

# 北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资 基金

## 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

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

送出日期：2023 年 3 月 31 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 2023 年 3 月 29 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。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>6</b>
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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19

7.3 净资产（基金净值）变动表 .....	20
7.4 报表附注 .....	21
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>47</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 .....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	54
8.6 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 .....	54
8.7 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 .....	54
8.8 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 .....	54
8.9 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 .....	54
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	54
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	54
8.12 投资组合报告附注 .....	54
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>55</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
9.3 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 .....	55
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>56</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>56</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
11.2 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 .....	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
11.4 基金投资策略的改变 .....	56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
11.8 其他重大事件 .....	58
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>59</b>
12.1 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 .....	59
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>60</b>
13.1 备查文件目录 .....	60

13.2 存放地点 .....	60
13.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	北信瑞丰新成长
基金主代码	001866
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 11 月 11 日
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
报告期末基金份额总额	4,716,250.26 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过相对灵活的资产配置，重点投资于受益于中国经济发展而快速成长的上市公司，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。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×30%+中证综合债券指数收益率×70%
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。

### 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	中信建投证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张恩源	朱志明
	联系电话	010-68619341	4008-888-108
	电子邮箱	service@bxrfund.com	service@csc.com.cn
客户服务电话		4000617297	95587
传真		010-68619300	010-85130975
注册地址		北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
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	北京市东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 10 层
邮政编码		100048	100010
法定代表人		李永东	王常青

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
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、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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-3,649,934.60	63,265,722.11	27,502,472.48
本期利润	-4,314,661.37	15,402,254.01	67,993,040.02
加权平均基金份额本期利润	-0.9084	0.4796	0.4318
本期加权平均净值利润率	-61.90%	28.19%	34.47%
本期基金份额净值增长率	-41.62%	33.00%	42.55%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	852,926.57	6,295,051.89	36,075,713.60
期末可供分配基金份额利润	0.1808	1.0234	0.2717
期末基金资产净值	5,569,176.83	12,446,436.89	201,974,942.69
期末基金份额净值	1.181	2.023	1.521
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	22.66%	110.12%	57.98%

- 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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

## 3.2 基金净值表现

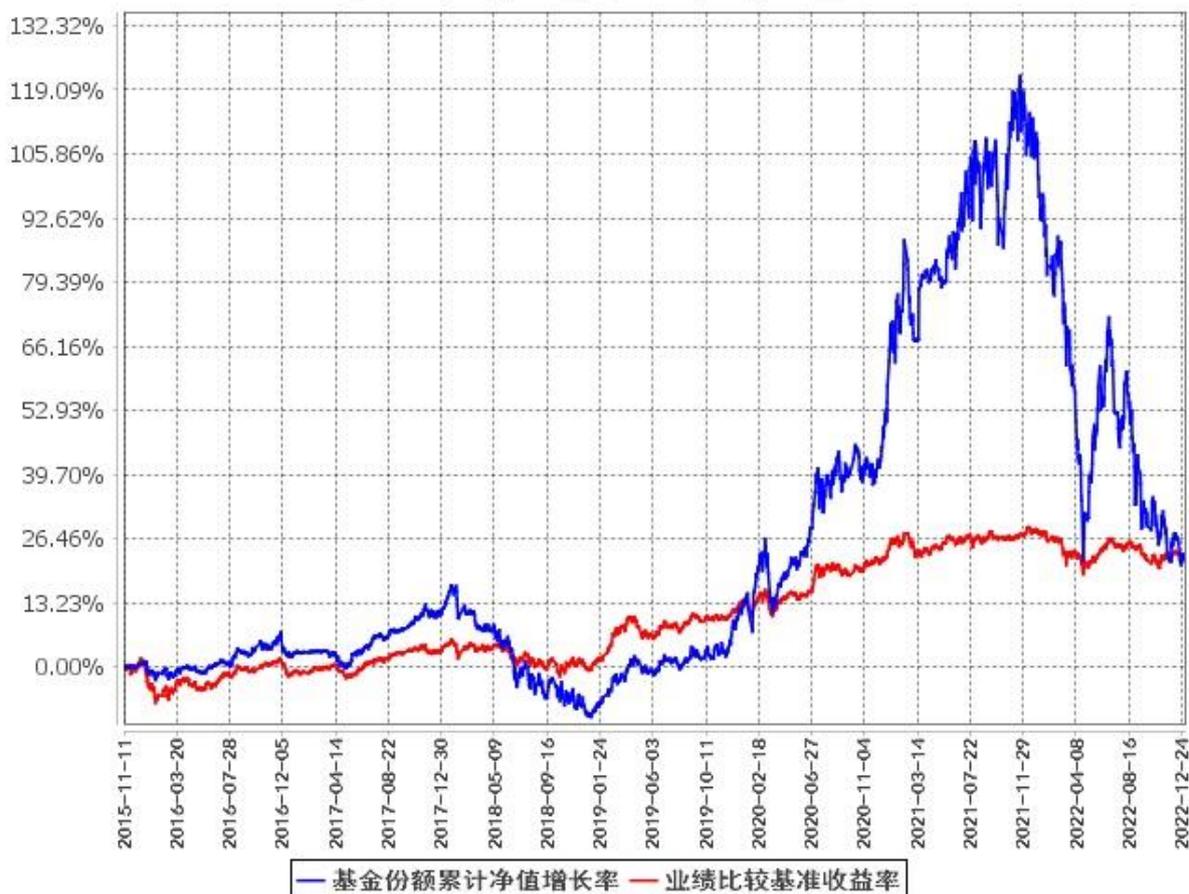
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-4.99%	1.22%	0.64%	0.34%	-5.63%	0.88%
过去六个月	-27.59%	1.58%	-2.83%	0.31%	-24.76%	1.27%
过去一年	-41.62%	1.79%	-4.39%	0.38%	-37.23%	1.41%
过去三年	10.68%	1.59%	9.03%	0.38%	1.65%	1.21%
过去五年	10.61%	1.31%	18.91%	0.38%	-8.30%	0.93%
自基金合同生效起至今	22.66%	1.11%	22.74%	0.38%	-0.08%	0.73%

注：本基金的业绩比较基准为中证 800 指数收益率×30%+中证综合债券指数收益率×70%。中证 800 指数是由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场统一指数，它的样本选自沪深两个证券市场。中证 800 指数成分股覆盖了中证 500 和沪深 300 的所有成分股，综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况，具有一定权威性，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。中证综合债券指数是一个综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。

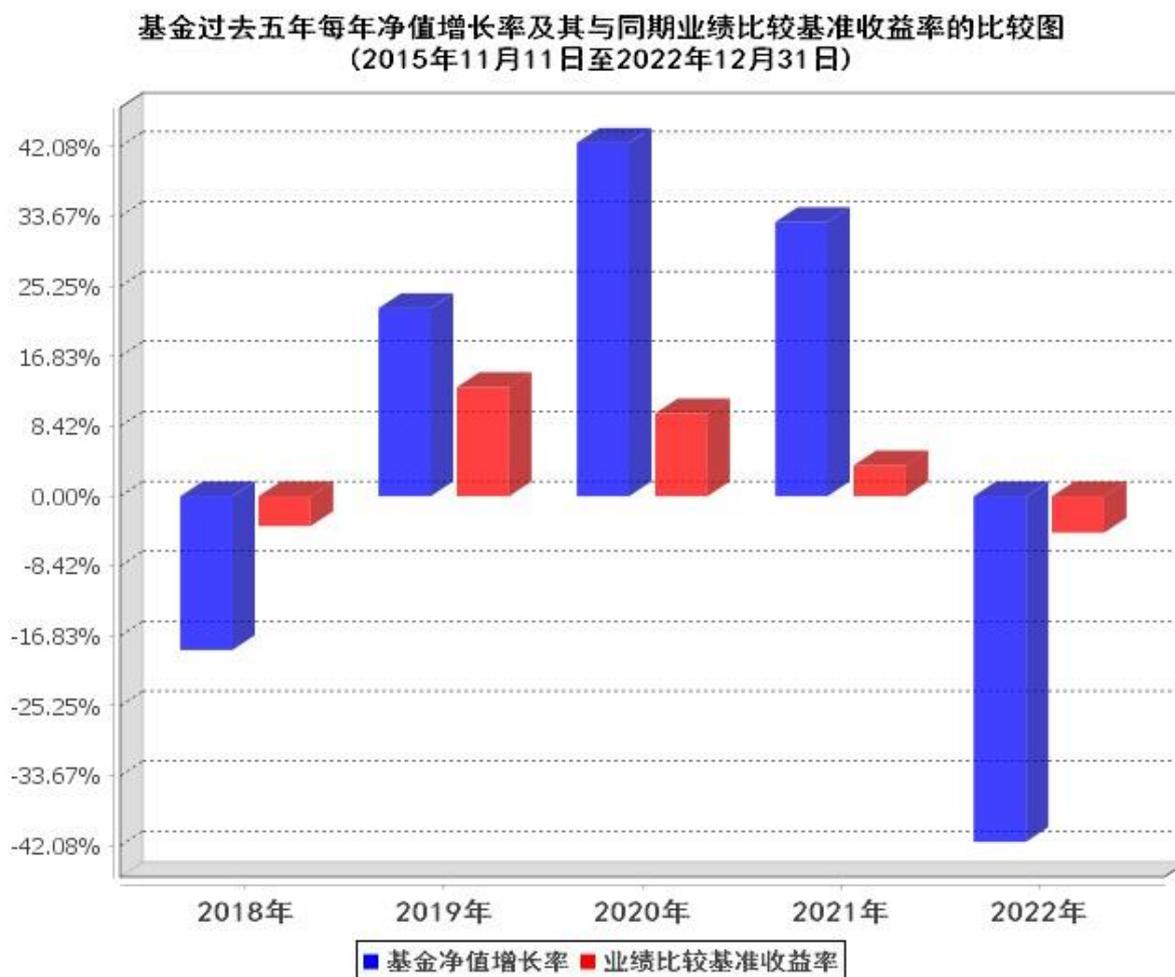
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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  
(2015年11月11日至2022年12月31日)



注：报告期内基金的各项投资比例符合基金合同的有关规定。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同于 2015 年 11 月 11 日起生效，基金成立当年净值增长率以实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未实施利润分配。

## § 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。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員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。

#### 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		
邹杰	本基金 基金经 理	2021 年 5 月 6 日	2022 年 7 月 4 日	6	邹杰先生，上海交通大学工学博士学位，曾任德邦证券股份有限公司助理分析师，兴业证券股份有限公司通信行业分析师，弘毅远方基金管理有限公司基金经理助理。2020 年 6 月入职北信瑞丰基金管理有限公司，先后担任权益投资部基金经理助理、权益投资部基金经理，2022 年 7 月离职。
张文博	本基金 基金经 理	2022 年 7 月 4 日	-	7	张文博先生，北京大学金融学硕士，从事股票研究相关工作 7 年。曾任长盛基金管理有限公司研究员，2016 年 4 月入职北信瑞丰基金管理有限公司任研究员，现任北信瑞丰基金管理有限公司权益投资部基金经理。

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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《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及各项实施准则规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了公平交易制度。公司的公平交易制度所规范的业务范围既包括所有投资组合品种，既涵盖封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合等，也规范所有一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，并且包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的所有业务环节。

本基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严格禁止直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金管理人按照规定严格将投资管理职能和交易执行职能进行隔离，以时间优先、价格优先、综合平衡、比例实施、保证各基金间的利益公平为原则建立和完善集中交易制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律规定，严格执行《北信瑞丰基金管理有限公司公平交易管理制度》、《北信瑞丰基金管理有限公司异常交易管理办法》等公平交易制度要求，通过系统和人工等方式在研究、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。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、综合平衡、比例实施、保证各基金间的利益公平”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，本基金管理人对公平交易制度的遵守、相关业务流程的执行情况以及不同投资组合的同向交易价差和反向交易价差进行检查和分析，对发现的问题及时报告。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。

### 4.3.3 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

2022 年，市场经历了剧烈的波动。具体到细分行业和时间节奏上，年初由于能源危机继续演

绎以及俄乌冲突对通胀带来的影响，能源类股票表现强劲。到了 4 月份，新能源板块出现大幅的回调。到了 5 月份，以新能源汽车行业为首的一些子行业出现了很大幅度的反弹。6 月份，美国通胀数据超预期后市场预期美联储会展开更加严厉的货币政策，因此大宗商品市场出现了一波十分流畅的下跌。同时成长类个股领跑，但此时成长板块内的轮动是很快的。10 月份，成长股相对的占优，信创等长期下跌且估值跌到历史低位有反转预期的品种出现了强势反弹。同时，以白酒为代表的消费行业出现了更显著的回调。到了 11 月份，消费类行业出现了强势的反弹。展望 2023 年，我们认为经济复苏的一年，因此看好国内经济复苏带来的证券市场的投资机会。

#### 4.4.2 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 1.181 元，本报告期基金份额净值增长率为-41.62%；同期业绩比较基准收益率为-4.39%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在经历了 2022 年资本市场下行的一年之后，预计一些以国内需求为主导的行业其景气度会出现反弹。2023 年是国内经济复苏的一年，不同行业的复苏力度也有所不同，预计食品、酒店、航空、信息技术、高端装备等子行业会出现较强的复苏弹性。同时，叠加美联储货币政策可能的转向，上游原材料可能会有一定的表现。对整体市场的判断上，相对看好 2023 年证券市场的投资机会，一些估值处于底部的板块已经调整的比较充分，经济也在全面的复苏之中。总结来说，对市场保持谨慎乐观的态度。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内部控制机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人开展了廉洁从业、网络和数据信息安全、投资者个人信息保护等主题的自查工作；对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了包括研究报告管理、债券库管理、投资者适当性管理、公司产品估值调整等主题的定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性；制定或修订了《北信瑞丰基金管理有限公司内控制度分级管理办法》《北信瑞丰基金管理有限公司卖方机构服务评价办法》《北信瑞丰基金管理有限公司工作人员证券投资管理暂行办法》《北信瑞丰基金管理有限公司投资风险控制指标暂行规定》《北信瑞丰基金管理有限公司声誉风险管理暂行办法》等内部控制制度，进一步完善了内部控制体系；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；结合法律法规

和监管要求，积极组织包括《从监管案例看基金流动性管理的重要性》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》等 2022 年度新规解读在内的合规培训，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展的合规审核工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况；完成各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，顺应监管形势，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与基金持有人的利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国基金业协会提供的相关估值指引等相关规定以及基金合同的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同完成，本基金管理人完成账务处理、基金份额净值的计算，与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术，建立了投资决策委员会，下设估值小组。估值小组成员由具备丰富的证券研究、合规风控、估值经验的公司相关领导、基金经理、研究人员、交易人员、监察稽核人员及基金运营人员组成。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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 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

本基金在 2021 年 4 月 2 日至 2022 年 12 月 31 日期间资产净值低于五千万元，已经连续六十个工作日以上。本基金管理人已按规定向中国证监会进行了报告并提交了解决方案。

## § 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

在本报告期内，本基金托管人在托管基金过程中，严格遵守了基金合同、托管协议(如有)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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

在本报告期内，托管人按照基金合同，托管协议(如有)的有关规定，对本基金的资产净值计算、基金费用进行了认真的复核；托管人按照基金合同或托管协议(如有)中约定的托管人应承担的投资监督职责，根据基金管理人向托管人提供的基金投资相关文件及基金托管账户显示的基金投资信息，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有明显损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现的相关内容，所复核内容真实、准确和完整。

免责声明：

1、基金托管人仅复核本报告中的基金财务数据，对于本报告中基金财务数据以外的其他数据和信息，基金托管人不承担复核职责。

2、基金管理人，基金管理人委托的证券期货经纪商等服务机构应当确保向基金托管人提供的基金财务数据和信息的及时性、真实性、准确性和完整性，对因基金管理人或者服务机构原因导致基金托管人复核后的基金财务数据不准确及基金财产损失，基金托管人不承担任何责任。

3、基金托管人不复核本基金财产分配(包括利润分配、收益分配及资产分配等)情况，除非基金合同或托管协议(如有)明确约定由基金托管人对财产分配(包括利润分配、收益分配及资产分配等)情况进行复核。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 28914 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“北信瑞丰新成长基金”)的财务报表，包括 2022 年 12 月 31

	<p>日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了北信瑞丰新成长基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于北信瑞丰新成长基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	<p>我们提醒财务报表使用者关注，如财务报表附注“7.4.2 会计报表的编制基础”所述，北信瑞丰新成长基金的基金管理人北信瑞丰基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)拟在资产负债表日后清算北信瑞丰新成长基金的剩余资产。因此，上述北信瑞丰新成长基金的财务报表以清算基础编制。该事项不影响已发表的审计意见。</p>
其他事项	无
其他信息	<p>北信瑞丰新成长基金的基金管理人北信瑞丰基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括北信瑞丰新成长基金 2022 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已经执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估北信瑞丰新成长基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算北信瑞丰新成长基金、终止运营或别无其他现实的选择。参见财务报表附注 7.4.2 有关以清算基础编制财务报表的说明。</p> <p>基金管理人治理层负责监督北信瑞丰新成长基金的财务报告过程。</p>

注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对北信瑞丰新成长基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	周祎 郭蕙心
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2023 年 3 月 30 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	444,912.64	1,054,479.78
结算备付金		65,738.17	136,032.09
存出保证金		15,293.28	52,286.20
交易性金融资产	7.4.7.2	5,113,272.75	11,762,591.02
其中：股票投资		5,113,272.75	11,762,591.02
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	11,623.32
应收股利		-	-
应收申购款		3,787.95	16,766.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	205.74
资产总计		5,643,004.79	13,033,984.86
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	348,942.10
应付赎回款		951.42	85,017.07
应付管理人报酬		3,823.67	8,680.20
应付托管费		955.91	2,170.05
应付销售服务费		955.91	2,170.05
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	67,141.05	140,568.50
负债合计		73,827.96	587,547.97
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	4,716,250.26	6,151,385.00
未分配利润	7.4.7.8	852,926.57	6,295,051.89
净资产合计		5,569,176.83	12,446,436.89

负债和净资产总计		5,643,004.79	13,033,984.86
----------	--	--------------	---------------

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.181 元，基金份额总额 4,716,250.26 份。

## 7.2 利润表

会计主体：北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-4,152,937.06	17,183,888.43
1. 利息收入		4,983.02	236,996.16
其中：存款利息收入	7.4.7.9	4,983.02	104,297.81
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	132,698.35
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,501,723.34	64,622,835.01
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-3,553,477.03	64,606,246.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	51,753.69	16,588.96
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-664,726.77	-47,863,468.10
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	8,530.03	187,525.36
<b>减：二、营业总支出</b>		161,724.31	1,781,634.42
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	56,149.43	455,125.06
2. 托管费	7.4.10.2.2	14,037.36	113,781.24
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	14,037.36	113,781.24
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-

7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.16	77,500.16	1,098,946.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,314,661.37	15,402,254.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,314,661.37	15,402,254.01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4,314,661.37	15,402,254.01

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	6,151,385.00	6,295,051.89	12,446,436.89
二、本期期初净资产（基金净值）	6,151,385.00	6,295,051.89	12,446,436.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,435,134.74	-5,442,125.32	-6,877,260.06
（一）、综合收益总额	-	-4,314,661.37	-4,314,661.37
（二）、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）	-1,435,134.74	-1,127,463.95	-2,562,598.69
其中：1. 基金申购款	3,118,337.12	1,415,723.91	4,534,061.03
2. 基金赎回款	-4,553,471.86	-2,543,187.86	-7,096,659.72
（三）、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）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	4,716,250.26	852,926.57	5,569,176.83
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	132,797,809.83	69,177,132.86	201,974,942.69
二、本期期初净资产（基金净值）	132,797,809.83	69,177,132.86	201,974,942.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-126,646,424.83	-62,882,080.97	-189,528,505.80
（一）、综合收益总额	-	15,402,254.01	15,402,254.01
（二）、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）	-126,646,424.83	-78,284,334.98	-204,930,759.81

其中：1. 基金申购款	42,099,202.01	32,391,084.48	74,490,286.49
2. 基金赎回款	-168,745,626.84	-110,675,419.46	-279,421,046.30
(三)、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）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	6,151,385.00	6,295,051.89	12,446,436.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

赵远峰	李惠军	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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金(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”)证监许可字[2015]第 2011 号《关于准予北信瑞丰新成长灵活配置混合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《北信瑞丰新成长灵活配置混合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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 450,174,593.33 元,业经中喜会计师事务所(特殊普通合伙)中喜验字(2015)第 0503 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 11 月 11 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 450,186,725.40 份基金份额,其中认购资金利息折合 12,132.07 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,基金托管人为中信建投证券股份有限公司(以下简称“中信建投证券”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《北信瑞丰新成长灵活配置混合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,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证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。本基金持有的股票投资占基金资产的比例为 0%-95%,80%以上的非现金基金资产投资于成长型上市公司证券;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为中证 800 指数收益率×30%+中证综合债券指数收益率×70%。

本财务报表由本基金的基金管理人北信瑞丰基金管理有限公司于 2023 年 3 月 30 日批准报出。

#### 7.4.2 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

根据《北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金合同》、本基金份额持有人大会于 2023 年 3 月 7 日表决通过的《关于终止北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》以及基金管理人北信瑞丰基金管理有限公司于 2023 年 3 月 8 日发布的《关于北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金于 2023 年 3 月 9 日进入财产清算期，详情参见附注 7.4.8.2 资产负债表日后事项，因此本基金财务报表以清算基础编制。于 2022 年 12 月 31 日，所有资产以可收回金额和账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 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。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (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。以公允价值计量且其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。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

于本报告期内及上年度可比期间，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；对于应收款项和以摊余成本计量的金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第

二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

于本报告期末，各项金融资产以可收回金额和账面价值孰低计量。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

#### 7.4.4.5 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、资产支持证券投资和衍生工具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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类

别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除相关交易费用及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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证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。

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。

#### 7.4.4.10 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确认。

以摊余成本计量的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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即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净资产转出。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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股票投资、债券投资和资产支持证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) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中债金融估值中心有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会

计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》（财会[2022]14 号），中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 1,054,479.78 元、136,032.09 元、52,286.20 元、205.74 元、11,623.32 元和 16,766.71 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 1,054,592.35 元、136,099.41 元、52,312.05 元、0.00 元、11,623.32 元和 16,766.71 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 11,762,591.02 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 11,762,591.02 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 348,942.10 元、85,017.07 元、8,680.20 元、2,170.05 元、2,170.05 元、91,568.50 元和 49,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 348,942.10 元、85,017.07 元、8,680.20 元、2,170.05 元、2,170.05 元、91,568.50 元和 49,000.00 元。

(i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在

“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最

后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	444,912.64	1,054,479.78
等于：本金	444,868.60	1,054,479.78
加：应计利息	44.04	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	444,912.64	1,054,479.78

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	5,338,885.45	-	5,113,272.75	-225,612.70

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,338,885.45	-	5,113,272.75	-225,612.70
项目	上年度末 2021年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	11,323,476.95	-	11,762,591.02	439,114.07
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	11,323,476.95	-	11,762,591.02	439,114.07

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末及上年度末，本基金无衍生金融资产或负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末及上年度末，本基金无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末及上年度末，本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	205.74
其他应收款	-	-
合计	-	205.74

## 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付交易费用	27,141.05	91,568.50
其中：交易所市场	27,141.05	91,568.50
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	40,000.00	49,000.00
应付赎回费	-	-
其他	-	-
合计	67,141.05	140,568.50

## 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,151,385.00	6,151,385.00
本期申购	3,118,337.12	3,118,337.12
本期赎回(以“-”号填列)	-4,553,471.86	-4,553,471.86
本期末	4,716,250.26	4,716,250.26

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	7,495,414.52	-1,200,362.63	6,295,051.89
本期利润	-3,649,934.60	-664,726.77	-4,314,661.37
本期基金份额交易产生的变动数	-1,702,124.95	574,661.00	-1,127,463.95
其中：基金申购款	2,497,718.64	-1,081,994.73	1,415,723.91
基金赎回款	-4,199,843.59	1,656,655.73	-2,543,187.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,143,354.97	-1,290,428.40	852,926.57

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

活期存款利息收入	3,675.51	84,934.63
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	909.39	16,542.75
其他	398.12	2,820.43
合计	4,983.02	104,297.81

#### 7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	69,753,807.38	404,680,296.30
减：卖出股票成本总额	73,104,044.90	340,074,050.25
减：交易费用	203,239.51	-
买卖股票差价收入	-3,553,477.03	64,606,246.05

#### 7.4.7.11 债券投资收益

本期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益。

#### 7.4.7.12 衍生工具收益

本期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

#### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	51,753.69	16,588.96
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	51,753.69	16,588.96

#### 7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-664,726.77	-47,863,468.10
——股票投资	-664,726.77	-47,863,468.10
——债券投资	-	-

——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
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 的预估增值税	-	-
合计	-664,726.77	-47,863,468.10

#### 7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
基金赎回费收入	8,530.03	187,483.84
基金转换费收入	-	41.52
合计	8,530.03	187,525.36

#### 7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
交易费用	-	1,012,746.88
账户维护费	34,336.50	45,000.00
银行费用	300.00	-
其他	2,863.50	1,200.00
存托服务费	0.16	-
合计	77,500.16	1,098,946.88

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 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。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金合同》、本基金份额持有人大会于2023年3月7日表决通过的《关于终止北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》以及基金管理人北信瑞丰基金管理有限公司于2023年3月8日发布的《关于北信瑞丰新成

长灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金于 2023 年 3 月 9 日进入财产清算程序。

#### 7.4.9 关联方关系

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
中信建投证券股份有限公司(“中信建投证券”)	基金托管人、基金销售机构
北京国际信托有限公司	基金管理人的股东
莱州瑞海投资有限公司	基金管理人的股东
上海北信瑞丰资产管理有限公司(“上海北信瑞丰资管”)	基金管理人的子公司

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中信建投证券	110,934,243.62	81.05%	394,970,021.55	61.75%

##### 7.4.10.1.2 债券交易

本期及上年度可比期间，本基金无通过关联方交易单元进行的债券交易。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
中信建投证券	-	-	1,468,500,000.00	100.00%

##### 7.4.10.1.4 权证交易

本期及上年度可比期间，本基金无通过关联方交易单元进行的权证交易。

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券	103,316.67	84.49%	13,428.33	49.48%
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券	367,832.14	67.27%	91,568.50	100.00%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

## 7.4.10.2 关联方报酬

## 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	56,149.43	455,125.06
其中：支付销售机构的客户维护费	23,977.50	57,461.01

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 0.80% 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 × 0.80% / 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。

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	14,037.36	113,781.24

注：支付基金托管人中信建投证券的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 X 0.20% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
	北信瑞丰新成长	合计
北信瑞丰基金	-	-
中信建投证券	265.23	265.23
合计	265.23	265.23
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
	北信瑞丰新成长	合计
北信瑞丰基金	80,000.90	80,000.90
中信建投证券	738.86	738.86
合计	80,739.76	80,739.76

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.20% 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。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本期及上年度可比期间，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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本期及上年度可比期间，本基金基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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

本期末及上年度末，其他关联方未持有本基金。

#### 7.4.10.5 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信建投证券	444,912.64	3,675.51	1,054,479.78	84,934.63

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中信建投证券保管，按约定利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期及上年度可比期间，本基金未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本期及上年度可比期间，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本期本基金未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 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。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 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。

###### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投

资等。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前提下，通过相对灵活的资产配置，重点投资于受益于中国经济发展而快速成长的上市公司，谋求基金资产的长期、稳定增值。

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。

#### 7.4.13.2 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中信建投证券开立于招商银行股份有限公司的托管账户，因而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。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2021 年 12 月 31 日：同)。

### 7.4.13.3 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 2022 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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(净资产)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。

#### 7.4.13.3.1 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。

本基金投资于一家公司发行的证券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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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 7.4.12。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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	444,912.64	-	-	-	444,912.64
结算备付金	65,738.17	-	-	-	65,738.17
存出保证金	15,293.28	-	-	-	15,293.28
交易性金融资产	-	-	-	5,113,272.75	5,113,272.75
应收申购款	-	-	-	3,787.95	3,787.95
资产总计	525,944.09	-	-	5,117,060.70	5,643,004.79
负债					
应付赎回款	-	-	-	951.42	951.42

应付管理人报酬	-	-	-	3,823.67	3,823.67
应付托管费	-	-	-	955.91	955.91
应付销售服务费	-	-	-	955.91	955.91
其他负债	-	-	-	67,141.05	67,141.05
负债总计	-	-	-	73,827.96	73,827.96
利率敏感度缺口	525,944.09	-	-	5,043,232.74	5,569,176.83
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,054,479.78	-	-	-	1,054,479.78
结算备付金	136,032.09	-	-	-	136,032.09
存出保证金	52,286.20	-	-	-	52,286.20
交易性金融资产	-	-	-	11,762,591.02	11,762,591.02
应收清算款	-	-	-	11,623.32	11,623.32
其他资产	-	-	-	205.74	205.74
应收申购款	-	-	-	16,766.71	16,766.71
资产总计	1,242,798.07	-	-	11,791,186.79	13,033,984.86
负债					
应付清算款	-	-	-	348,942.10	348,942.10
应付赎回款	-	-	-	85,017.07	85,017.07
应付管理人报酬	-	-	-	8,680.20	8,680.20
应付托管费	-	-	-	2,170.05	2,170.05
应付销售服务费	-	-	-	2,170.05	2,170.05
其他负债	-	-	-	140,568.50	140,568.50
负债总计	-	-	-	587,547.97	587,547.97
利率敏感度缺口	1,242,798.07	-	-	11,203,638.82	12,446,436.89

注：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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2021 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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

的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资占基金资产的 0%-95%，其中 80%以上的非现金基金资产投资于成长型上市公司证券；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；资产支持证券投资比例不得超过基金资产净值的 20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	5,113,272.75	91.81	11,762,591.02	94.51
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,113,272.75	91.81	11,762,591.02	94.51

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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(2022 年 12 月 31 日)	上年度末(2021 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准 (附注 7.4.1)上 升 5%	238,813.89	500,844.62
2. 业绩比较基准	-238,813.89	-500,844.62	

	(附注 7.4.1) 下降 5%		
--	------------------	--	--

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	5,113,272.75	11,762,591.02
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	5,113,272.75	11,762,591.02

###### 7.4.14.2.2 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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

##### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	5,113,272.75	90.61
	其中：股票	5,113,272.75	90.61
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	510,650.81	9.05
8	其他各项资产	19,081.23	0.34
9	合计	5,643,004.79	100.00

注：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。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	93,130.00	1.67
B	采矿业	546,433.00	9.81
C	制造业	2,956,253.75	53.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	106,540.00	1.91
E	建筑业	92,760.00	1.67
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	88,494.00	1.59
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	466,029.00	8.37
J	金融业	297,296.00	5.34
K	房地产业	271,723.00	4.88
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	89,544.00	1.61
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	105,070.00	1.89
S	综合	-	-
	合计	5,113,272.75	91.81

注：以上行业分类以 2022 年 12 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

### 8.2.2 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投资组合。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

金额单位：人民币元

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	601318	中国平安	2,300	108,100.00	1.94
2	600011	华能国际	14,000	106,540.00	1.91
3	688012	中微公司	1,075	105,360.75	1.89
4	600104	上汽集团	7,300	105,193.00	1.89
5	300413	芒果超媒	3,500	105,070.00	1.89
6	002385	大北农	11,700	104,130.00	1.87
7	002821	凯莱英	700	103,600.00	1.86
8	603986	兆易创新	1,000	102,470.00	1.84
9	300451	创业慧康	12,600	99,666.00	1.79
10	603290	斯达半导	300	98,790.00	1.77
11	000960	锡业股份	7,000	98,700.00	1.77
12	600489	中金黄金	12,000	98,280.00	1.76
13	300725	药石科技	1,200	96,600.00	1.73
14	601336	新华保险	3,200	96,256.00	1.73
15	000938	紫光股份	4,900	95,599.00	1.72
16	603558	健盛集团	11,500	94,760.00	1.70
17	603180	金牌厨柜	3,300	94,611.00	1.70
18	300308	中际旭创	3,500	94,605.00	1.70
19	000603	盛达资源	7,500	94,200.00	1.69
20	600177	雅戈尔	14,800	93,684.00	1.68
21	002405	四维图新	8,500	93,670.00	1.68
22	002458	益生股份	6,700	93,130.00	1.67

23	300638	广和通	5,200	93,080.00	1.67
24	000776	广发证券	6,000	92,940.00	1.67
25	601857	中国石油	18,700	92,939.00	1.67
26	300271	华宇软件	13,600	92,888.00	1.67
27	601186	中国铁建	12,000	92,760.00	1.67
28	002241	歌尔股份	5,500	92,565.00	1.66
29	603501	韦尔股份	1,200	92,508.00	1.66
30	300447	全信股份	6,000	92,400.00	1.66
31	600048	保利发展	6,100	92,293.00	1.66
32	600383	金地集团	9,000	92,070.00	1.65
33	000876	新希望	7,100	91,661.00	1.65
34	300782	卓胜微	800	91,440.00	1.64
35	600703	三安光电	5,300	90,948.00	1.63
36	600123	兰花科创	6,800	90,712.00	1.63
37	600585	海螺水泥	3,300	90,354.00	1.62
38	300496	中科创达	900	90,270.00	1.62
39	002128	电投能源	7,300	90,082.00	1.62
40	603588	高能环境	9,100	89,544.00	1.61
41	002602	世纪华通	23,500	89,535.00	1.61
42	600745	闻泰科技	1,700	89,386.00	1.61
43	002353	杰瑞股份	3,200	89,312.00	1.60
44	601919	中远海控	8,600	88,494.00	1.59
45	000002	万科A	4,800	87,360.00	1.57
46	000059	华锦股份	12,800	87,040.00	1.56
47	002466	天齐锂业	1,100	86,889.00	1.56
48	000725	京东方A	25,100	84,838.00	1.52
49	300841	康华生物	1,000	84,620.00	1.52
50	300450	先导智能	2,100	84,525.00	1.52
51	600338	西藏珠峰	3,500	80,220.00	1.44
52	000949	新乡化纤	16,500	54,780.00	0.98
53	600010	包钢股份	28,200	54,144.00	0.97
54	000877	天山股份	6,300	53,676.00	0.96
55	002841	视源股份	900	53,136.00	0.95
56	603363	傲农生物	4,100	52,849.00	0.95
57	000651	格力电器	1,000	32,320.00	0.58
58	600612	老凤祥	600	25,680.00	0.46

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002466	天齐锂业	1,343,628.00	10.80

2	600237	铜峰电子	995,676.00	8.00
3	300390	天华超净	980,578.00	7.88
4	000792	盐湖股份	972,056.00	7.81
5	002192	融捷股份	919,047.00	7.38
6	002756	永兴材料	917,894.00	7.37
7	002475	立讯精密	894,308.30	7.19
8	300443	金雷股份	879,984.00	7.07
9	600338	西藏珠峰	838,507.00	6.74
10	603218	日月股份	770,663.00	6.19
11	002460	赣锋锂业	764,103.80	6.14
12	603985	恒润股份	725,596.00	5.83
13	002531	天顺风能	708,713.00	5.69
14	000983	山西焦煤	677,067.00	5.44
15	600438	通威股份	673,195.00	5.41
16	300451	创业慧康	658,369.00	5.29
17	300850	新强联	646,633.00	5.20
18	002487	大金重工	612,527.00	4.92
19	000155	川能动力	602,274.00	4.84
20	000408	藏格矿业	597,991.00	4.80
21	600348	华阳股份	586,634.00	4.71
22	603986	兆易创新	584,393.00	4.70
23	603507	振江股份	580,280.00	4.66
24	002176	江特电机	525,033.00	4.22
25	000762	西藏矿业	520,684.00	4.18
26	600740	山西焦化	519,270.00	4.17
27	002555	三七互娱	516,262.99	4.15
28	300750	宁德时代	497,742.00	4.00
29	300674	宇信科技	477,620.00	3.84
30	600256	广汇能源	476,592.00	3.83
31	688390	固德威	459,179.92	3.69
32	002738	中矿资源	456,266.00	3.67
33	603613	国联股份	446,514.00	3.59
34	002405	四维图新	441,063.00	3.54
35	601778	晶科科技	439,500.00	3.53
36	601995	中金公司	428,874.00	3.45
37	000858	五粮液	425,298.00	3.42
38	603636	南威软件	424,167.00	3.41
39	600873	梅花生物	411,894.00	3.31
40	601225	陕西煤业	390,805.00	3.14
41	600219	南山铝业	388,728.00	3.12
42	600188	兖矿能源	386,896.00	3.11
43	000807	云铝股份	371,100.00	2.98
44	600499	科达制造	354,507.00	2.85

45	002777	久远银海	351,848.00	2.83
46	002497	雅化集团	348,840.00	2.80
47	002415	海康威视	345,504.00	2.78
48	688126	沪硅产业	345,122.05	2.77
49	002240	盛新锂能	342,950.00	2.76
50	600546	山煤国际	335,599.00	2.70
51	603225	新凤鸣	330,708.00	2.66
52	600123	兰花科创	330,278.00	2.65
53	300687	赛意信息	323,144.00	2.60
54	603897	长城科技	321,658.00	2.58
55	002812	恩捷股份	319,704.00	2.57
56	000002	万科A	307,364.00	2.47
57	601615	明阳智能	307,308.00	2.47
58	300413	芒果超媒	305,804.00	2.46
59	600048	保利发展	305,184.00	2.45
60	300274	阳光电源	302,368.00	2.43
61	600745	闻泰科技	297,974.00	2.39
62	300014	亿纬锂能	296,339.00	2.38
63	300996	普联软件	294,704.00	2.37
64	603501	韦尔股份	292,073.10	2.35
65	600089	特变电工	291,389.00	2.34
66	601865	福莱特	283,451.00	2.28
67	688599	天合光能	278,080.00	2.23
68	688680	海优新材	277,725.72	2.23
69	000603	盛达资源	277,570.37	2.23
70	688111	金山办公	269,394.20	2.16
71	000977	浪潮信息	259,811.00	2.09
72	600893	航发动力	259,647.00	2.09
73	600522	中天科技	259,531.00	2.09
74	601088	中国神华	257,751.00	2.07
75	688083	中望软件	251,696.34	2.02
76	000630	铜陵有色	250,460.00	2.01
77	300661	圣邦股份	249,241.00	2.00

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600237	铜峰电子	1,486,508.00	11.94
2	002475	立讯精密	1,349,708.15	10.84
3	002466	天齐锂业	1,201,562.00	9.65
4	002487	大金重工	1,150,840.00	9.25

5	603985	恒润股份	1,143,477.00	9.19
6	000792	盐湖股份	1,103,150.00	8.86
7	300390	天华超净	988,933.00	7.95
8	002192	融捷股份	908,320.00	7.30
9	002756	永兴材料	907,332.00	7.29
10	300451	创业慧康	879,151.00	7.06
11	300443	金雷股份	822,920.00	6.61
12	600338	西藏珠峰	799,012.00	6.42
13	002460	赣锋锂业	752,400.00	6.05
14	601615	明阳智能	751,690.00	6.04
15	002531	天顺风能	679,620.00	5.46
16	603218	日月股份	673,666.00	5.41
17	603636	南威软件	650,614.55	5.23
18	000983	山西焦煤	638,348.00	5.13
19	300687	赛意信息	625,767.00	5.03
20	000408	藏格矿业	612,529.00	4.92
21	600893	航发动力	593,954.00	4.77
22	000155	川能动力	593,037.00	4.76
23	600438	通威股份	590,207.00	4.74
24	300850	新强联	587,686.50	4.72
25	002389	航天彩虹	569,690.00	4.58
26	600348	华阳股份	557,704.00	4.48
27	002777	久远银海	554,483.20	4.45
28	002176	江特电机	526,593.00	4.23
29	603507	振江股份	521,957.00	4.19
30	300408	三环集团	515,180.00	4.14
31	000768	中航西飞	508,507.00	4.09
32	300674	宇信科技	495,028.00	3.98
33	002555	三七互娱	494,628.00	3.97
34	000762	西藏矿业	494,173.00	3.97
35	600740	山西焦化	489,790.00	3.94
36	002738	中矿资源	476,204.00	3.83
37	603613	国联股份	451,936.00	3.63
38	603986	兆易创新	446,558.00	3.59
39	603908	牧高笛	441,377.00	3.55
40	601778	晶科科技	415,755.00	3.34
41	600256	广汇能源	410,287.00	3.30
42	601995	中金公司	408,552.00	3.28
43	600873	梅花生物	401,880.00	3.23
44	300750	宁德时代	397,123.00	3.19
45	688533	上声电子	385,548.47	3.10
46	600219	南山铝业	375,260.00	3.01
47	000858	五粮液	374,572.00	3.01

48	002920	德赛西威	374,444.00	3.01
49	603897	长城科技	365,966.00	2.94
50	600188	兖矿能源	355,993.00	2.86
51	000807	云铝股份	352,950.00	2.84
52	600038	中直股份	348,822.00	2.80
53	002415	海康威视	344,710.00	2.77
54	688083	中望软件	342,868.51	2.75
55	688126	沪硅产业	339,075.53	2.72
56	601225	陕西煤业	336,302.00	2.70
57	603225	新凤鸣	332,303.00	2.67
58	688390	固德威	330,509.48	2.66
59	600499	科达制造	329,314.00	2.65
60	600372	中航电子	325,082.00	2.61
61	600879	航天电子	324,732.00	2.61
62	002497	雅化集团	321,660.00	2.58
63	002240	盛新锂能	319,311.00	2.57
64	002405	四维图新	316,157.00	2.54
65	688002	睿创微纳	312,200.45	2.51
66	002812	恩捷股份	301,331.00	2.42
67	600546	山煤国际	292,491.00	2.35
68	300274	阳光电源	280,632.00	2.25
69	600522	中天科技	278,106.00	2.23
70	688680	海优新材	275,890.00	2.22
71	601865	福莱特	275,750.00	2.22
72	002314	南山控股	273,308.00	2.20
73	688111	金山办公	267,600.00	2.15
74	000977	浪潮信息	255,779.52	2.06
75	603267	鸿远电子	251,045.00	2.02
76	300014	亿纬锂能	250,462.00	2.01
77	002714	牧原股份	250,074.00	2.01
78	000625	长安汽车	249,069.60	2.00

注：上述卖出金额为卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)，不包括相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	67,119,453.40
卖出股票收入(成交)总额	69,753,807.38

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)，不包括相关交易费用。

## 8.5 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。

## 8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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。

### 8.12.2 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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 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	15,293.28

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,787.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,081.23

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
2,481	1,900.95	166.70	0.00%	4,716,083.56	100.00%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	904.09	0.0192%

### 9.3 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年11月11日）基金份额总额	450,186,725.40
本报告期期初基金份额总额	6,151,385.00
本报告期基金总申购份额	3,118,337.12
减：本报告期基金总赎回份额	4,553,471.86
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	4,716,250.26

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，深圳市前海喜乐佳投资有限公司以管理人管理的资管产品的投资顾问与管理人共同对其持有的基金侵权等为由向广东省深圳市中级人民法院提起诉讼，要求投资顾问上海耀之资产管理中心(有限合伙)及管理人共同承担赔偿责任。

报告期内，未发生涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期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40,000.00元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
中信建投证券	2	110,934,243.62	81.05%	103,316.67	84.49%	-
天风证券	1	25,939,017.32	18.95%	18,968.90	15.51%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-

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本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

### 11.8 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	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下部分基金增加国泰君安证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 1 月 14 日
2	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 1 月 21 日
3	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金增加北京新浪仓石基金销售有限公司代销机构的公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 1 月 21 日
4	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下部分基金招募说明书及基金产品资料概要更新的提示性公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 1 月 22 日
5	北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	公司网站	2022 年 1 月 22 日
6	北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	公司网站	2022 年 1 月 22 日
7	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 1 月 24 日
8	北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第四季度报告	公司网站	2022 年 1 月 24 日
9	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金增加北京创金启富基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 3 月 11 日
10	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下部分基金增加中国人寿为代销机构的公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 3 月 21 日
11	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年度报告提示性公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 3 月 31 日
12	北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告	公司网站	2022 年 3 月 31 日
13	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 4 月 22 日
14	北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第一季度报告	公司网站	2022 年 4 月 22 日
15	北信瑞丰基金管理有限公司董事变更情况的公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 4 月 30 日
16	北信瑞丰基金管理有限公司关于终止部分代销机构代理销售旗下基金的公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 5 月 12 日
17	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下基金增	中国证券报、	2022 年 5 月 13 日

	加和讯信息科技有限公司为代销机构的公告	公司网站	
18	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下部分基金增加玄元保险代理有限公司为代销机构的公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 5 月 23 日
19	北信瑞丰基金管理有限公司关于调整基金经理的公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 7 月 5 日
20	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下部分基金招募说明书及基金产品资料概要更新的提示性公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 7 月 6 日
21	北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	公司网站	2022 年 7 月 6 日
22	北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	公司网站	2022 年 7 月 6 日
23	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 7 月 21 日
24	北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第二季度报告	公司网站	2022 年 7 月 21 日
25	北信瑞丰基金管理有限公司关于终止与北京中期时代基金销售有限公司合作关系的公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 8 月 10 日
26	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年中期报告提示性公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 8 月 30 日
27	北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年中期报告	中国证券报、 公司网站	2022 年 8 月 30 日
28	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 10 月 26 日
29	北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第三季度报告	公司网站	2022 年 10 月 26 日
30	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金增加宁波银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 11 月 3 日
31	北信瑞丰基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购、追加申购及赎回最低数额限制的公告	中国证券报、 公司网站	2022 年 11 月 11 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## 12.2 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金的文件。
- 2、北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同。
- 3、北信瑞丰新成长灵活配置混合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。

### 13.2 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。

### 13.3 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，也可登录基金管理人网站 [www.bxrfund.com](http://www.bxrfund.com) 查阅。

北信瑞丰基金管理有限公司

2023 年 3 月 31 日