

# 北信瑞丰产业升级多策略混合型 证券投资基金 2020 年年度报告

2020 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 03 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料经审计，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 2020 年 1 月 1 日起至 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>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
<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	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
<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合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
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	13
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>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§6 审计报告</b>	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
<b>§7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（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>46</b>
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
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	57
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	57
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	57

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 .....	57
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 .....	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
8.12 投资组合报告附注 .....	57
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>59</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	59
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 .....	59
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>60</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>61</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
11.4 基金投资策略的改变 .....	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
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 .....	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	61
11.8 其他重大事件 .....	64
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>67</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 .....	67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>68</b>
13.1 备查文件目录 .....	68
13.2 存放地点 .....	68
13.3 查阅方式 .....	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金
基金简称	北信瑞丰产业升级
基金主代码	168501
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 6 月 23 日
基金管理人	北信瑞丰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	213,593,482.53 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,把握转型升级的战略性机遇,精选在受益于产业升级的传统行业和新兴产业中具有核心竞争优势的标的进行投资,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过严谨的资产配置和个券精选策略,在严格进行风险控制的前提下,运用多种策略实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭亚	郭明
	联系电话	010-68619341	010-66105799
	电子邮箱	service@bxrfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4000617297	95588
传真		010-68619300	010-66105798
注册地址		北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市海淀区西三环北路 100 号光耀东方中心 A 座 6 层、25 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100048	100140
法定代表人		李永东	陈四清

### 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	<a href="http://www.bxrfund.com">http://www.bxrfund.com</a>
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	中国证券登记结算有限责任公司	中国北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 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	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	51,869,336.97	17,740,827.47	-11,768,931.67
本期利润	138,606,687.51	25,732,503.02	-15,729,496.54
加权平均基金份额本期利润	1.3921	0.4001	-0.1964
本期加权平均净值利润率	76.21%	41.45%	-21.19%
本期基金份额净值增长率	106.01%	47.30%	-20.23%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	166,570,146.00	7,868,923.15	-14,200,216.91
期末可供分配基金份额利润	0.7798	0.1415	-0.1931
期末基金资产净值	523,001,074.36	66,118,336.67	59,344,549.90
期末基金份额净值	2.4486	1.1886	0.8069
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	144.86%	18.86%	-19.31%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）；

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

#### 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

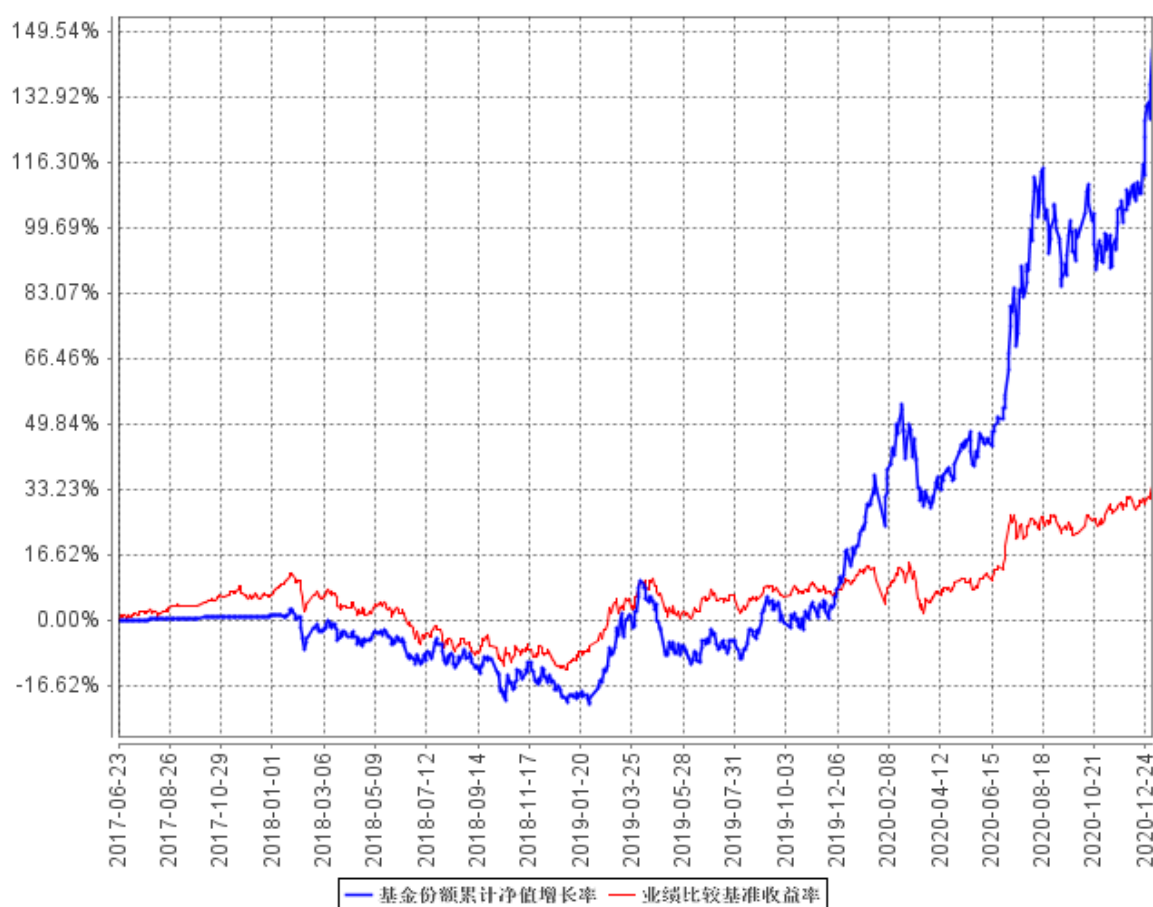
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	23.99%	1.87%	9.80%	0.69%	14.19%	1.18%
过去六个月	59.16%	2.13%	17.52%	0.94%	41.64%	1.19%
过去一年	106.01%	2.01%	20.05%	1.00%	85.96%	1.01%
过去三年	142.08%	1.63%	26.21%	0.94%	115.87%	0.69%
自基金合同生效起至今	144.86%	1.50%	34.12%	0.87%	110.74%	0.63%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%。本基金

是混合型基金，基金的投资组合比例为封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为 0%-100%，其中投资于产业升级主题方向的相关证券比例不低于非现金基金资产的 80%；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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。因此，沪深 300 指数收益率 $\times$ 70%+中证综合债指数收益率 $\times$ 30%适合作为本基金的业绩比较基准。

### 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

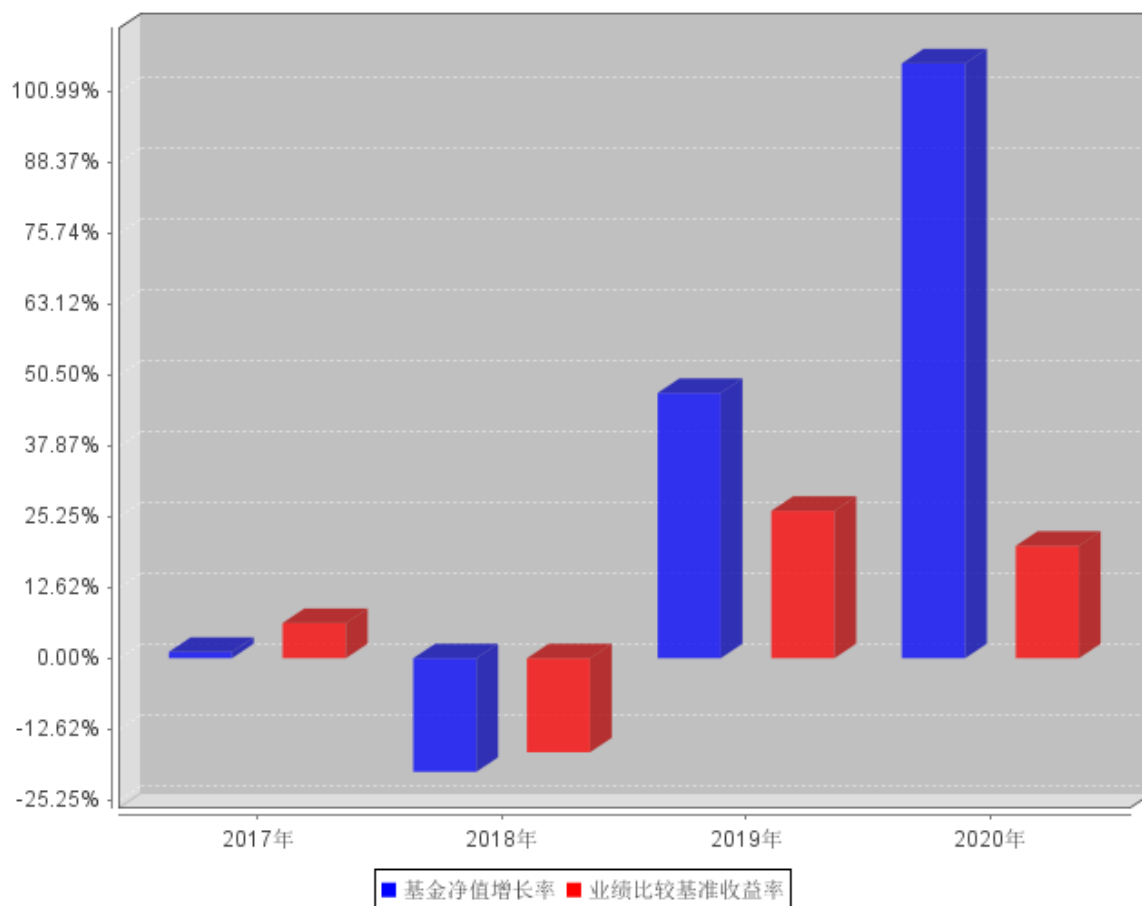


注：本基金的基金合同自 2017 年 6 月 23 日起生效，基金成立当年净值增长率以实际存续期计算；本报告期本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。



### 3.2.3 自基金合同生效以来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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同自 2017 年 6 月 23 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

本基金自 2017 年 6 月 23 日成立以来未实施利润分配。

## § 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。公司结合基金行业特点改善公司治理结构，积极推进股权激励。北信瑞丰基金着力打造具有高水准的投研团队，公司高管和主要投资管理人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。

截至报告期末，公司共成立 19 只公募产品，保有 69 只专户产品，资产管理规模 249.7 亿元，其中公募资产管理规模 88.97 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陆文凯	基金经理	2018 年 6 月 5 日	-	9	陆文凯先生，同济大学会计学学士，上海财经大学工商管理学硕士，9 年证券从业经历。历任申银万国证券研究所消费品行业分析师、汇丰晋信基金管理有限公司 TMT 行业高级研究员、上海道仁资产管理有限公司投资经理等职位，现任北信瑞丰基金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。

### 4.2 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办法》、《北信瑞丰基金管理有限公司异常交易监控管理办法》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和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

#### 4.3.3 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

2020 年 A 股市场表现优异，除了经历了二月由于新冠疫情导致的下跌外，全年呈现震荡上行态势，沪深 300、中证 500 指数全年分别上涨 27.21%、20.87%；同时，结构层面新兴产业表现格外喜人，创业板指全年实现 64.96% 的涨幅，科技、医药、消费、新能源等领域分别在全年的各个时间段有所表现，同样在行业指数层面均有优异表现。

本基金在 2020 年在“均值回归”为核心导向的投资框架下，通过兼顾成长性与估值的考量，期间重点看好了包括科技、军工、新能源以及消费行业的价值成长个股，在本年度为本基金贡献了较多的超额收益；本基金全年取得 106.01% 的收益，超越比较基准 85.96%；本基金在过去一年运作过程中，能够较为及时地关注到阶段热点行业的高估值风险，同时能够较为提前地积极布局较高风险收益比的部分行业领域，也一定程度上验证了均值回归效应在 A 股市场运作的长期有效性。

### 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 2.4486 元；本报告期基金份额净值增长率为 106.01%，业绩比较基准收益率为 20.05%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从 2020 年初新冠疫情爆发至今，全球经济以及宏观环境随着全球疫情的变化出现较大波动；全球经济的负增长伴随着流动性的持续宽松，推动着持续的资产价格上涨趋势。展望 2021 年，随着疫苗的推出以及部分区域疫情防控有效性的提升，经济行为正在逐步复苏，之前极端宽松的货币环境或将不再，在 2020 低基数效应下，2021 年经济将得以复苏，流动性环境将进入较为正常的运行区间。

A 股市场在经历了 2019-2020 年持续两年的上涨后，整体估值已经告别了较为便宜的区间并且结构分化严重，虽然市场整体并不贵，但较为显著地出现了以大市值、行业龙头为代表的“标签化”投资风格，部分公司与行业估值持续高企，而未被贴上标签的公司则陷入一定的流动性折价困局中，估值持续下行。

本基金一直恪守“均值回归”的投资框架体系，在这一体系下，部分行业与公司在持续高企的估值与已经延续较长时间的景气周期情况下，风险收益比不足，甚至面临较大的风险；同时大量被市场通过“标签化”所抛弃的低估值成长股则更有机会通过持续兑现业绩增速而获得上涨动能，这些公司将是我们重点关注的机会所在。我们维持对于军工、周期成长、低估值 TMT 等领域的看好观点，同时积极关注前期受到全球疫情影响的部分细分行业，在低估值状态下关注其基本

面的变化，等待机会出现。

#### 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，继续致力于内控机制的完善，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投资者适当性管理、证券经营行业经营机构洗钱和恐怖融资风险评估等主题的自查工作，对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了包括疫情防控工作、信息技术管理、投资人员移动通讯工具管控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公募产品股票库管理办法》、《北信瑞丰基金管理有限公司货币市场基金管理办法》、《北信瑞丰基金管理有限公司信用评级管理办法》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；针对新出台的法律法规和监管要求，积极组织包括《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宣传推介材料管理暂行规定》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》等在内的多项法律法规、职业道德培训，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

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2017]13号公告《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、[2008]38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（2017年9月5日废止）等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设有基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、研究人员、交易人员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发

行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题；提议基金估值调整的相关方案并进行校验；根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案。

基金运营部根据基金估值工作小组的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金和理财类基金）。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

#### **4.9 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**

本基金本报告期内基金持有人数或基金资产净值无预警说明。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金的管理人——北信瑞丰基金管理有限公司在北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对北信瑞丰基金管理有限公司编制和披露的北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金 2020 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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	普华永道中天审字(2021)第 22369 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	北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金（以下简称“北信瑞丰产业升级基金”）的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表和所有者权益（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产业升级基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 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产业升级基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>北信瑞丰产业升级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产业升级基金 2020 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	北信瑞丰产业升级基金的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



	<p>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，基金管理人管理层负责评估北信瑞丰产业升级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产业升级基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督北信瑞丰产业升级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，就可能对北信瑞丰产业升级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。然而未来的事项或情况可能导致北信瑞丰产业升级基金不能持续经营。</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	薛竞	郭蕙心
会计师事务所的地址	中国·上海市	
审计报告日期	2021 年 3 月 30 日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	43,337,591.34	5,091,266.97
结算备付金		1,303,214.80	709,828.68
存出保证金		133,738.96	53,951.84
交易性金融资产	7.4.7.2	461,914,306.54	59,926,296.12
其中：股票投资		461,914,306.54	59,926,296.12
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	1,800,000.00
应收证券清算款		4,710,215.35	87,138.07
应收利息	7.4.7.5	5,888.38	1,311.84
应收股利		-	-
应收申购款		29,147,630.23	1,228.30
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		540,552,585.60	67,671,021.82
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2019 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		-	-
应付证券清算款		13,825,802.10	952,871.51
应付赎回款		2,430,100.26	54,342.04
应付管理人报酬		526,245.62	80,539.43
应付托管费		87,707.58	13,423.27
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	508,789.84	331,508.80
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	172,865.84	120,000.10
负债合计		17,551,511.24	1,552,685.15
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	213,593,482.53	55,626,769.56
未分配利润	7.4.7.10	309,407,591.83	10,491,567.11
所有者权益合计		523,001,074.36	66,118,336.67
负债和所有者权益总计		540,552,585.60	67,671,021.82

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.4486 元，基金份额总额 213,593,482.53 份。

## 7.2 利润表

会计主体：北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		144,580,166.87	28,404,859.30
1. 利息收入		99,561.20	77,779.41
其中：存款利息收入	7.4.7.11	87,995.48	45,743.91
债券利息收入		75.59	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,490.13	32,035.50
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		56,737,984.35	20,324,875.82
其中：股票投资收益	7.4.7.12	56,202,642.92	19,761,160.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	50,562.31	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	484,779.12	563,715.55
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	86,737,350.54	7,991,675.55
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,005,270.78	10,528.52
<b>减：二、费用</b>		5,973,479.36	2,672,356.28
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,688,994.87	929,336.01
2. 托管费	7.4.10.2.2	448,165.81	154,889.35

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,629,333.46	1,430,158.92
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.22	-
7. 其他费用	7.4.7.20	206,985.00	157,972.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		138,606,687.51	25,732,503.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		138,606,687.51	25,732,503.02

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	55,626,769.56	10,491,567.11	66,118,336.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	138,606,687.51	138,606,687.51
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	157,966,712.97	160,309,337.21	318,276,050.18
其中：1. 基金申购款	302,316,497.49	303,189,120.54	605,505,618.03
2. 基金赎回款	-144,349,784.52	-142,879,783.33	-287,229,567.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	213,593,482.53	309,407,591.83	523,001,074.36
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	73,544,766.81	-14,200,216.91	59,344,549.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,732,503.02	25,732,503.02
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-17,917,997.25	-1,040,719.00	-18,958,716.25
其中：1. 基金申购款	807,586.40	64,193.71	871,780.11
2. 基金赎回款	-18,725,583.65	-1,104,912.71	-19,830,496.36
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	55,626,769.56	10,491,567.11	66,118,336.67

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：

<u>朱彦</u>	<u>朱彦</u>	<u>姜晴</u>
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

北信瑞丰产业升级多策略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[2017]170 号《关于准予北信瑞丰产业升级多策略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《北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型基金，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 219,282,755.48 元，业经中喜会计师事务所(特殊普通合伙)中喜验字(2017)第 0135 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 6 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 219,394,202.02 份基金份额，其中认购资金利息折合 111,446.54 份基金份额。本基金的基金管理人为北信瑞丰基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金基金合同》和《北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金在封闭期内不开放申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额；封闭期届满后，本基金转换为

上市开放式基金，并更名为北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金(LOF)。本基金的封闭期是指自《北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金基金合同》生效之日起(包括《北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金基金合同》生效之日)至 18 个月(含第 18 个月)后对应日(若该日为非工作日或无该对应日，则为该日之前的最后一个工作日)的期间。

根据本基金份额持有人大会于 2017 年 12 月 11 日表决通过的《关于北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，本基金的基金管理人北信瑞丰基金管理有限公司于 2017 年 12 月 12 日发布《北信瑞丰基金管理有限公司关于北信瑞丰产业升级多策略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》，并经中国证监会证监许可[2017]1983 号《关于准予北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金变更注册的批复》核准，本基金于 2017 年 12 月 12 日起进入集中赎回选择期，投资人仅可以通过场外销售机构办理赎回，不可以通过场内直接办理赎回，也不可以办理申购。集中赎回选择期自 2017 年 12 月 12 日起至 2018 年 1 月 9 日止，自 2018 年 1 月 10 日起，原《北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金基金合同》失效，新《北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金基金合同》于同一起生效，本基金自该日起正式实施转型，转型后本基金变更为非上市基金开放式运作。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《北信瑞丰产业升级多策略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(含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。股票资产占基金资产的比例范围为 50%-95%，其中投资于产业升级主题方向的相关证券比例不低于非现金基金资产的 80%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金(包含股指期货合约需缴纳的交易保证金等)、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×70%+中证综合债指数收益率×30%。

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 2021 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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称

“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《北信瑞丰产业升级多策略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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值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

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其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

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、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 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所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 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基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

#### 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所有者权益转出。

#### 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和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

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

#### **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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	43,337,591.34	5,091,266.97
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计：	43,337,591.34	5,091,266.97

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	371,239,717.03	461,914,306.54	90,674,589.51
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		371,239,717.03	461,914,306.54	90,674,589.51
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		55,989,057.15	59,926,296.12	3,937,238.97
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		55,989,057.15	59,926,296.12	3,937,238.97

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,800,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,800,000.00	-

##### 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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,276.74	933.77
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	645.04	351.45
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	900.38	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	66.22	26.62
合计	5,888.38	1,311.84

## 7.4.7.6 其他资产

本期末及上年度末，本基金无其他资产。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	508,789.84	331,508.80
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	508,789.84	331,508.80

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
预提费用	169,000.00	120,000.00
应付赎回费	3,865.84	0.10
合计	172,865.84	120,000.10

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	55,626,769.56	55,626,769.56

本期申购	302,316,497.49	302,316,497.49
本期赎回（以“-”号填列）	-144,349,784.52	-144,349,784.52
本期末	213,593,482.53	213,593,482.53

#### 7.4.7.10 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	7,868,923.15	2,622,643.96	10,491,567.11
本期利润	51,869,336.97	86,737,350.54	138,606,687.51
本期基金份额交易产生的变动数	106,831,885.88	53,477,451.33	160,309,337.21
其中：基金申购款	204,403,606.55	98,785,513.99	303,189,120.54
基金赎回款	-97,571,720.67	-45,308,062.66	-142,879,783.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	166,570,146.00	142,837,445.83	309,407,591.83

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
活期存款利息收入	68,814.52	36,954.58
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	13,864.22	8,008.62
其他	5,316.74	780.71
合计	87,995.48	45,743.91

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019 年12月31日
卖出股票成交总额	857,595,500.14	514,869,532.35
减：卖出股票成本总额	801,392,857.22	495,108,372.08
买卖股票差价收入	56,202,642.92	19,761,160.27

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年
----	----------------------	----------------------------

	年12月31日	12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	388,240.00	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	337,600.00	-
减：应收利息总额	77.69	-
买卖债券差价收入	50,562.31	-

#### 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 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。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	484,779.12	563,715.55
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	484,779.12	563,715.55

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	86,737,350.54	7,991,675.55
——股票投资	86,737,350.54	7,991,675.55
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——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	86,737,350.54	7,991,675.55
----	---------------	--------------

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,005,206.31	10,528.52
其他	64.47	-
合计	1,005,270.78	10,528.52

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	2,629,333.46	1,430,158.92
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,629,333.46	1,430,158.92

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
信息披露费	120,000.00	80,000.00
账户维护费	45,000.00	36,000.00
审计费用	40,000.00	40,000.00
银行费用	785.00	772.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	206,985.00	157,972.00

### 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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,688,994.87	929,336.01
其中：支付销售机构的客户维护费	638,582.72	129,180.27

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 1.50%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 × 1.50% / 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	448,165.81	154,889.35

注：支付基金托管人中国工商银行托管费按前一日基金资产净值 0.25%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 × 0.25% / 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

份额单位:份

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	5,064,700.33	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	5,064,700.33	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注:本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

#### 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
北京国际信 托有限公司	-	-	50,035,450.00	89.95%

### 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 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
中国工商银行	43,337,591.34	68,814.52	5,091,266.97	36,954.58

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管,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（2020 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688595	芯海科技	2020 年 9 月 18 日	2021 年 3 月 29 日	新股流通受限	22.82	60.56	3,190	72,795.80	193,186.40	-
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 7 日	未上市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
688668	鼎通科技	2020 年 12 月 11 日	2021 年 6 月 21 日	新股流通受限	20.07	28.16	3,037	60,952.59	85,521.92	-
300896	爱美客	2020 年 9 月 21 日	2021 年 3 月 29 日	新股流通受限	118.27	603.96	138	16,321.26	83,346.48	-
688590	新致软件	2020 年 11 月 27 日	2021 年 6 月 7 日	新股流通受限	10.73	18.75	4,171	44,754.83	78,206.25	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300894	火星人	2020 年 12 月 24 日	2021 年 6 月 30 日	新股流通受限	14.07	46.91	628	8,835.96	29,459.48	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300910	瑞丰新材	2020 年 11 月 20 日	2021 年 5 月 27 日	新股流通受限	30.26	59.62	360	10,893.60	21,463.20	-
300884	狄耐克	2020 年 11 月 5 日	2021 年 5 月 12 日	新股流通受限	24.87	41.46	499	12,410.13	20,688.54	-
300898	熊猫乳品	2020 年 10 月 9 日	2021 年 4 月 16 日	新股流通受限	10.78	41.18	496	5,346.88	20,425.28	-
300909	汇创达	2020 年 11 月 11 日	2021 年 5 月 18 日	新股流通受限	29.57	50.16	386	11,414.02	19,361.76	-
300891	惠云钛业	2020 年 9 月 10 日	2021 年 3 月 17 日	新股流通受限	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300908	仲景食品	2020 年 11 月 13 日	2021 年 5 月 24 日	新股流通受限	39.74	73.81	250	9,935.00	18,452.50	-
300913	兆龙	2020 年 11 月	2021 年 6 月	新股流	13.21	29.24	630	8,322.30	18,421.20	-

	互连	月 27 日	7 日	通受限						
300902	国 安	2020 年 10	2021 年 4 月	新股流	15.38	30.82	551	8,474.38	16,981.82	-
	达	月 22 日	29 日	通受限						
300907	康 平	2020 年 11	2021 年 5 月	新股流	14.30	34.55	473	6,763.90	16,342.15	-
	科技	月 11 日	18 日	通受限						
300925	法 本	2020 年 12	2021 年 6 月	新股流	20.08	44.69	353	7,088.24	15,775.57	-
	信息	月 21 日	30 日	通受限						
300892	品 渥	2020 年 9 月	2021 年 3 月	新股流	26.66	60.01	223	5,945.18	13,382.23	-
	食品	11 日	30 日	通受限						
300895	铜 牛	2020 年 9 月	2021 年 3 月	新股流	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
	信息	17 日	24 日	通受限						
300879	大 叶	2020 年 8 月	2021 年 3 月	新股流	10.58	27.14	450	4,761.00	12,213.00	-
	股份	25 日	1 日	通受限						
300887	谱 尼	2020 年 9 月	2021 年 3 月	新股流	44.47	74.49	162	7,204.14	12,067.38	-
	测试	9 日	16 日	通受限						
300918	南 山	2020 年 12	2021 年 6 月	新股流	4.97	11.20	1,063	5,283.11	11,905.60	-
	智尚	月 15 日	22 日	通受限						
300882	万 胜	2020 年 8 月	2021 年 3 月	新股流	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
	智能	27 日	10 日	通受限						
300877	金 春	2020 年 8 月	2021 年 3 月	新股流	30.54	50.83	222	6,779.88	11,284.26	-
	股份	17 日	3 日	通受限						
300922	天 秦	2020 年 12	2021 年 6 月	新股流	16.05	36.78	287	4,606.35	10,555.86	-
	装备	月 18 日	25 日	通受限						
300872	天 阳	2020 年 8 月	2021 年 2 月	新股流	21.34	37.83	276	5,889.84	10,441.08	-
	科技	14 日	25 日	通受限						
300893	松 原	2020 年 9 月	2021 年 3 月	新股流	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
	股份	17 日	24 日	通受限						
300881	盛 德	2020 年 8 月	2021 年 3 月	新股流	14.17	32.30	291	4,123.47	9,399.30	-
	鑫泰	25 日	5 日	通受限						
300871	回 盛	2020 年 8 月	2021 年 2 月	新股流	33.61	38.69	234	7,864.74	9,053.46	-
	生物	13 日	24 日	通受限						
300889	爱 克	2020 年 9 月	2021 年 3 月	新股流	27.97	30.12	283	7,915.51	8,523.96	-
	股份	9 日	16 日	通受限						
300878	维 康	2020 年 8 月	2021 年 3 月	新股流	41.34	48.71	166	6,862.44	8,085.86	-
	药业	17 日	3 日	通受限						
300873	海 晨	2020 年 8 月	2021 年 3 月	新股流	30.72	41.31	172	5,283.84	7,105.32	-
	股份	14 日	2 日	通受限						
300886	华 业	2020 年 9 月	2021 年 3 月	新股流	18.59	45.65	147	2,732.73	6,710.55	-
	香料	8 日	16 日	通受限						
003031	中 瓷	2020 年 12	2021 年 1 月	未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
	电子	月 24 日	4 日							
300926	博 俊	2020 年 12	2021 年 7 月	新股流	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
	科技	月 29 日	7 日	通受限						

300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
--------	------	------------------	----------------	--------	-------	-------	-----	----------	----------	---

注：1. 根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2. 基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 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

本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资和基金投资等。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。本基金在严格控制风险的前提下，把握转型升级的战略性机遇，精选在受益于产业升级的传统行业和新兴产业中具有核心竞争优势的标的进行投资，力争实现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行中国工商银行，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。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2019 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 2020 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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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%。于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.19%。

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、存出保证金和买入返售金融资产等。

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	43,337,591.34	-	-	-	43,337,591.34
结算备付金	1,303,214.80	-	-	-	1,303,214.80
存出保证金	133,738.96	-	-	-	133,738.96
交易性金融资产	-	-	-	461,914,306.54	461,914,306.54
应收证券清算款	-	-	-	4,710,215.35	4,710,215.35
应收利息	-	-	-	5,888.38	5,888.38
应收申购款	-	-	-	29,147,630.23	29,147,630.23
资产总计	44,774,545.10	-	-	495,778,040.50	540,552,585.60
负债					
应付证券清算款	-	-	-	13,825,802.10	13,825,802.10
应付赎回款	-	-	-	2,430,100.26	2,430,100.26
应付管理人报酬	-	-	-	526,245.62	526,245.62
应付托管费	-	-	-	87,707.58	87,707.58
应付交易费用	-	-	-	508,789.84	508,789.84
其他负债	-	-	-	172,865.84	172,865.84
负债总计	-	-	-	17,551,511.24	17,551,511.24
利率敏感度缺口	44,774,545.10	-	-	478,226,529.26	523,001,074.36
上年度末 2019 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	5,091,266.97	-	-	-	5,091,266.97
结算备付金	709,828.68	-	-	-	709,828.68
存出保证金	53,951.84	-	-	-	53,951.84
交易性金融资产	-	-	-	59,926,296.12	59,926,296.12
买入返售金融资产	1,800,000.00	-	-	-	1,800,000.00
应收证券清算款	-	-	-	87,138.07	87,138.07
应收利息	-	-	-	1,311.84	1,311.84
应收申购款	-	-	-	1,228.30	1,228.30
资产总计	7,655,047.49	-	-	60,015,974.33	67,671,021.82
负债					
应付证券清算款	-	-	-	952,871.51	952,871.51
应付赎回款	-	-	-	54,342.04	54,342.04
应付管理人报酬	-	-	-	80,539.43	80,539.43
应付托管费	-	-	-	13,423.27	13,423.27

应付交易费用	-	-	-	331,508.80	331,508.80
其他负债	-	-	-	120,000.10	120,000.10
负债总计	-	-	-	1,552,685.15	1,552,685.15
利率敏感度缺口	7,655,047.49	-	-	58,463,289.18	66,118,336.67

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 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2019 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 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。本基金股票资产占基金资产的比例范围为 50%-95%，其中投资于产业升级主题方向的相关证券比例不低于非现金基金资产的 80%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金（包含股指期货合约需缴纳的交易保证金等）、应收申购款等。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 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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	461,914,306.54	88.32	59,926,296.12	90.63
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	461,914,306.54	88.32	59,926,296.12	90.63

## 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(2020 年 12 月 31 日)	上年度末(2019 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	30,567,059.29	3,767,588.12
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-30,567,059.29	-3,767,588.12

## 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 460,895,343.87 元，属于第二层次的余额为 1,018,962.67 元，无属于第三

层次的余额(于 2019 年 12 月 31 日, 第一层次 58,845,215.74 元, 第二层次 1,081,080.38 元, 无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 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(2019 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 其他

除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	461,914,306.54	85.45
	其中：股票	461,914,306.54	85.45
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	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	44,640,806.14	8.26
8	其他各项资产	33,997,472.92	6.29
9	合计	540,552,585.60	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 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	406,629,792.57	77.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	13,382.23	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	7,105.32	0.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	135,959.04	0.03
J	金融业	18,600,000.00	3.56
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	17,766,000.00	3.40
M	科学研究和技术服务业	18,762,067.38	3.59

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	461,914,306.54	88.32

注：以上行业分类以 2020 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

本报告期末本基金未持有按行业分类的港股通投资股票。

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	603678	火炬电子	599,950	43,376,385.00	8.29
2	600765	中航重机	1,600,000	40,000,000.00	7.65
3	600893	航发动力	660,000	39,171,000.00	7.49
4	002651	利君股份	3,300,000	38,082,000.00	7.28
5	688002	睿创微纳	200,000	22,200,000.00	4.24
6	000768	中航西飞	600,000	22,008,000.00	4.21
7	002460	赣锋锂业	200,000	20,240,000.00	3.87
8	002949	华阳国际	1,000,000	18,750,000.00	3.59
9	300059	东方财富	600,000	18,600,000.00	3.56
10	002027	分众传媒	1,800,000	17,766,000.00	3.40
11	603308	应流股份	531,800	15,794,460.00	3.02
12	600760	中航沈飞	190,000	14,854,200.00	2.84
13	000733	振华科技	250,000	14,712,500.00	2.81
14	688311	盟升电子	100,000	11,990,000.00	2.29
15	300395	菲利华	200,000	11,966,000.00	2.29
16	002074	国轩高科	300,000	11,736,000.00	2.24
17	600316	洪都航空	200,000	11,374,000.00	2.17
18	300696	爱乐达	200,000	10,930,000.00	2.09
19	002985	北摩高科	50,000	9,665,000.00	1.85
20	688122	西部超导	120,000	9,541,200.00	1.82
21	300159	新研股份	2,000,000	9,200,000.00	1.76
22	688333	铂力特	60,000	9,118,800.00	1.74
23	002149	西部材料	446,000	8,157,340.00	1.56
24	605123	派克新材	100,000	8,036,000.00	1.54

25	002026	山东威达	700,000	7,980,000.00	1.53
26	688386	泛亚微透	100,079	6,158,861.66	1.18
27	300855	图南股份	95,300	4,563,917.00	0.87
28	002414	高德红外	100,000	4,175,000.00	0.80
29	688686	奥普特	1,903	412,570.40	0.08
30	300894	火星号	6,279	306,358.48	0.06
31	688595	芯海科技	3,190	193,186.40	0.04
32	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.02
33	688668	鼎通科技	3,037	85,521.92	0.02
34	300896	爱美客	138	83,346.48	0.02
35	688590	新致软件	4,171	78,206.25	0.01
36	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.01
37	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.01
38	300910	瑞丰新材	360	21,463.20	0.00
39	300884	狄耐克	499	20,688.54	0.00
40	300898	熊猫乳品	496	20,425.28	0.00
41	300909	汇创达	386	19,361.76	0.00
42	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
43	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
44	300908	仲景食品	250	18,452.50	0.00
45	300913	兆龙互连	630	18,421.20	0.00
46	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
47	300902	国安达	551	16,981.82	0.00
48	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
49	300907	康平科技	473	16,342.15	0.00
50	300925	法本信息	353	15,775.57	0.00
51	300892	品渥食品	223	13,382.23	0.00
52	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
53	300879	大叶股份	450	12,213.00	0.00
54	300887	谱尼测试	162	12,067.38	0.00
55	300918	南山智尚	1,063	11,905.60	0.00
56	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
57	300877	金春股份	222	11,284.26	0.00
58	300922	天秦装备	287	10,555.86	0.00
59	300872	天阳科技	276	10,441.08	0.00
60	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
61	300881	盛德鑫泰	291	9,399.30	0.00
62	300871	回盛生物	234	9,053.46	0.00
63	300889	爱克股份	283	8,523.96	0.00



64	300878	维康药业	166	8,085.86	0.00
65	300873	海晨股份	172	7,105.32	0.00
66	300886	华业香料	147	6,710.55	0.00
67	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00
68	688567	孚能科技	129	5,901.75	0.00

## 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	603678	火炬电子	36,773,185.59	55.62
2	002460	赣锋锂业	36,440,144.41	55.11
3	600893	航发动力	33,827,766.64	51.16
4	002651	利君股份	32,752,473.50	49.54
5	600765	中航重机	32,508,470.37	49.17
6	300059	东方财富	31,453,204.63	47.57
7	300159	新研股份	29,806,242.96	45.08
8	600760	中航沈飞	28,114,435.96	42.52
9	002949	华阳国际	28,078,284.00	42.47
10	600438	通威股份	24,293,883.49	36.74
11	000768	中航西飞	23,102,435.00	34.94
12	688788	科思科技	22,097,724.09	33.42
13	600316	洪都航空	21,058,632.40	31.85
14	300233	金城医药	18,698,537.56	28.28
15	603308	应流股份	18,690,617.25	28.27
16	300696	爱乐达	18,274,967.75	27.64
17	688002	睿创微纳	18,008,006.86	27.24
18	002027	分众传媒	17,732,609.36	26.82
19	000733	振华科技	17,571,960.00	26.58
20	688311	盟升电子	17,188,180.88	26.00
21	688122	西部超导	15,547,377.13	23.51
22	300095	华伍股份	14,929,486.00	22.58
23	300395	菲利华	14,741,897.00	22.30
24	002985	北摩高科	12,374,027.91	18.71
25	002560	通达股份	12,312,204.91	18.62

26	002074	国轩高科	11,748,155.35	17.77
27	688333	铂力特	11,090,145.35	16.77
28	605288	凯迪股份	10,644,709.00	16.10
29	600862	中航高科	10,213,597.72	15.45
30	688386	泛亚微透	10,000,133.51	15.12
31	002026	山东威达	9,836,074.00	14.88
32	603313	梦百合	9,832,659.64	14.87
33	300750	宁德时代	9,808,878.94	14.84
34	603501	韦尔股份	9,803,200.00	14.83
35	300600	国瑞科技	9,546,102.34	14.44
36	002149	西部材料	9,458,080.67	14.30
37	002240	盛新锂能	9,422,070.00	14.25
38	002705	新宝股份	8,869,837.75	13.42
39	002389	航天彩虹	8,866,283.34	13.41
40	300855	图南股份	8,391,761.54	12.69
41	002025	航天电器	8,256,946.90	12.49
42	688567	孚能科技	8,167,907.75	12.35
43	601668	中国建筑	7,925,000.00	11.99
44	605123	派克新材	7,848,731.80	11.87
45	603208	江山欧派	7,693,994.50	11.64
46	600391	航发科技	7,547,459.94	11.42
47	300699	光威复材	7,057,423.12	10.67
48	600584	长电科技	6,795,881.00	10.28
49	600703	三安光电	6,417,706.48	9.71
50	603267	鸿远电子	6,280,153.60	9.50
51	600118	中国卫星	6,202,967.00	9.38
52	600547	山东黄金	5,834,033.60	8.82
53	300034	钢研高纳	5,538,379.92	8.38
54	601066	中信建投	5,457,296.51	8.25
55	002013	中航机电	5,379,893.47	8.14
56	300866	安克创新	5,346,536.25	8.09
57	688111	金山办公	5,333,333.69	8.07
58	002507	涪陵榨菜	5,071,950.72	7.67
59	000547	航天发展	5,061,675.00	7.66
60	000725	京东方 A	5,002,700.00	7.57
61	600030	中信证券	4,990,591.72	7.55

62	600496	精工钢构	4,949,823.52	7.49
63	002332	仙琚制药	4,706,318.00	7.12
64	300070	碧水源	4,486,202.00	6.79
65	000063	中兴通讯	4,291,286.00	6.49
66	002111	威海广泰	4,092,658.00	6.19
67	002624	完美世界	4,062,251.00	6.14
68	600456	宝钛股份	4,053,487.00	6.13
69	300777	中简科技	3,942,524.00	5.96
70	600745	闻泰科技	3,862,226.00	5.84
71	002414	高德红外	3,840,233.40	5.81
72	688008	澜起科技	3,834,189.14	5.80
73	601633	长城汽车	3,811,865.00	5.77
74	002585	双星新材	3,709,162.20	5.61
75	000703	恒逸石化	3,669,009.00	5.55
76	300253	卫宁健康	3,667,713.00	5.55
77	600764	中国海防	3,571,326.00	5.40
78	688005	容百科技	3,549,524.39	5.37
79	002493	荣盛石化	3,489,921.00	5.28
80	002977	天箭科技	3,483,502.50	5.27
81	603728	鸣志电器	3,401,473.91	5.14
82	600837	海通证券	3,363,382.00	5.09
83	601336	新华保险	3,307,661.00	5.00
84	002217	合力泰	3,297,434.00	4.99
85	000739	普洛药业	3,225,311.00	4.88
86	002080	中材科技	3,224,649.00	4.88
87	002171	楚江新材	3,221,639.82	4.87
88	688466	金科环境	3,221,316.39	4.87
89	002602	世纪华通	3,176,731.60	4.80
90	000513	丽珠集团	3,106,368.00	4.70
91	002683	宏大爆破	3,083,689.00	4.66
92	603160	汇顶科技	3,081,644.00	4.66
93	601628	中国人寿	3,081,313.00	4.66
94	601601	中国太保	3,032,311.00	4.59
95	002368	太极股份	2,935,027.00	4.44
96	000034	神州数码	2,834,323.00	4.29
97	000963	华东医药	2,795,878.60	4.23

98	002777	久远银海	2,778,458.80	4.20
99	002601	龙麟佰利	2,759,013.00	4.17
100	688179	阿拉丁	2,758,355.69	4.17
101	300861	美畅股份	2,725,844.00	4.12
102	603986	兆易创新	2,716,679.00	4.11
103	002299	圣农发展	2,647,907.00	4.00
104	603195	公牛集团	2,587,045.00	3.91
105	600060	海信视像	2,553,330.00	3.86
106	688196	卓越新能	2,412,633.89	3.65
107	688388	嘉元科技	2,345,187.49	3.55
108	002153	石基信息	2,341,704.00	3.54
109	300182	捷成股份	2,313,786.00	3.50
110	002925	盈趣科技	2,261,890.95	3.42
111	002242	九阳股份	2,260,491.68	3.42
112	688011	新光光电	2,231,516.11	3.38
113	603839	安正时尚	2,200,447.00	3.33
114	002466	天齐锂业	2,187,184.24	3.31
115	000625	长安汽车	2,159,854.00	3.27
116	688058	宝兰德	2,152,300.05	3.26
117	600038	中直股份	2,124,936.00	3.21
118	300598	诚迈科技	2,026,946.00	3.07
119	300775	三角防务	1,996,176.00	3.02
120	300455	康拓红外	1,981,995.24	3.00
121	600827	百联股份	1,976,452.00	2.99
122	603019	中科曙光	1,905,461.60	2.88
123	603588	高能环境	1,876,756.00	2.84
124	300511	雪榕生物	1,873,846.00	2.83
125	300659	中孚信息	1,769,990.00	2.68
126	002947	恒铭达	1,744,453.00	2.64
127	601238	广汽集团	1,736,630.00	2.63
128	688023	安恒信息	1,736,460.86	2.63
129	603456	九洲药业	1,686,297.00	2.55
130	600662	强生控股	1,619,005.00	2.45
131	603920	世运电路	1,572,983.00	2.38
132	002063	远光软件	1,533,100.00	2.32
133	002439	启明星辰	1,422,221.00	2.15

134	600489	中金黄金	1,410,000.00	2.13
135	300424	航新科技	1,360,792.88	2.06

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	002460	赣锋锂业	33,654,693.97	50.90
2	600438	通威股份	28,435,156.00	43.01
3	600316	洪都航空	21,831,967.00	33.02
4	688788	科思科技	19,300,098.92	29.19
5	300059	东方财富	17,483,089.20	26.44
6	300159	新研股份	17,144,333.00	25.93
7	603678	火炬电子	16,716,452.78	25.28
8	600760	中航沈飞	15,624,704.00	23.63
9	300750	宁德时代	13,600,567.94	20.57
10	002705	新宝股份	13,314,554.90	20.14
11	300600	国瑞科技	13,065,126.00	19.76
12	300095	华伍股份	12,928,564.30	19.55
13	300233	金城医药	12,739,806.85	19.27
14	603208	江山欧派	12,111,532.00	18.32
15	600862	中航高科	11,337,508.00	17.15
16	002560	通达股份	11,297,373.00	17.09
17	688122	西部超导	11,041,777.07	16.70
18	603501	韦尔股份	10,471,414.58	15.84
19	605288	凯迪股份	10,287,785.00	15.56
20	601668	中国建筑	10,190,000.00	15.41
21	600584	长电科技	10,139,170.31	15.33
22	600703	三安光电	9,766,854.80	14.77
23	603267	鸿远电子	9,698,649.00	14.67
24	002025	航天电器	9,678,922.00	14.64
25	002389	航天彩虹	9,383,690.05	14.19
26	300696	爱乐达	9,150,571.00	13.84
27	603313	梦百合	9,052,637.00	13.69
28	002240	盛新锂能	8,840,617.60	13.37
29	688567	孚能科技	8,579,687.51	12.98
30	688111	金山办公	8,565,749.20	12.96

31	000063	中兴通讯	8,107,919.50	12.26
32	600893	航发动力	7,994,341.02	12.09
33	600030	中信证券	7,283,870.60	11.02
34	600765	中航重机	7,204,068.16	10.90
35	300699	光威复材	7,164,888.00	10.84
36	000725	京东方A	7,091,600.00	10.73
37	600496	精工钢构	6,830,346.04	10.33
38	600391	航发科技	6,697,972.20	10.13
39	603986	兆易创新	6,369,781.60	9.63
40	600547	山东黄金	6,339,432.00	9.59
41	002013	中航机电	6,247,531.00	9.45
42	002149	西部材料	6,151,059.00	9.30
43	000768	中航西飞	5,946,079.00	8.99
44	002332	仙琚制药	5,836,938.31	8.83
45	603308	应流股份	5,830,226.00	8.82
46	600118	中国卫星	5,794,522.83	8.76
47	002507	涪陵榨菜	5,728,324.36	8.66
48	300395	菲利华	5,652,016.12	8.55
49	000547	航天发展	5,337,742.00	8.07
50	300866	安克创新	5,334,569.00	8.07
51	300034	钢研高纳	5,167,022.00	7.81
52	601066	中信建投	4,986,386.40	7.54
53	600837	海通证券	4,972,185.85	7.52
54	002624	完美世界	4,902,676.87	7.42
55	688008	澜起科技	4,836,463.34	7.31
56	600745	闻泰科技	4,601,609.60	6.96
57	688005	容百科技	4,453,810.10	6.74
58	600456	宝钛股份	4,337,572.00	6.56
59	688179	阿拉丁	4,299,208.33	6.50
60	002602	世纪华通	4,220,781.72	6.38
61	002241	歌尔股份	4,128,448.00	6.24
62	688311	盟升电子	4,126,710.41	6.24
63	688386	泛亚微透	4,066,612.63	6.15
64	002111	威海广泰	3,867,913.00	5.85
65	002475	立讯精密	3,843,695.00	5.81
66	002171	楚江新材	3,807,462.50	5.76
67	300070	碧水源	3,768,295.54	5.70
68	601336	新华保险	3,750,752.70	5.67

69	002683	宏大爆破	3,681,638.00	5.57
70	300777	中简科技	3,669,984.00	5.55
71	601633	长城汽车	3,655,720.00	5.53
72	002493	荣盛石化	3,605,111.00	5.45
73	603728	鸣志电器	3,505,412.15	5.30
74	688333	铂力特	3,469,382.71	5.25
75	000739	普洛药业	3,446,397.00	5.21
76	603160	汇顶科技	3,400,560.00	5.14
77	002368	太极股份	3,379,378.25	5.11
78	601601	中国太保	3,374,277.00	5.10
79	300855	图南股份	3,351,264.68	5.07
80	002585	双星新材	3,347,282.60	5.06
81	601628	中国人寿	3,345,902.06	5.06
82	688023	安恒信息	3,317,058.15	5.02
83	000703	恒逸石化	3,265,086.40	4.94
84	300253	卫宁健康	3,263,938.00	4.94
85	688466	金科环境	3,161,849.85	4.78
86	600764	中国海防	3,140,601.00	4.75
87	000513	丽珠集团	3,103,939.00	4.69
88	002777	久远银海	3,103,292.80	4.69
89	000733	振华科技	3,092,557.00	4.68
90	688388	嘉元科技	3,046,903.23	4.61
91	002080	中材科技	3,036,847.94	4.59
92	002977	火箭科技	2,972,014.00	4.49
93	002217	合力泰	2,926,499.50	4.43
94	601636	旗滨集团	2,796,466.00	4.23
95	600486	扬农化工	2,795,364.00	4.23
96	000034	神州数码	2,795,074.00	4.23
97	603195	公牛集团	2,776,937.00	4.20
98	688018	乐鑫科技	2,774,618.12	4.20
99	002601	龙鳞佰利	2,715,491.00	4.11
100	002299	圣农发展	2,706,940.00	4.09
101	002074	国轩高科	2,675,813.10	4.05
102	002985	北摩高科	2,665,050.10	4.03
103	300598	诚迈科技	2,615,130.00	3.96
104	600827	百联股份	2,566,970.00	3.88
105	300861	美畅股份	2,532,467.00	3.83
106	688196	卓越新能	2,504,357.25	3.79

107	000963	华东医药	2,445,160.00	3.70
108	603019	中科曙光	2,305,414.00	3.49
109	002153	石基信息	2,253,431.00	3.41
110	600038	中直股份	2,208,623.00	3.34
111	002242	九阳股份	2,200,299.00	3.33
112	603920	世运电路	2,192,330.00	3.32
113	600060	海信视像	2,155,121.25	3.26
114	002925	盈趣科技	2,143,026.00	3.24
115	000625	长安汽车	2,097,786.00	3.17
116	002466	天齐锂业	2,091,565.00	3.16
117	688058	宝兰德	2,070,165.00	3.13
118	002541	鸿路钢构	2,068,203.50	3.13
119	600567	山鹰国际	2,018,000.00	3.05
120	688011	新光光电	2,014,824.00	3.05
121	002949	华阳国际	1,976,489.00	2.99
122	600048	保利地产	1,924,141.00	2.91
123	300741	华宝股份	1,895,045.00	2.87
124	300775	三角防务	1,887,125.00	2.85
125	688002	睿创微纳	1,853,827.97	2.80
126	603839	安正时尚	1,850,143.00	2.80
127	601238	广汽集团	1,783,259.00	2.70
128	603588	高能环境	1,764,348.65	2.67
129	002439	启明星辰	1,753,650.00	2.65
130	300455	康拓红外	1,752,783.00	2.65
131	002947	恒铭达	1,713,077.00	2.59
132	300659	中孚信息	1,707,085.00	2.58
133	603456	九洲药业	1,699,304.00	2.57
134	300182	捷成股份	1,652,085.00	2.50
135	300501	海顺新材	1,635,425.00	2.47
136	300511	雪榕生物	1,623,000.00	2.45
137	600662	强生控股	1,595,554.00	2.41
138	300763	锦浪科技	1,498,481.00	2.27
139	603612	索通发展	1,478,386.00	2.24
140	002063	远光软件	1,396,101.00	2.11

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	1,116,643,517.10
卖出股票收入（成交）总额	857,595,500.14

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

- （1）本基金本报告期末未持有股指期货。
- （2）本基金本报告期内未进行股指期货交易。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

## 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

- （1）本基金本报告期末未持有国债期货。
- （2）本基金本报告期内未进行国债期货交易。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

## 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	133,738.96
2	应收证券清算款	4,710,215.35
3	应收股利	—
4	应收利息	5,888.38
5	应收申购款	29,147,630.23
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	33,997,472.92

### 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的说明

本基金期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 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
208,701	1,023.44	59,045,747.94	27.64%	154,547,734.59	72.36%

### 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	939,822.61	0.44%

### 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	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2017 年 6 月 23 日 ）基金份额总额	219,394,202.02
本报告期期初基金份额总额	55,626,769.56
本报告期基金总申购份额	302,316,497.49
减:本报告期基金总赎回份额	144,349,784.52
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	213,593,482.53

注：根据北信瑞丰基金管理有限公司关于北信瑞丰产业升级多策略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》，本基金自 2017 年 12 月 12 日起至 2018 年 1 月 9 日止进入集中赎回选择期间，期间投资人仅可以通过场外销售机构办理赎回，不可以通过场内直接办理赎回，也不可以办理申购；自 2018 年 1 月 10 日起，本基金正式实施基金转型，运作方式由原封闭 18 个月后转开放式变更为普通开放式，并且不再在交易所上市。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有举行基金份额持有人大会。

### 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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 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

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

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

本报告期内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	
方正证券	3	407,910,314.49	20.74%	371,724.36	23.49%	-

长江证券	1	237,960,905.10	12.10%	174,020.83	11.00%	—
海通证券	2	220,957,483.86	11.23%	161,585.88	10.21%	—
兴业证券	2	156,281,021.18	7.94%	114,288.66	7.22%	新增
中泰证券	1	140,048,562.24	7.12%	130,427.14	8.24%	—
信达证券	2	126,774,434.43	6.44%	109,684.56	6.93%	—
中信建投	1	122,946,362.15	6.25%	89,910.85	5.68%	新增
光大证券	1	104,953,847.57	5.34%	76,753.51	4.85%	新增
华创证券	1	77,699,022.43	3.95%	56,820.63	3.59%	新增
申万宏源	2	68,213,101.27	3.47%	49,885.00	3.15%	—
天风证券	2	65,101,577.59	3.31%	60,629.62	3.83%	—
西南证券	1	62,889,538.90	3.20%	58,568.78	3.70%	—
中信证券	3	53,981,203.83	2.74%	39,476.60	2.49%	—
新时代证券	1	49,098,608.00	2.50%	35,904.71	2.27%	—
东方证券	1	46,281,352.17	2.35%	33,845.28	2.14%	—
川财证券	2	26,006,567.98	1.32%	19,018.45	1.20%	—
东北证券	2	—	—	—	—	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
国联证券	1	—	—	—	—	—
国信证券	2	—	—	—	—	—
东吴证券	1	—	—	—	—	—
渤海证券	1	—	—	—	—	—
广发证券	2	—	—	—	—	—
国都证券	2	—	—	—	—	—
招商证券	2	—	—	—	—	—
国金证券	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本基金合同于 2017 年 06 月 23 日正式生效。本报告期内，本基金新增中信建投、光大证券、华创证券各 1 各交易单元、兴业证券 2 个交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

### 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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
方正证券	-	-	116,000,000.00	75.62%	-	-
长江证券	388,240.00	100.00%	-	-	-	-
海通证券	-	-	11,800,000.00	7.69%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

西南证券	-	-	15,600,000.00	10.17%	-	-
中信证券	-	-	10,000,000.00	6.52%	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

## 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	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、 指定网站	2020 年 1 月 18 日
2	北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资 基金 2019 年第 4 季度报告	指定网站	2020 年 1 月 18 日
3	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下基金 开放日及开放时间的提示性公告	中国证券报、 指定网站	2020 年 1 月 31 日
4	北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资 基金 2019 年年度报告摘要	指定网站	2020 年 3 月 27 日
5	北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资 基金 2019 年年度报告	指定网站	2020 年 3 月 27 日
6	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金	中国证券报、	2020 年 3 月 27 日



	2019 年年度报告提示性公告	指定网站	
7	北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	指定网站	2020 年 4 月 22 日
8	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、 指定网站	2020 年 4 月 22 日
9	关于北信瑞丰基金管理有限公司旗下证券投资基金修改基金合同的公告	中国证券报、 指定网站	2020 年 5 月 26 日
10	北信瑞丰基金管理有限公司北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金基金合同	指定网站	2020 年 5 月 26 日
11	北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金托管协议	指定网站	2020 年 5 月 26 日
12	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券估值调整的提示性公告	中国证券报、 指定网站	2020 年 6 月 23 日
13	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报、 公司网站	2020 年 7 月 21 日
14	北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	公司网站	2020 年 7 月 21 日
15	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下证券投资基金更新招募说明书的提示性公告	中国证券报、 公司网站	2020 年 8 月 27 日
16	北信瑞丰基金管理有限公司北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2020 年第 1 号)	公司网站	2020 年 8 月 27 日
17	北信瑞丰基金管理有限公司北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2020 年第 1 号)	公司网站	2020 年 8 月 27 日
18	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年中期报告提示性公告	中国证券报、 公司网站	2020 年 8 月 29 日
19	北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金 2020 年中期报告	公司网站	2020 年 8 月 29 日

20	北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金 2020 年中期报告摘要	公司网站	2020 年 8 月 29 日
21	北信瑞丰基金管理有限公司关于旗下证券投资基金披露基金产品资料概要的提示性公告	中国证券报、 公司网站	2020 年 8 月 31 日
22	北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金基金产品资料概要	公司网站	2020 年 8 月 31 日
23	北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金基金产品资料概要	公司网站	2020 年 9 月 7 日
24	关于北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资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	2020 年 9 月 25 日
25	北信瑞丰基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报、 公司网站	2020 年 10 月 28 日
26	北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	公司网站	2020 年 10 月 28 日
27	关于终止大泰金石基金销售有限公司办理北信瑞丰基金管理有限公司旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、 公司网站	2020 年 11 月 2 日
28	净值更正公告	公司网站	2020 年 12 月 7 日
29	北信瑞丰基金管理有限公司关于增加泛华普益基金销售有限公司为旗下基金代理销售机构的公告	中国证券报、 公司网站	2020 年 12 月 21 日
30	北信瑞丰基金管理有限公司关于终止与部分代销机构合作关系的公告	中国证券报、 公司网站	2020 年 12 月 26 日
31	北信瑞丰基金管理有限公司关于暂停网上交易部分业务的公告	中国证券报、 公司网站	2020 年 12 月 31 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	20200101-20200922	50,035,450.00	-	50,035,450.00	-	0.00%
	2	20201124-20201229	-	39,956,480.90	-	39,956,480.90	18.71%
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披露。

## § 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产业升级多策略混合型证券投资基金的文件。
- 2、北信瑞丰产业升级多策略混合型证券投资基金基金合同。
- 3、北信瑞丰产业升级多策略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，也可登陆基金管理人网站 [www.bxrfund.com](http://www.bxrfund.com) 查阅。

北信瑞丰基金管理有限公司

2021 年 3 月 31 日