

北信瑞丰增强回报定期开放混合型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

清算报告公告日：二〇一九年六月十七日

一、重要提示

北信瑞丰增强回报定期开放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[2016]第 3043 号《关于准予北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金注册的批复》准予募集,于 2017 年 2 月 20 日成立并正式运作,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《北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)等有关规定,若在开放期最后一日(登记机构完成开放期最后一日申购、赎回业务申请的确认以后)本基金的份额持有人数量不满 200 人,或在开放期最后一日(登记机构完成开放期最后一日申购、赎回业务申请的确认以后)基金资产净值加上当日净申购的基金份额对应的资产净值或减去当日净赎回的基金份额对应的资产净值低于 5000 万元,应终止基金合同并依法履行基金财产清算程序。截至本基金开放期最后一日(2019 年 4 月 4 日)日终,本基金资产净值加上当日净申购的基金份额对应的资产净值或减去当日净赎回的基金份额对应的资产净值为 22,309,281.81 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 2019 年 4 月 8 日在《中国证券报》、《上海证券报》和基金管理人网站(<http://www.bxfund.com>)刊登了《关于北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

自 2019 年 4 月 5 日至 2019 年 4 月 29 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 2019 年 4 月 5 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：北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金(基金简称：北信瑞丰增强回报,基金代码：004165)。

2、基金运作方式：契约型开放式。

3、基金合同生效日：2017 年 2 月 20 日。

4、投资目标：本基金在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的投资收益,追求基金资产的长期稳健增值。

5、投资策略：本基金封闭期与开放期采取不同的投资策略。在封闭期内,主要以资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略等为主。在开放期内,本基金将充分保障开放期的流动性需求,主要投资高流动性的资产,在此基础上追求基金的长期稳定增值。本基金为偏债混合型基金,在债券投资的基础上,通过将部分资金投资于权益类资产争取增强回报。

6、业绩比较基准：中债综合指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%。

7、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。

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：北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2019年4月4日

单位：人民币元

资产负债表 最后运作日

2019年4月4日

资产：

银行存款 30,798,152.47

结算备付金 31,036.32

存出保证金 10,784.35

股票投资 1,096.80

应收利息 24,371.84

资产总计 30,865,441.78

负债：

应付赎回款 4,520,838.02

应付管理人报酬 2,544.31

应付托管费 636.07

应付销售服务费 2,544.31

应付交易费用 33,520.86

应付税费 23,610.91

其他负债 109,257.32

其中：预提费用 109,257.32

负债合计 4,692,951.80

所有者权益：

实收基金 25,140,156.25

未分配利润 1,032,333.73

所有者权益合计 26,172,489.98

负债和所有者权益总计 30,865,441.78

注：

1、报告截止日2019年4月4日（本基金最后运作日），北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金的份额净值为1.0411元，基金份额总额为25,140,156.25份。

2、截止2019年4月4日，还有部分股票未变现，已于2019年4月8日全部变现。

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”的约定：

若在开放期最后一日（登记机构完成开放期最后一日申购、赎回业务申请的确认以后）本基金的份额持有人数量不满200人，或在开放期最后一日（登记机构完成开放期最后一日申购、赎回业务申请的确认以后）基金资产净值加上当日净申购的基金份额对应的资产净值或减去当日净赎回的基金份额对应的资产净值低于5000万元，基金管理人与基金托管人协商一致后，可以终止基金合同并根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会进行表决。

截止本基金开放期最后一日（2019年4月4日）日终，本基金基金资产净值加上当日净申购的基金份额对应的资产净值或减去当日净赎回的基金份额对应的资产净值低于5000万元。为维护基金份额持有人利益，根据基金合同约定，与基金托管人协商一致，不需召开基金份额持有人大会，基金管理人应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《关于北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资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2019年4月5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。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2019年4月5日至2019年4月29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《北信瑞丰增强回报定期开放混合型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。

（二）资产处置情况

截至本基金最后运作日，各项资产处置情况如下：

- 1、结算备付金为人民币31,036.32元，为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项。
- 2、存出保证金为人民币10,784.35元，为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项。
- 3、应收利息为人民币24,371.84元，为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项。
- 4、股票投资市值为人民币1,096.80元，系股票金风科技(代码：002202)1,096.80元。该资产已于2019年4月8日处置完毕，成交总金额为人民币1,073.60元，扣除印花税、经手费、过户费和证管费后，实际收到金额为人民币1,072.44元，已于2019年4月9日划入基金托管账户。

（三）负债清偿情况

截至本基金最后运作日，各项负债清偿情况如下：

- 1、应付赎回款为人民币4,520,838.02元，该款项已于2019年4月8日、2019年4月9日支付。
- 2、应付管理人报酬为人民币2,544.31元，该款项已于2019年4月22日支付。
- 3、应付托管费为人民币636.07元，该款项已于2019年4月22日支付。
- 4、应付销售服务费为人民币2,544.31元，该款项已于2019年4月22日支付。
- 5、应付交易费用为人民币33,520.86元，该款项已于2018年4月17日、2019年4月18日、2019年4月22日、2019年4月23日支付。
- 6、应交税金为人民币23,610.91元，该款项已于2019年4月10日、2019年4月24日支付。

7、其他负债为人民币 109,257.32 元，包括审计费、中证报信息披露费。审计费为人民币 75,451.72 元，根据最新签订的审计业务约定书，本基金需要支付的上年度审计费及本次清算审计费金额合计为人民币 80,000.00 元，已于 2019 年 4 月 23 日支付，少计提的 4,548.28 元确认为清算期间损益；中证报信息披露费为人民币 33,805.60 元，根据最新签订的信息披露费合同，本基金需要支付的中证报信息披露费金额为人民币 30,000.00 元，已于 2019 年 4 月 24 日支付，多计提的 3,805.60 元确认为清算期间损益。

(四)本次清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

资产负债表

自 2019 年 4 月 5 日

至 2019 年 4 月 29 日

止清算期间

一、清算收益

利息收入（注 1） 11,924.54

投资收益（注 2） 123.28

公允价值变动损益 -146.48

清算收入小计 11,901.34

二、清算费用

交易费用（注 3） 1.95

其他费用（注 4） 33,422.36

清算费用小计 33,424.31

三、清算净收益（损失） -21,522.97

表中相关项目具体说明如下：

注 1：利息收入系计提的自 2019 年 4 月 5 日至 2019 年 4 月 29 日止清算期间银行存款、结算备付金、存出保证金利息，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项。

注 2：投资收益系自 2019 年 4 月 5 日至 2019 年 4 月 29 日止清算期间处置未变现股票发生的损益。

注 3：该笔费用为最后运作日未变现股票在 4 月 8 日卖出所产生的交易单元佣金等费用。

注 4：该费用包含银行汇划费 279.68 元，中债登和上清所账户维护费 12,000.00 元，上清所账户查询费 400.00 元，审计费与最后运作日账面计提金额的差额 4,548.28 元，信息披露费与最后运作日账面计提金额的差额-3,805.60 元，律师费 20,000.00 元。

(五)截止本次清算期结束日的剩余财产情况

单位：人民币元

资产负债表 金额

一、最后运作日 2019 年 4 月 4 日基金净资产 26,172,489.98

加：清算期间净收益（损失） -21,522.97

减：最后运作日（2019 年 4 月 4 日）申请，2019 年 4 月 8 日确认的赎回款 3,863,208.17

二、2019 年 4 月 29 日基金资产净值 22,287,758.84

截至本次清算期结束日 2019 年 4 月 29 日，本基金剩余财产为人民币 22,287,758.84 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。

本次清算期结束日次日（2019 年 4 月 30 日）至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息扣除划款手续费后亦属份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速

度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。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。

六、备查文件

(一)备查文件目录

- 1、《北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金清算审计报告》；
- 2、《北信瑞丰增强回报定期开放混合型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

北信瑞丰增强回报定期开放混合型证券投资基金基金财产清算小组

2019年4月29日