	130,380,472.40	27.46
5	企业短期融资券	30,117,000.00	6.34
6	中期票据	214,909,000.00	45.27
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	424,844,472.40	89.49

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	101900756	19 中电投 MTN010A	300,000	30,447,000.00	6.41
2	101900023	19 河钢集 MTN001	300,000	30,420,000.00	6.41
3	101901168	19 中化工 MTN003	300,000	30,378,000.00	6.40
4	101901075	19 吉利 MTN002	300,000	30,348,000.00	6.39
5	011902389	19 西安高新 SCP012	300,000	30,117,000.00	6.34

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资范围未包括股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	618.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,824,556.25
5	应收申购款	160.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,825,334.36

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
北信瑞丰鼎盛 中短债 A	146	3,241,700.69	469,863,221.84	99.28%	3,425,079.10	0.72%
北信瑞丰鼎盛 中短债 C	78	18,678.88	—	—	1,456,952.54	100.00%
合计	224	2,119,398.45	469,863,221.84	98.97%	4,882,031.64	1.03%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从 业人员持有本基金	北信瑞丰鼎盛中短债 A	35,041.36	0.01%
	北信瑞丰鼎盛中短债 C	18,858.05	1.29%
	合计	53,899.41	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持 有本开放式基金	北信瑞丰鼎盛中短债 A	0~10
	北信瑞丰鼎盛中短债 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开 放式基金	北信瑞丰鼎盛中短债 A	0~10
	北信瑞丰鼎盛中短债 C	—
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	北信瑞丰 鼎盛中短债 A	北信瑞丰 鼎盛中短债 C
基金合同生效日（2020 年 4 月 29 日）基金份额总额	219,728,043.00	6,500,712.55
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	339,884,472.10	5,861.60
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	86,324,214.16	5,049,621.61
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	473,288,300.94	1,456,952.54

注：1. 总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

2. 本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 29 日，截止本报告期末本基金成立未满一年。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有举行基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

基金托管人：本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 10,202.22 元。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，中国证券监督管理委员会（下称“中国证监会”）北京监管局于 2020 年 5 月 4 日对本基金管理人下发的《关于对北信瑞丰基金管理有限公司采取责令改正行政监管措施的决定》（行政监管措施决定书[2020]70 号）。本基金管理人已根据法律法规、行政法规和中国证监会的要求落实整改。

本报告期内，中国证券监督管理委员会（下称“中国证监会”）北京监管局于 2020 年 5 月 20 日对本基金高级管理人下发的《关于对朱彦采取出具警示函行政监管措施的决定》（[2020]85 号）本基金高级管理人已根据法律法规、行政法规和中国证监会的要求落实整改。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	2	-	-	-	-	新增

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本报告期内，本基金新增方正证券 2 个交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
方正证券	111,332,902.12	100.00%	1,166,000,000.00	100.00%	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本报告期内，本基金新增方正证券 2 个交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金基金合同摘要	指定网站	2020 年 4 月 2 日
2	北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证券报、指定网站	2020 年 4 月 2 日
3	北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金基金合同	指定网站	2020 年 4 月 2 日
4	北信瑞丰基金管理有限公司北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金招募说明书	指定网站	2020 年 4 月 2 日
5	北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金基金份额发售公告	指定网站	2020 年 4 月 2 日
6	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、指定网站	2020 年 4 月 22 日
7	北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、指定网站	2020 年 4 月 30 日
8	北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报、指定网站	2020 年 5 月 28 日
9	北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金暂停接受个人投资者申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	中国证券报、指定网站	2020 年 6 月 3 日
10	北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金恢复个人投资者申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	中国证券报、指定网站	2020 年 6 月 5 日
11	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券估值调整的提示性公告	中国证券报、指定网站	2020 年 6 月 23 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或超过 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	20200429-20200528 20200603-20200603	-	70,000,944.44	-	70,000,944.44	14.74%
	2	20200604-20200630	-	139,943,022.79	-	139,943,022.79	29.48%
	3	20200529-20200630	-	199,919,032.39	-	199,919,032.39	42.11%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
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回，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%）而特有的流动性风险。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；

4. 本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 29 日，截止本报告期末本基金成立未满一年。

11.2 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金的文件。
- 2、北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金基金合同。
- 3、北信瑞丰鼎盛中短债债券型证券投资基金托管协议。
- 4、中国证监会批准设立北信瑞丰基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

北京市海淀区西三环北路 100 号光耀东方中心 A 座 6 层、25 层。

12.3 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

2020 年 8 月 29 日