

北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资 基金清算报告

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

清算报告出具日：二〇一八年一月十二日

清算报告公告日：二〇一八年三月八日

目录

一、重要提示.....	3
二、基金概况.....	4
三、财务会计报告.....	5
四、清盘事项说明.....	6
五、清算情况.....	6
六、备查文件.....	9

一、重要提示

北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金（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”）2014年11月5日证监许可[2014]1173号《关于准予北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》文核准募集，自2014年12月24日起基金合同生效，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。

根据《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》和《北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）等有关规定，发起式证券投资基金基金合同生效满3年之日，若基金资产规模低于2亿元，基金合同自动终止。截至2017年12月24日日终，本基金资产规模约为0.23亿元，触发基金合同终止情形，基金合同自动终止。基金管理人已就该事项于2017年12月26日在《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站（<http://www.bxrfund.com>）刊登了《关于北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

自2017年12月26日至2018年1月12日为本基金财产清算期。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、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2017年12月26日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金运作期最后一日的财务报告进行清算审计，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

- 1、基金名称：北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金（基金简称：北信瑞丰无限互联主题灵活配置，基金代码：000886）。
- 2、基金运作方式：契约型开放式、发起式。
- 3、基金合同生效日：2014年12月24日。
- 4、投资目标：本基金通过相对灵活的资产配置，重点投资于有独特商业模式、深刻影响人们生活方式的快速成长的互联网公司，为互联网建设提供基础设施的软件、硬件设备等行业的公司，以及使用互联网技术、互联网工具、互联网思维带动传统产业升级改造的优质上市公司，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期、稳定增值。
- 5、投资策略：本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行各大类资产中的个股、个券精选。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四部分组成。
- 6、业绩比较基准：中证800指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%。
- 7、风险收益特征：本基金为混合型基金，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。
- 8、基金管理人：北信瑞丰基金管理有限公司。
- 9、基金托管人：中国工商银行股份有限公司。

三、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2017年12月25日

单位：人民币元

资产负债表	最后运作日 2017年12月25日
资 产：	
银行存款	31,117,320.56
结算备付金	156,710.90
存出保证金	17,878.42
股票投资	1,423,194.00
应收利息	3,306.00
应收申购款	494.52
资产总计	32,718,904.40
负 债：	
应付赎回款	11,559,037.49
应付管理人报酬	35,748.68
应付托管费	5,958.09
应付交易费用	70,629.66
其他负债	141,105.80
其中：应付赎回费	1,105.80
其中：预提费用	140,000.00
负债合计	11,812,479.72
所有者权益：	
实收基金	32,054,681.72
未分配利润	-11,148,257.04
所有者权益合计	20,906,424.68
负债和所有者权益总计	32,718,904.40

注：

1、报告截止日2017年12月25日（本基金最后运作日），北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金的份额净值为0.652元，基金份额总额为32,054,681.72份。

2、截止2017年12月25日，除停牌股票外，其余股票均已卖出。

四、 清盘事项说明

(一)清算原因

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”及“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”“二、《基金合同》的终止事由”的约定：

基金合同生效满三年之日（2017年12月24日），本基金资产规模约为0.23亿元，已出现触发基金合同终止的上述情形。根据《中华人民共和国证券投资基金法》规定和基金合同约定，不需召开基金份额持有人大会，基金管理人终止本基金基金合同并依法履行基金财产清算程序。

(二)清算起始日

根据《关于北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金清算起始日为2017年12月26日。

(三)清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产、负债均按清算价格计价，剩余停牌股票的清算价格按最后运作日的公允价值计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

五、 清算情况

自2017年12月26日至2018年1月12日止为本基金清算期，基金财产清算小组按照法律法规及《基金合同》的规定履行基金财产清算程序，全部工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

(一)清算费用

按照《北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。考虑到本基金清算的实际情况，

从保护基金份额持有人利益的角度出发，除银行直接扣付的划款手续费、银行间账户维护费和交易单元佣金外，与本基金的清算相关的清算费用将由基金管理人代为支付。

(二)资产清算情况

截至本基金最后运作日，各项资产清算情况如下：

- 1、 结算备付金人民币 156,710.90 元，已由基金管理人于 2017 年 12 月 26 日以自有资金垫付至托管账户。
- 2、 存出保证金人民币 17,878.42 元，已由基金管理人于 2017 年 12 月 26 日以自有资金垫付至托管账户。
- 3、 应收利息人民币 3,306.00 元，已由基金管理人于 2017 年 12 月 26 日以自有资金垫付至托管账户。
- 4、 应收申购款人民币 494.52 元，已于 2017 年 12 月 26 日划入托管账户。
- 5、 持有停牌股票于基金最后运作日估值金额之和为人民币 1,423,194.00 元，截至本次清算期结束日（2018 年 1 月 12 日）均未复牌，已由基金管理人于 2017 年 12 月 26 日以自有资金垫付至托管账户。

(三)负债清算情况

本基金最后运作日：

- 1、 应付赎回款为人民币 11,559,037.49 元，该款项已于 2017 年 12 月 27 日支付。
- 2、 应付管理人报酬为人民币 35,748.68 元，该款项已于 2018 年 1 月 9 日支付。
- 3、 应付托管费为人民币 5,958.09 元，该款项已于 2018 年 1 月 9 日支付。
- 4、 应付交易费用为人民币 70,629.66 元，该款项已于 2018 年 1 月 9 日及 2018 年 1 月 10 日支付。
- 5、 其他负债为人民币 141,105.80 元，包括应付赎回费、审计费、中证报信息披露费、证券时报信息披露费等。应付赎回费为人民币

1,105.80 元，该款项已于 2017 年 12 月 27 日支付；审计费为人民币 20,000.00 元，该款项已于 2018 年 1 月 12 日支付；中证报信息披露费为人民币 60,000.00 元，该款项已于 2018 年 1 月 12 日支付；证券时报信息披露费为人民币 60,000.00 元，该款项已于 2018 年 1 月 12 日支付。

(四)本次清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2017 年 12 月 26 日 至 2018 年 1 月 12 日 止清算期间
一、清算收益	
利息收入 (注 1)	7,164.11
清算收入小计	7,164.11
二、清算费用	
汇划手续费 (注 2)	359.19
银行间账户维护费 (注 3)	6,000.00
交易费用 (注 4)	1,423.19
清盘律师费	20,000.00
清算费用小计	27,782.38
三、清算净收益	-20,618.27

表中相关项目具体说明如下：

注 1：利息收入系计提的自 2017 年 12 月 26 日至 2018 年 1 月 12 日止清算期间银行存款、结算备付金、存出保证金利息，已由基金管理人以自有资金垫付至托管账户。

注 2：汇划手续费为清算期间实际发生的银行汇划手续费及预留手续费。

注 3：中央国债登记结算有限责任公司对开户会员按季收取中债账户维护费，该笔费用为 2017 年 10 月至 2018 年 1 月（办理销户手续期间）产生的费用，已于 2018 年 1 月 10 日支付。

注 4：该笔费用为预估现有停牌股票在未来复牌后卖出所产生的交易单元佣金费用。

(五)截止本次清算期结束日的剩余财产情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2017 年 12 月 25 日基金净资产	20,906,424.68
加：清算期间净收益	-20,618.27
二、2018 年 1 月 12 日基金资产净值	20,885,806.41

截至本次清算期结束日 2018 年 1 月 12 日，本基金剩余财产为人民币 20,885,806.41 元。根据本基金的基金合同约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产在清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

(六)基金清算报告的告知及剩余财产分配安排

本清算报告已经基金托管人复核，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配。若分配后出现停牌股票整体变现金额高于基金管理人为其垫付金额等情况，则基金管理人将其差额按基金份额持有人持有的基金份额比例再次进行分配，敬请投资者留意本公司届时发布的有关公告。

六、备查文件

(一)备查文件目录

- 1、《北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金清算审计报告》；
- 2、《北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金清算报告》的法律意见。

(二)存放地点

基金管理人的办公场所。

(三)查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。投资者欲了解本基金的详细情况，请认真阅读本基金基金合同及本基金招募说明书，投资者可通过以下途径咨询：

基金管理人网站：<http://www.bxrfund.com>

客服电话：400-061-7297

北信瑞丰无限互联主题灵活配置混合型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

2018年1月12日