北信瑞丰丰利混合型证券投资基金
2023 年年度报告

2023 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：北京银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 30 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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 25 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，上会会计师事务所（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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 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 6
2.4 信息披露方式 7
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 7
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
§4 管理人报告 11
4.1 基金管理人及基金经理情况 11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 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 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 13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
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 15
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 16
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 16
§6 审计报告 16
6.1 审计报告基本信息 16
6.2 审计报告的基本内容 16
§7 年度财务报表 18
7.1 资产负债表 18
7.2 利润表 19

7.3 净资产变动表 21
7.4 报表附注 22
§8 投资组合报告 47
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 48
8.3 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 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 51
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 51
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 51
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 52
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 52
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 52
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 52
8.12 投资组合报告附注 52
§9 基金份额持有人信息 53
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 53
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 53
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 54
§10 开放式基金份额变动 54
§11 重大事件揭示 54
11.1 基金份额持有人大会决议 54
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 54
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 55
11.4 基金投资策略的改变 55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 55
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 55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 55
11.8 其他重大事件 57
§12 影响投资者决策的其他重要信息 59
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
§13 备查文件目录 60
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	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金
基金简称	北信瑞丰丰利
基金主代码	002745
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 6 月 27 日
基金管理人	北信瑞丰基金管理有限公司
基金托管人	北京银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,894,052.35 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于股票等权益类资产和债券等固定收益类金融工具，通过科学的资产配置与严谨的风险管理，力争超越业绩比较基准、实现基金资产持续稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略，包括行业配置策略和个股投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货投资策略，包括套保时机选择策略、期货合约选择和头寸选择策略、保证金管理；5、权证投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中债总财富指数收益率×80%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		北信瑞丰基金管理有限公司	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	夏彬	史学通
	联系电话	010-68619341	010-66223413
	电子邮箱	service@bxrfund.com	shixuetong@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		4000617297	95526
传真		010-68619300	010-89661115
注册地址		北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号	北京市西城区金融大街甲 17 号首层
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	北京市西城区金融大街丙 17 号
邮政编码		100048	100033

法定代表人	李永东	霍学文

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 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	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-2,808,327.87	2,693,408.10	724,845.48
本期利润	704,138.22	-824,425.32	35,172.72
加权平均基金份额本期利润	0.0217	-0.0071	0.0076
本期加权平均净值利润率	2.09%	-0.65%	0.70%
本期基金份额净值增长率	-0.87%	-1.82%	0.53%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	66,541.36	4,733,991.94	393,720.88
期末可供分配基金份额利润	0.0230	0.0320	0.1054
期末基金资产净值	2,960,593.71	152,813,255.73	4,130,211.33
期末基金份额净值	1.0230	1.0320	1.1054
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	3.94%	4.86%	6.80%

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。

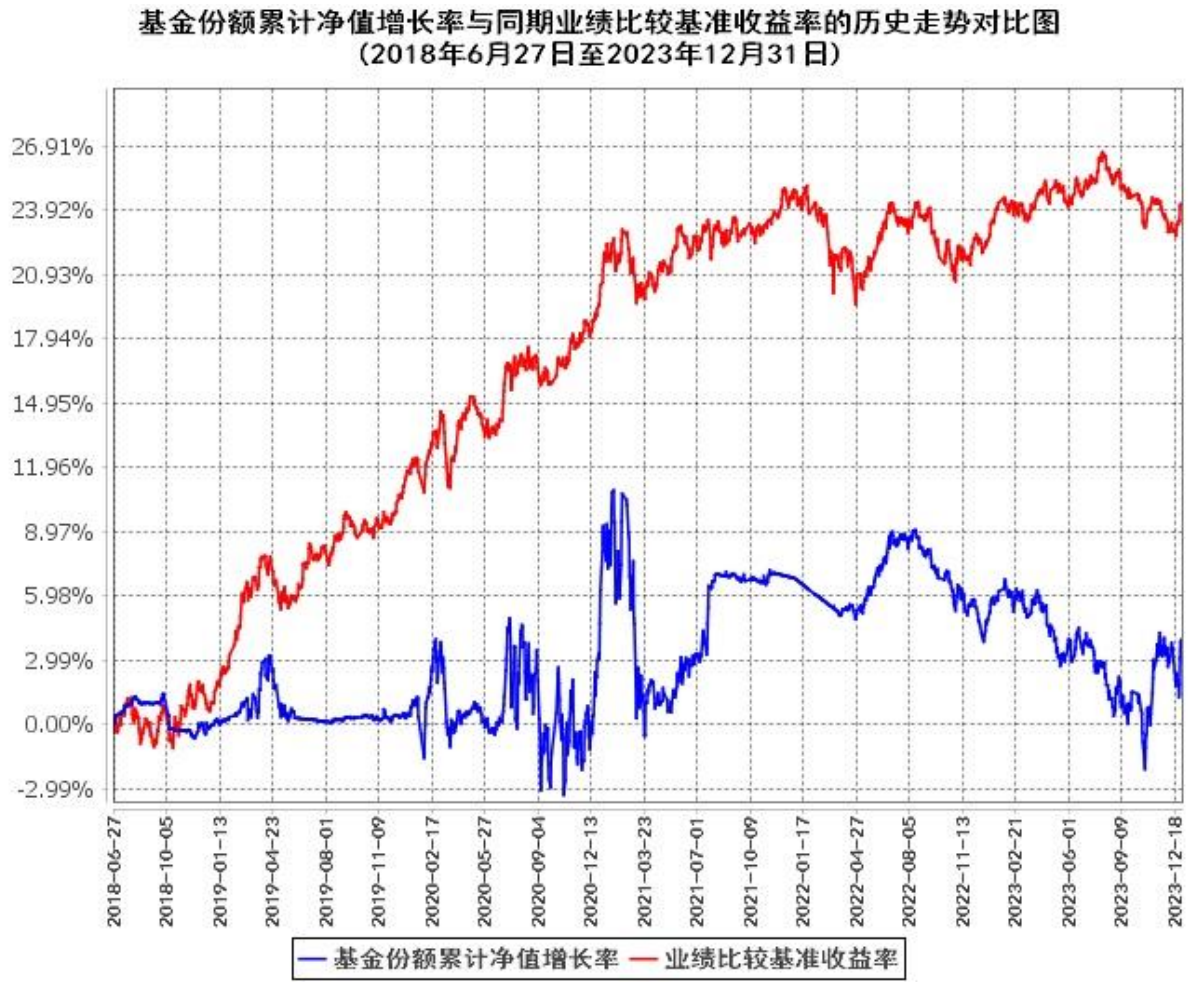
3.2 基金净值表现

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	2.40%	0.52%	-0.28%	0.17%	2.68%	0.35%
过去六个月	0.08%	0.44%	-0.54%	0.16%	0.62%	0.28%
过去一年	-0.87%	0.36%	1.39%	0.16%	-2.26%	0.20%
过去三年	-2.16%	0.42%	3.16%	0.23%	-5.32%	0.19%
过去五年	3.99%	0.48%	22.97%	0.24%	-18.98%	0.24%
自基金合同生效起至今	3.94%	0.46%	24.22%	0.24%	-20.28%	0.22%

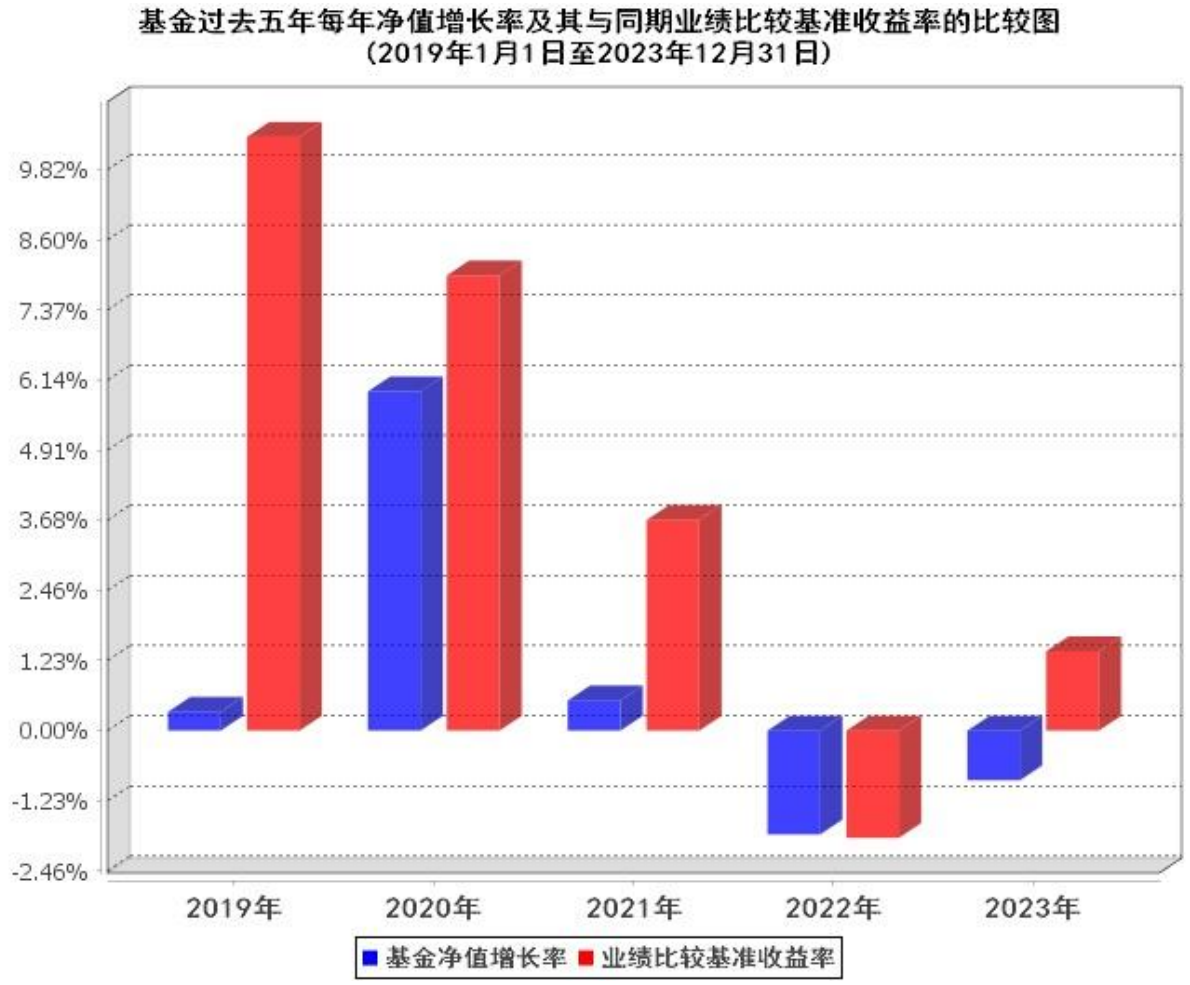
注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×20%+中债总财富指数收益率×80%。沪深 300 指数选取了 A 股市场上规模最大、流动性最好的 300 只股票作为其成份股，较好地反映了 A 股市场的总体趋势，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。中债总财富指数的编制参考了中国债券市场中部分核心成员的收益率估值数据，以更好地反映债券价格信息，是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。

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



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 2018 年 6 月 27 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

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023	-	-	-	-	-
2022	0.5400	171,581.37	7,446,572.95	7,618,154.32	-
2021	-	-	-	-	-
合计	0.5400	171,581.37	7,446,572.95	7,618,154.32	-

§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。

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		
陈皓	本基金基金经理	2021 年 3 月 26 日	-	9	陈皓先生，意大利威尼斯东方大学经济与组织专业博士学位，从事宏观研究及债券研究相关工作 9 年。曾任职于盛景网联企业管理顾问股份有限公司及合众人寿保险股份有限公司，从事咨询及大类资产配置相关工作。2014 年 7 月加入北信瑞丰基金管理有限公司，现任公司固收投资部基金经理。
林翟	本基金基金经理	2022 年 3 月 7 日	-	14	林翟先生，厦门大学应用经济学硕士，从事证券业 14 年。原华农财产保险股份有限公司资金运用部投资经理，中英人寿保险有限公司投资管理部投资经理，新时代证券股份有限公司固定收益部高级投资经理。2019 年 11 月加入北信瑞丰基金管理有限公司，现任固收投资二部基金经理。

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、证券从业的含义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

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遵规守信情况的说明

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，不存在损害基金持有人利益的情形。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。公司公平交易制度适用于旗下所有投资组合，包括开放式基金、私募资管业务投资组合等，制度规范的业务范围涵盖所有一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，贯穿授权、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。公司要求投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应该做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差。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。对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，合理分配投资指令。公司通过系统严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。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，对发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。。本报告期内本基金管理人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

全年看，债券市场经历了“二上一下”。“一上”持续到 8 月底，主要受经济数据疲弱影响，货币政策宽松预期较强；“一下”与部分经济数据边际企稳、利率债供给增加预期、化债进程的推进有关；“二上”受地缘关系影响，经济预期进一步走弱。一二月份，股票市场受益于经济活动恢复和同期低基数等因素影响，消费数据经历了较大幅度的反弹，同时开年财政政策和货币政策也相对比较宽松，因此我们看到股票市场一季度前半段也对基本面的这种边际改善做出反映，大幅反弹。其后经济预期走弱，股票市场震荡向下。

因本产品以获取相对较高收益，同时尽量减少波动和最大回撤为目标，所以权益仓位在上半年保持在较低水平，随着市场逐渐走低，宏观政策、产业政策和监管政策的陆续推出，本产品又进行了股票和可转债仓位的提升。在 2023 年权益市场大幅下行的背景下，本产品录得负收益。

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 1.0230 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.87%；同期业绩比较基准收益率为 1.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然国内物价指数、采购经理人指数、信贷等因素依然低迷，但其他因素已让我们在这个寒冬中看到一些暖意。产能与库存周期都位于底部区域；宽基指数的净利润累计同比有企稳迹象；金融部门负债率企稳回升，居民部门负债率也有企稳迹象，政府部门负债率预计在短期将继续托底经济；财政与货币政策预计将继续发力为经济保驾护航；美国通胀水平持续下滑；随着美联储加息预

期缓解，汇率贬值压力和资本外流压力亦有改善。

从 FED 模型看，权益也展现出更高的性价比。年初的货币政策环境比较宽松，对债券市场整体的影响偏多；纵向看，中长期利率债收益率水平位于历史 5%分位以下，期限利差也偏低；信用债收益率位于历史极低位置；整体来看期限结构比较扁平。综上，目前不适宜拉长久期，但利率上行风险亦可控。

目前中信风格指数金融、周期、消费和成长的估值水平分别位于历史 13%、25%、35%和 11%分位。相较年初金融、消费和成长风格指数的估值都大幅下行。金融估值水平虽然较低，但受到让利实体政策影响，长期可能机会也不大。考虑到国家战略转型和估值水平，成长股占优。考虑春节因素、相对于其他版块的业绩稳定性，可以适当配置消费。综合来看，目前还属于存量博弈，短期可能大盘价值风格的银行、地产、交运、公用事业等占优，但更长期来看，随着美联储降息预期增加，超跌的成长风格可能会反弹。在此判断基础上，权益配置结构如下：成长股为主，小盘股为辅，再加少量价值股分散风险。

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从业人员激励约束机制建立、董监高新规落实、文化建设、网络营销活动账号及涉非账号管理等主题的自查整改工作，对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了包括业务系统权限、投资者适当性管理、固有资金运用、代销机构管理、廉洁从业管理、异常交易管理、新股申购执行、反洗钱等主题的专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性；制定了《公募基金信用债投资集中度风险控制流程》、《压力测试管理办法》、《直播管理制度》、《内幕交易防控管理办法》，修订了《通讯工具管理办法》、《工作人员投资行为管理办法》、《资产估值业务实施细则》、《交易对手管理细则》、《公募产品股票库管理办法》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；针对法律法规和监管要求，积极组织包括“内幕交易、老鼠仓及对外言论管理”、“资管新规解读”、“投资管理人员注册登记及从业人员管理新规解读”、“公平交易及异常交易管理”、“投资者教育新规”等在内共 12 次合规培训，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；按照监管要求重新制定资管新规整改计划，完成资管新规整改台账填报，持续推进资管新规整改工作；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；完成各项信息披露的审核工作，保证所披露信息的及时性、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 2023 年 3 月 24 日至 2023 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报告并提交解决方案。

§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北信瑞丰丰利混合型证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配、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）、投资组合报告等内容，复核内容真实、准确和完整。

§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	上会师报字(2024)第 1549 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	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了北信瑞丰丰利混合型证券投资基金(以下简称“北信瑞丰丰利”)财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附北信瑞丰丰利的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了北信瑞丰丰利 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于北信瑞丰丰利，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	无
其他事项	我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系北信瑞丰丰利管理人(以下简称“基金

	管理人”)根据《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金合同》的规定为其基金份额持有人编制的，因此财务报表可能不适于其他用途。本报告仅供基金管理人提供北信瑞丰丰利份额持有人和向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用，不得用于其他目的。
其他信息	基金管理人对其他信息负责。其他信息包括北信瑞丰丰利 2023 年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。 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。 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。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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。 在编制财务报表时，基金管理人负责评估北信瑞丰丰利的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督北信瑞丰丰利基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： 1、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。 2、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。 3、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。 4、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丰利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。然而，未来的事项或情况可能导致北信瑞丰丰利不能持续经营。 5、评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就北信瑞丰丰利的审计范围、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。	
会计师事务所的名称	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈大愚	江嘉炜
会计师事务所的地址	上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 楼	
审计报告日期	2024 年 3 月 29 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：北信瑞丰丰利混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	259,459.47	2,214,515.82
结算备付金		7,550.20	635,923.64
存出保证金		1,380.02	35,629.39
交易性金融资产	7.4.7.2	2,586,525.39	150,223,783.04
其中：股票投资		870,466.00	19,846,950.00
基金投资		-	-
债券投资		1,716,059.39	130,376,833.04
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		131,408.66	-

应收股利		-	-
应收申购款		-	15.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		2,986,323.74	153,109,867.88
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2023 年 12 月 31 日**	**上年度末 2022 年 12 月 31 日**
负债：			
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		-	-
应付赎回款		2,478.52	-
应付管理人报酬		1,494.48	77,903.67
应付托管费		249.06	12,983.94
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		21.50	11,885.63
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	21,486.47	193,838.91
负债合计		25,730.03	296,612.15
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	2,894,052.35	148,079,263.79
未分配利润	7.4.7.8	66,541.36	4,733,991.94
净资产合计		2,960,593.71	152,813,255.73
负债和净资产总计		2,986,323.74	153,109,867.88

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0230 元，基金份额总额 2,894,052.35 份。

7.2 利润表

会计主体：北信瑞丰丰利混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		1,035,958.28	265,117.81
1.利息收入		45,020.76	98,287.53
其中：存款利息收入	7.4.7.9	17,584.02	26,023.20
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		27,436.74	72,264.33
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,547,329.04	3,683,840.78
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-2,450,510.55	-1,515,358.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-105,756.67	5,041,381.20
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	8,938.18	157,817.93
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	3,512,466.09	-3,517,833.42
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	25,800.47	822.92
减：二、营业总支出		331,820.06	1,089,543.13
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	209,417.79	745,935.26
2．托管费	7.4.10.2.2	34,902.98	124,322.60
3．销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		28,641.34	38,582.31
其中：卖出回购金融资产支出		28,641.34	38,582.31
6．信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7．税金及附加		1,733.95	10,114.96
8．其他费用	7.4.7.19	57,124.00	170,588.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		704,138.22	-824,425.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		704,138.22	-824,425.32
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		704,138.22	-824,425.32

7.3 净资产变动表

会计主体：北信瑞丰丰利混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	148,079,263.79	-	4,733,991.94	152,813,255.73
二、本期期初净资产	148,079,263.79	-	4,733,991.94	152,813,255.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-145,185,211.44	-	-4,667,450.58	-149,852,662.02
（一）、综合收益总额	-	-	704,138.22	704,138.22
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-145,185,211.44	-	-5,371,588.80	-150,556,800.24
其中：1.基金申购款	28,740.66	-	730.38	29,471.04
2.基金赎回款	-145,213,952.10	-	-5,372,319.18	-150,586,271.28
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,894,052.35	-	66,541.36	2,960,593.71
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,736,490.45	-	393,720.88	4,130,211.33
二、本期期初净资产	3,736,490.45	-	393,720.88	4,130,211.33

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	144,342,773.34	-	4,340,271.06	148,683,044.40
（一）、综合收益总额	-	-	-824,425.32	-824,425.32
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	144,342,773.34	-	12,782,850.70	157,125,624.04
其中：1.基金申购款	144,946,512.43	-	12,839,146.45	157,785,658.88
2.基金赎回款	-603,739.09	-	-56,295.75	-660,034.84
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-7,618,154.32	-7,618,154.32
四、本期期末净资产	148,079,263.79	-	4,733,991.94	152,813,255.73

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：

刘晓玲	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

北信瑞丰丰利混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后转型而来。根据北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金的基金管理人北信瑞丰基金管理有限公司于 2018 年 6 月 15 日发布《关于北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型相关业务规则的公告》，北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金转型为非保本的混合型证券投资基金，基金名称相应变更为“北信瑞丰丰利混合型证券投资基金”，北信瑞丰丰利保本混合型证券投资基金份额转换为北信瑞丰丰利混合型证券投资基金份额。转型后，基金的托管人、登记机构、基金代码不变。自 2018 年 6 月 27 日起《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金

基金合同》、《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金托管协议》生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为北信瑞丰基金管理有限公司，基金托管人为北京银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具，债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金持有股票资产占基金资产的 0%-40%；其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。权证投资占基金资产净值的比例不超过 3%；每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×20%+中债总财富指数收益率×80%。

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 2024 年 3 月 29 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颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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

本基金以人民币为记账本位币，记账本位币单位为元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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业务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。

① 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：

1)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业务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。

2)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、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

② 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。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违

约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等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；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占净资产的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息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，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1)本基金的管理人报酬、托管费等按《基金合同》约定的方法进行计提。

(2)卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

(3)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。

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 5%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

(2) 基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 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《关于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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局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 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46 号文《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 号文《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 号文《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 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19 号发布和国务院令[2011]第 588 号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第 448 号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，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 日前取得的基金、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基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、对证券投资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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3、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。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5、基金卖出股票缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7、本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	259,459.47	2,214,515.82
等于：本金	259,450.73	2,214,041.51
加：应计利息	8.74	474.31
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-

存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	259,459.47	2,214,515.82

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		896,152.00	-	870,466.00	-25,686.00
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,695,385.19	7,678.76	1,716,059.39	12,995.44
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,695,385.19	7,678.76	1,716,059.39	12,995.44
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,591,537.19	7,678.76	2,586,525.39	-12,690.56
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		21,483,962.07	-	19,846,950.00	-1,637,012.07
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	100,785,498.15	1,177,724.27	100,185,424.27	-1,777,798.15
	银行间市场	30,014,346.43	287,408.77	30,191,408.77	-110,346.43
	合计	130,799,844.58	1,465,133.04	130,376,833.04	-1,888,144.58
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		152,283,806.65	1,465,133.04	150,223,783.04	-3,525,156.65

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/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，本基金无从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本期末及上年度末，本基金无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.15	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,486.32	33,838.91
其中：交易所市场	2,486.32	33,663.91
银行间市场	-	175.00
应付利息	-	-
预提费用	19,000.00	160,000.00
合计	21,486.47	193,838.91

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	148,079,263.79	148,079,263.79
本期申购	28,740.66	28,740.66
本期赎回(以"-"号填列)	-145,213,952.10	-145,213,952.10
本期末	2,894,052.35	2,894,052.35

注：申购含红利再投、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

上年度末	17,643,717.79	-12,909,725.85	4,733,991.94
本期期初	17,643,717.79	-12,909,725.85	4,733,991.94
本期利润	-2,808,327.87	3,512,466.09	704,138.22
本期基金份额交易产生的变动数	-14,584,661.06	9,213,072.26	-5,371,588.80
其中：基金申购款	2,836.17	-2,105.79	730.38
基金赎回款	-14,587,497.23	9,215,178.05	-5,372,319.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	250,728.86	-184,187.50	66,541.36

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	13,006.59	15,456.29
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	4,128.21	10,135.06
其他	449.22	431.85
合计	17,584.02	26,023.20

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	36,484,635.07	28,239,349.91
减：卖出股票成本总额	38,847,549.26	29,662,125.33
减：交易费用	87,596.36	92,582.93
买卖股票差价收入	-2,450,510.55	-1,515,358.35

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

债券投资收益——利息收入	652,230.63	3,619,706.75
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-757,987.30	1,421,674.45
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-105,756.67	5,041,381.20

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	148,610,856.88	80,140,063.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	147,154,376.92	76,779,147.24
减：应计利息总额	2,212,854.13	1,937,080.92
减：交易费用	1,613.13	2,161.17
买卖债券差价收入	-757,987.30	1,421,674.45

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本报告期内及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本报告期内及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本报告期内及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	8,938.18	157,817.93
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	8,938.18	157,817.93

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	3,512,466.09	-3,517,833.42
——股票投资	1,611,326.07	-1,637,012.07
——债券投资	1,901,140.02	-1,880,821.35
——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	3,512,466.09	-3,517,833.42

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	25,798.20	822.92
基金转换费收入	2.27	-
合计	25,800.47	822.92

7.4.7.18 信用减值损失

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	10,000.00	40,000.00

信息披露费	-	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	45,000.00	9,100.00
银行费用	924.00	1,088.00
其他	1,200.00	400.00
合计	57,124.00	170,588.00

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

截至财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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
北京银行股份有限公司(“北京银行”)	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

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交易。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	209,417.79	745,935.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,306.77	11,721.11

应支付基金管理人的净管理费	200,111.02	734,214.15

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 0.60%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×0.60%/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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	34,902.98	124,322.60

注：支付基金托管人北京银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

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固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固有资金投资本基金。

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	本期	上年度可比期间

称	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 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
北京银行	259,459.47	13,006.59	2,214,515.82	15,456.29

注：本基金的活期银行存款由基金托管人北京银行保管，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，本基金无在承销期内参与关联方承销的证券。

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（2023 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。本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过相对灵活的资产配置，追求实现基金资产的持续稳定增值。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北京银行，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。

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。

7.4.13.2.1 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	20,026,482.74
合计	-	20,026,482.74

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。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	76,228,601.23
AAA 以下	1,213,442.95	23,956,823.04
未评级	-	-
合计	1,213,442.95	100,185,424.27

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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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 2023 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时间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、结算备付金和存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	259,459.47	-	-	-	259,459.47
结算备付金	7,550.20	-	-	-	7,550.20
存出保证金	1,380.02	-	-	-	1,380.02
交易性金融资产	1,716,059.39	-	-	870,466.00	2,586,525.39
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	131,408.66	131,408.66
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,984,449.08	-	-	1,001,874.66	2,986,323.74
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,478.52	2,478.52
应付管理人报酬	-	-	-	1,494.48	1,494.48
应付托管费	-	-	-	249.06	249.06
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	21.50	21.50
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	21,486.47	21,486.47
负债总计	-	-	-	25,730.03	25,730.03

利率敏感度缺口	1,984,449.08	-	-	976,144.63	2,960,593.71
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,214,515.82	-	-	-	2,214,515.82
结算备付金	635,923.64	-	-	-	635,923.64
存出保证金	35,629.39	-	-	-	35,629.39
交易性金融资产	122,409,876.88	7,966,956.16	-	19,846,950.00	150,223,783.04
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	15.99	15.99
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	125,295,945.73	7,966,956.16	-	19,846,965.99	153,109,867.88
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	77,903.67	77,903.67
应付托管费	-	-	-	12,983.94	12,983.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	11,885.63	11,885.63
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	193,838.91	193,838.91
负债总计	-	-	-	296,612.15	296,612.15
利率敏感度缺口	125,295,945.73	7,966,956.16	-	19,550,353.84	152,813,255.73

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

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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）

	1.市场利率下降 25 个基点	407.38	82,912.98
	2.市场利率上升 25 个基点	-406.60	-82,730.78

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比例为基金总资产的 80%-95%，债券以及中国证监会允许基金投资的其他资产占基金资产的比例不高于 20%；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%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。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 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	870,466.00	29.40	19,846,950.00	12.99
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	1,716,059.39	57.96	-	-
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	2,586,525.39	87.37	19,846,950.00	12.99

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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	33,954.27	-
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-33,954.27	-

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金净资产的比例为 12.99%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金净资产无重大影响。

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	2,083,908.95	29,340,343.59
第二层次	502,616.44	120,883,439.45
第三层次	-	-

合计	2,586,525.39	150,223,783.04

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

7.4.14.2.3.1 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 2023 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(2022 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	870,466.00	29.15
	其中：股票	870,466.00	29.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,716,059.39	57.46
	其中：债券	1,716,059.39	57.46
	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	267,009.67	8.94
8	其他各项资产	132,788.68	4.45
9	合计	2,986,323.74	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	540,273.00	18.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	140,014.00	4.73
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	52,451.00	1.77
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,266.00	0.89
J	金融业	28,161.00	0.95
K	房地产业	27,225.00	0.92
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	28,572.00	0.97
R	文化、体育和娱乐业	27,504.00	0.93
S	综合	-	-
	合计	870,466.00	29.40

注：以上行业分类以 2023 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所有股票投资明细

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	000039	中集集团	4,200	32,130.00	1.09
2	688100	威胜信息	1,100	31,812.00	1.07
3	601231	环旭电子	2,000	30,220.00	1.02
4	000876	新 希 望	3,200	29,824.00	1.01
5	300772	运达股份	2,800	29,792.00	1.01
6	002056	横店东磁	2,200	29,788.00	1.01
7	600873	梅花生物	3,100	29,605.00	1.00
8	000591	太阳能	5,300	29,574.00	1.00
9	600089	特变电工	2,100	28,980.00	0.98
10	600483	福能股份	3,500	28,945.00	0.98
11	601016	节能风电	9,600	28,800.00	0.97
12	600143	金发科技	3,600	28,764.00	0.97
13	300244	迪安诊断	1,200	28,572.00	0.97
14	601878	浙商证券	2,700	28,161.00	0.95
15	002085	万丰奥威	5,700	28,158.00	0.95
16	603337	杰克股份	1,300	28,080.00	0.95
17	300639	凯普生物	3,000	28,020.00	0.95
18	601877	正泰电器	1,300	27,963.00	0.94
19	000970	中科三环	2,700	27,945.00	0.94
20	002745	木林森	3,200	27,712.00	0.94
21	601921	浙版传媒	3,600	27,504.00	0.93
22	000789	万年青	4,000	27,440.00	0.93
23	600998	九州通	3,900	27,339.00	0.92
24	000402	金 融 街	7,500	27,225.00	0.92
25	601619	嘉泽新能	7,500	26,475.00	0.89
26	000553	安道麦 A	3,800	26,372.00	0.89
27	002609	捷顺科技	2,300	26,266.00	0.89
28	600163	中闽能源	6,000	26,220.00	0.89
29	600297	广汇汽车	14,600	25,112.00	0.85
30	603301	振德医疗	1,000	24,500.00	0.83
31	000915	华特达因	800	23,168.00	0.78

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	603688	石英股份	881,973.00	0.58
2	688348	昱能科技	784,426.00	0.51
3	600161	天坛生物	733,793.00	0.48

4	000403	派林生物	682,839.00	0.45
5	688032	禾迈股份	509,701.78	0.33
6	002821	凯莱英	499,074.00	0.33
7	002475	立讯精密	489,389.00	0.32
8	603993	洛阳钼业	483,750.00	0.32
9	600875	东方电气	440,563.00	0.29
10	688676	金盘科技	439,244.55	0.29
11	002241	歌尔股份	436,780.00	0.29
12	601016	节能风电	427,298.00	0.28
13	301018	申菱环境	396,097.00	0.26
14	000825	太钢不锈	368,000.00	0.24
15	301168	通灵股份	359,581.00	0.24
16	688663	新风光	350,726.94	0.23
17	605117	德业股份	341,841.00	0.22
18	601058	赛轮轮胎	302,700.00	0.20
19	600905	三峡能源	298,500.00	0.20
20	002472	双环传动	296,711.00	0.19

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	603688	石英股份	1,524,691.00	1.00
2	600547	山东黄金	1,327,333.00	0.87
3	601899	紫金矿业	1,075,979.00	0.70
4	600988	赤峰黄金	1,026,039.08	0.67
5	002155	湖南黄金	968,463.00	0.63
6	605117	德业股份	933,039.00	0.61
7	688348	昱能科技	886,169.67	0.58
8	600489	中金黄金	840,425.00	0.55
9	600161	天坛生物	737,333.00	0.48
10	000403	派林生物	727,800.00	0.48
11	300750	宁德时代	572,698.00	0.37
12	603993	洛阳钼业	570,000.00	0.37
13	600905	三峡能源	548,000.00	0.36
14	600600	青岛啤酒	506,142.00	0.33
15	603076	乐惠国际	499,240.00	0.33
16	002335	科华数据	498,408.00	0.33
17	600309	万华化学	493,781.00	0.32
18	002493	荣盛石化	486,137.00	0.32
19	301268	铭利达	437,244.00	0.29
20	002475	立讯精密	434,074.00	0.28

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	18,259,739.19
卖出股票收入（成交）总额	36,484,635.07

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

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	502,616.44	16.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,213,442.95	40.99
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,716,059.39	57.96

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

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	019709	23 国债 16	5,000	502,616.44	16.98
2	127092	运机转债	1,433	175,047.70	5.91
3	111011	冠盛转债	1,000	136,518.68	4.61
4	127054	双箭转债	1,000	124,705.07	4.21
5	111005	富春转债	1,000	122,240.41	4.13

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	1,380.02
2	应收清算款	131,408.66
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	132,788.68

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111011	冠盛转债	136,518.68	4.61
2	127054	双箭转债	124,705.07	4.21
3	111005	富春转债	122,240.41	4.13
4	123146	中环转 2	110,195.62	3.72
5	113033	利群转债	107,324.11	3.63
6	127034	绿茵转债	106,989.18	3.61
7	127033	中装转 2	103,879.86	3.51
8	123100	朗科转债	95,523.62	3.23
9	123059	银信转债	66,674.45	2.25
10	118028	会通转债	64,344.25	2.17

8.12.5 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
200	14,470.26	0.00	0.00%	2,894,052.50	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	223.38	0.0077%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：截至本报告期末，本基金的基金经理持有本基金份额总量的数据区间为 0。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 6 月 27 日）基金份额总额	76,139,669.47
本报告期期初基金份额总额	148,079,263.79
本报告期基金总申购份额	28,740.66
减：本报告期基金总赎回份额	145,213,952.10
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	2,894,052.35

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

基金管理人

本报告期内，重大人事变动情况如下：

1、公司原督察长张恩源先生于 2023 年 4 月 25 日辞去公司督察长职务，由原董事长李永东先生代行督察长职责，代行时间不超过六个月。

2、公司原董事长李永东先生于 2023 年 8 月 15 日离任，聘任夏彬同志为公司董事长并代为履行公司督察长职务。

3、公司原总经理赵远峰先生于 2023 年 8 月 15 日离任，由公司副总经理王乃力先生代为履行公司总经理职务。

4、2023 年 12 月 29 日，公司发布公告，刘晓玲女士自 2023 年 12 月 27 日起任公司总经理。

基金托管人

报告期内，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，基金管理人未结诉讼均不涉及基金财产赔付风险。

本报告期内，无涉及基金财产、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

为进一步维护基金份额持有人的利益，促进会计师事务所提供更优质的服务，自 2024 年 1 月 1 日起，本基金改聘了审计服务机构，由普华永道会计师事务所（特殊普通合伙）变更为上会会计师事务所（特殊普通合伙），该变更事项已履行相关程序，于 2024 年 1 月 3 日进行信息披露公告，并已按照相关规定及合同约定通知基金托管人。

上会会计师事务所（特殊普通合伙）已连续为本基金提供 1 年审计服务，本报告期内应支付会计师事务所的审计费为 10,000.00 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

报告期内，未发生托管人及其高级管理人员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	38,310,528.41	69.98%	35,731.40	74.83%	-
国联证券	2	16,433,845.85	30.02%	12,018.32	25.17%	-

联储证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-

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

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信建投证券	106,077,616.15	94.58%	301,000,000.00	71.45%	-	-	-	-
国联证券	6,083,072.90	5.42%	120,300,000.00	28.55%	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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。

11.8 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	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金 2022 年第四季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 20 日
2	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 20 日
3	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金增加海通证券为代销机构的公告	基金管理人网站	2023 年 2 月 10 日
4	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金增加博时财富为代销机构的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 21 日
5	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金招募说明书更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 3 日
6	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 3 日
7	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监	2023 年 3 月 31 日

		会基金电子披露网站	
8	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金 2022 年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 31 日
9	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 21 日
10	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金增加众惠基金销售有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 21 日
11	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金 2023 年第一季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 21 日
12	北信瑞丰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 27 日
13	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下部分基金增加上海陆享基金销售有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站	2023 年 5 月 17 日
14	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 21 日
15	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 21 日
16	北信瑞丰基金管理有限公司董事长变更公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 17 日
17	北信瑞丰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 17 日
18	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年中期报告提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 31 日
19	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金 2023 年中期报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 31 日
20	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下部分基金增加北京度小满基金销售有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站	2023 年 9 月 20 日
21	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金增加上海华夏财富投资管理有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站	2023 年 9 月 22 日
22	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部	中国证券报、基金管	2023 年 10 月 25 日

	基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
23	北信瑞丰丰利混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 25 日
24	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金增加乾道投资基金管理有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站	2023 年 11 月 1 日
25	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金增加上海大智慧基金销售有限公司为代销机构的公告	基金管理人网站	2023 年 12 月 28 日
26	北信瑞丰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 12 月 29 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

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者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230101 - 20230323	48,205,157.68	0.00	48,205,157.68	0.00	0.00%
机构	2	20230101 - 20230323	48,205,157.68	0.00	48,205,157.68	0.00	0.00%
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。

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丰利混合型证券投资基金的文件。

2、北信瑞丰丰利混合型证券投资基金基金合同。

3、北信瑞丰丰利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。

5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

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 查阅。

北信瑞丰基金管理有限公司

2024 年 3 月 30 日