

# 北信瑞丰兴瑞灵活配置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：交通银行股份有限公司

清算报告出具日期：2022年5月13日

清算报告公告日期：2022年5月25日

## 一、重要提示

北信瑞丰兴瑞灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会《关于准予北信瑞丰兴瑞灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2017】871号）注册募集，自2017年9月7日起基金合同生效，基金管理人为北信瑞丰基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“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：“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，本基金将根据《基金合同》约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会进行表决。”

本基金基金份额持有人自2021年10月25日起低于200人，截至2022年1月17日日终，已出现连续60个工作日基金份额持有人低于200人的情形。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，基金管理人应终止《基金合同》并依法履行基金财产清算程序。

基金管理人已就该事项于2022年1月18日在《上海证券报》和基金管理人网站（<http://www.bxrfund.com>）刊登了《关于北信瑞丰兴瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及财产清算的公告》。

自2022年1月18日至2022年5月13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、基金托管人交通银行股份有限公司、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2022年1月18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：北信瑞丰兴瑞灵活配置混合型证券投资基金  
(基金简称：北信瑞丰兴瑞灵活配置，基金代码：004829)。
- 2、基金运作方式：契约型开放式。
- 3、基金合同生效日：2017年9月7日。
- 4、投资目标：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。
- 5、投资策略：本基金通过对宏观经济形势与资产市场环境的分析，运用合理稳健的资产配置策略，将基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间灵活配置，把握我国经济增长和资本市场的发展机遇，严格控制下行风险，力争实现基金资产净值的长期稳定增值。
- 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：交通银行股份有限公司。

### 三、财务会计报告

#### 2022年1月17日（基金最后运作日）资产负债表（经审计）

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

会计主体：北信瑞丰兴瑞灵活配置混合型证券投资基金

单位：元

项目	2022年1月17日 (基金最后运作日)
<b>资产：</b>	
银行存款	1,385,830.43
存出保证金	67,489.04
交易性金融资产	2,022,913.25
<b>资产总计</b>	<b>3,476,232.72</b>
<b>负债和所有者权益</b>	
<b>负债：</b>	
应付赎回款	1,190,497.90
应付管理人报酬	828.81
应付托管费	138.14
应付交易费用	—
其他负债	317,969.14
<b>负债合计</b>	<b>1,509,433.99</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	1,196,369.27
未分配利润	770,429.46
<b>所有者权益合计</b>	<b>1,966,798.73</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>3,476,232.72</b>

注：

1. 报告截止日 2022 年 1 月 17 日(基金最后运作日)，基金份额总额 1,196,369.27 份，基金份额净值 1.6440 元。
2. 本财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 1 月 17 日（基金最后运作日）止期间。

## 四、清算事项说明

### (一)清算原因

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“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：

“《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，本基金将根据《基金合同》约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会进行表决。”

本基金基金份额持有人自 2021 年 10 月 25 日起低于 200 人，截至 2022 年 1 月 17 日日终，已出现连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人的情形。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，基金管理人应终止《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《关于北信瑞丰兴瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及财产清算的公告》，本基金清算起始日为 2022 年 1 月 18 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。于 2022 年 1 月 17 日(基金最后运作日)，所有资产以可收回金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。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 2022 年 1 月 18 日至 2022 年 5 月 13 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

根据《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”的约定：“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剩余财产中支付。”

**(二)资产处置情况**

于 2022 年 1 月 17 日（基金最后运作日），本基金资产处置情况如下：

- 1、存出保证金为 67,489.04 元，其中上海存出保证金 31,446.08 元、应计利息 40.51 元，深圳存出保证金 35,956.49 元、应计利息 45.96 元。截至清算期结束日，存出保证金余额为 482.08 元，其中存出保证金应计利息余额为 67.44 元。
- 2、交易性金融资产全部为因认购新发/增发而于期末持有的流通受限股票，其公允价值为 2,022,913.25 元，该金额为各只股票的最后运作日估值金额之和，本基金最后运作日（2022 年 1 月 17 日）持有的股票明细如下：

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	认购 价格	期末成本总额	期末估值 单价	期末估值总额
1	601728	中国电信	394,011	4.53	1,784,869.83	4.23	1,666,666.53
2	688707	振华新材	3,062	11.75	35,978.50	46.92	143,669.04
3	301058	中粮工科	1,354	3.55	4,806.70	21.02	28,461.08
4	301069	凯盛新材	539	5.17	2,786.63	43.90	23,662.10
5	301060	兰卫医学	587	4.17	2,447.79	35.98	21,120.26
6	301050	雷电微力	74	60.64	4,487.36	213.94	15,831.56
7	301046	能辉科技	290	8.34	2,418.60	46.43	13,464.70
8	301078	孩子王	592	5.77	3,415.84	18.79	11,123.68
9	301048	金鹰重工	720	4.13	2,973.60	13.39	9,640.80
10	301062	上海艾录	523	3.31	1,731.13	17.28	9,037.44
11	301052	果麦文化	252	8.11	2,043.72	34.95	8,807.40
12	301055	张小泉	355	6.90	2,449.50	23.38	8,299.90
13	301056	森赫股份	572	3.93	2,247.96	11.36	6,497.92
14	301072	中捷精工	181	7.46	1,350.26	33.29	6,025.49
15	301087	可孚医疗	72	93.09	6,702.48	80.53	5,798.16
16	301073	君亭酒店	144	12.24	1,762.56	39.61	5,703.84
17	300854	中兰环保	203	9.96	2,021.88	27.84	5,651.52
18	301063	海锅股份	153	17.40	2,662.20	35.73	5,466.69
19	301059	金三江	259	8.09	2,095.31	20.45	5,296.55
20	301049	超越科技	174	19.34	3,365.16	29.44	5,122.56
21	301053	远信工业	155	11.87	1,839.85	29.71	4,605.05

22	301068	大地海洋	144	13.98	2,013.12	30.71	4,422.24
23	301057	汇隆新材	218	8.03	1,750.54	20.23	4,410.14
24	301079	邵阳液压	140	11.92	1,668.80	29.49	4,128.60
合计					1,879,889.32		2,022,913.25

截至本财务报表批准报出日(2022年5月13日)止,本基金于基金最后运作日持有的交易性金融资产已全部变现,卖出股票成交总额 1,989,445.72 元,对应股票成本总额 1,879,889.32 元,实现买卖股票差价收入 109,556.40 元。自 2022 年 1 月 18 日本基金进入清算程序起至本财务报表批准报出日(2022 年 5 月 13 日)止期间,本基金无新增股票投资。

### (三) 负债清偿情况

于 2022 年 1 月 17 日(基金最后运作日),本基金负债清偿情况如下:

- 1、应付赎回款为 1,190,497.90 元,该款项已于 2022 年 1 月 18 日、2022 年 1 月 19 日从托管账户划出。
- 2、应付管理人报酬为 828.81 元,该款项已于 2022 年 2 月 8 日支付。
- 3、应付托管费为 138.14 元,该款项已于 2022 年 2 月 8 日支付。
- 4、其他负债为 317,969.14 元,包括应付赎回费、应付交易费用、预提 2021 年度审计费及清算审计费、预提账户维护费、预提 2021 年信息披露费及预提清算律师费。
  - a) 应付赎回费为 894.82 元,该款项已于 2022 年 1 月 18 日、2022 年 1 月 19 日支付;
  - b) 应付交易费用为 95,963.19 元,该款项已于 2022 年 1 月 26 日、2022 年 4 月 27 日支付。
  - c) 预提 2021 年度审计费为 60,000 元,已于 2022 年 4 月 29 日支付;预提清算审计费为 4,722.26 元,根据最终签订的审计业务约定书,本基金需要支付的清算审计费为 5,000.00 元,已于 2022 年 4 月 29 日支付,差额 277.74 元确认为清算期间费用;
  - d) 预提 2021 年 4 季度账户维护费为 9,000 元,已于 2022 年 1 月 18 日支付;预提 2021 年 1 季度账户维护费为 8,500 元,已于 2022 年 1 月 24 日支付 3,000 元,剩余 5,500 元根据缴费通知无需支付,已

于 1 月 24 日冲销；

e) 预提 2021 年信息披露费为 120,000 元，该款项已于 2022 年 4 月 29 日支付；

f) 预提清算律师费为 18,888.87 元，根据最终签订律师聘请合同，本基金需要支付的清算律师费为 20,000.00 元，已于 2022 年 4 月 29 日支付，差额 1,111.13 元确认为清算期间费用。

#### (四)清算期间的清算损益情况

单位：元

项目	自 2022 年 1 月 18 日 至 2022 年 5 月 13 日止清算期间
<b>一、清算期间收益（损失以“-”填列）</b>	
利息收入	3,617.68
投资收益-股票投资收益	109,556.40
公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-143,023.93
其他收入	-
清算期间收益小计	<b>-29,849.85</b>
<b>二、清算期间费用</b>	
交易费用	3,620.79
其他费用	-3,647.36
清算期间费用小计	<b>-26.57</b>
<b>三、清算期间净收益</b>	<b>-29,823.28</b>

注：

1. 利息收入为清算期间计提的银行存款利息、存出保证金利息；
2. 投资收益为清算期持有的限售股流通变现产生的买卖股票差价收入；
3. 公允价值变动损益为清算期持有的限售股在清算期间的公允价值变动；
4. 其他费用为银行汇划费、冲销账户维护费、补提清算审计费及补提清算律师费。

#### (五)截止本次清算期结束日的剩余资产分配情况

单位：元

项目	金额
一、2022 年 1 月 17 日（基金最后运作日）基金净资产	1,966,798.73
加：清算期间净收益	-29,823.28
加：基金净申购金额（于 2022 年 1 月 18 日确认的投资者申购、赎回申请）	198.41
二、2022 年 5 月 13 日（清算期结束日）基金净资产	1,937,173.86

于 2022 年 5 月 13 日（清算期结束日），本基金剩余财产为 1,937,173.86 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扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

自 2022 年 1 月 18 日（清算期起始日）至 2022 年 5 月 13 日（清算期结束日）的银行存款等产生的利息已计入清算期间净收益，自 2022 年 5 月 14 日（清算期结束日次日）至清算款划出前一日的银行存款等产生的利息亦归基金份额持有人所有。为便于及时向基金份额持有人分配剩余财产，基金管理人以自有资金先行垫付划入托管账户，用以垫付应收利息及存出保证金等。基金管理人所垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有，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，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证券监督管理委员会备案并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剩余财产分配。

## **六、备查文件**

### **(一)备查文件目录**

- 1、《北信瑞丰兴瑞灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》；
- 2、《上海源泰律师事务所关于北信瑞丰兴瑞灵活配置混合型证券投资基金清算事宜之法律意见》。

### **(二)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。

### **(三)查阅方式**

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公地址免费查阅，也可登陆基金管理人网站（<http://www.bxrfund.com>）或拨打基金管理人全国统一客户服务电话 400-061-7297 咨询相关情况。

北信瑞丰兴瑞灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2022 年 5 月 13 日