

北信瑞丰鼎丰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：中国建设银行股份有限公司

清算报告出具日期：2022年12月22日

清算报告公告日期：2023年1月19日

一、重要提示

北信瑞丰鼎丰灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2017 年 4 月 1 日证监许可[2017]439 号文注册，并经中国证监会 2019 年 9 月 4 日证监许可[2019]1648 号文变更注册并募集，自 2019 年 11 月 13 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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：“基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产规模低于 2 亿元，本基金应当按照本基金合同约定的程序进行清算并终止，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。”

本基金的基金合同生效日为 2019 年 11 月 13 日，基金合同生效之日起 3 年后的对应日为 2022 年 11 月 13 日。截至 2022 年 11 月 13 日日终，本基金基金资产净值低于 2 亿元人民币，触发上述《基金合同》约定的自动终止情形，基金管理人将终止《基金合同》，并根据相关法律法规、基金合同等规定对本基金进行清算。

基金管理人已就该事项于 2022 年 11 月 14 日在《上海证券报》和基金管理人网站（<http://www.bxrfund.com>）刊登了《关于北信瑞丰鼎丰灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同终止及财产清算的公告》。

自 2022 年 11 月 14 日至 2022 年 12 月 22 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、基金托管人中国建设银行股份有限公司、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 11 月 14 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：北信瑞丰鼎丰灵活配置混合型发起式证券投资基金
(基金简称：北信瑞丰鼎丰，基金代码：004557)。
- 2、基金运作方式：契约型开放式。
- 3、基金合同生效日：2019年11月13日。
- 4、投资目标：本基金通过基金管理人深入的研究，挖掘具有长期投资价值的标的构建投资组合，并通过严格的资产配置策略创造产品收益安全垫，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的稳健回报。
- 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股指期货投资策略组成。
- 6、业绩比较基准：沪深300指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%
- 7、风险收益特征：本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。
- 8、基金管理人：北信瑞丰基金管理有限公司。
- 9、基金托管人：中国建设银行股份有限公司。

三、财务会计报告

2022年11月13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：北信瑞丰鼎丰灵活配置混合型发起式证券投资基金

单位：元

项目	2022年11月13日 (基金最后运作日)
资产：	
银行存款	4,493,524.95
结算备付金	179,544.09
存出保证金	39,110.46
交易性金融资产	23,534,023.88
资产总计	28,246,203.38
负债和所有者权益	
负债：	
应付证券清算款	450.00
应付赎回款	1,054,059.51
应付管理人报酬	15,748.91
应付托管费	2,624.81
应交税费	20.52
其他负债	130,672.35
负债合计	1,203,576.10
所有者权益：	
实收基金	23,817,869.26
未分配利润	3,224,758.02
所有者权益合计	27,042,627.28
负债和所有者权益总计	28,246,203.38

注：

1. 报告截止日 2022 年 11 月 13 日（基金最后运作日），基金份额总额 23,817,869.26 份，基金份额净值 1.1354 元。
2. 本财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 11 月 13 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：

“基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产规模低于 2 亿元，本基金应当按照本基金合同约定的程序进行清算并终止，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。”

本基金的基金合同生效日为 2019 年 11 月 13 日，基金合同生效之日起 3 年后的对应日为 2022 年 11 月 13 日。截至 2022 年 11 月 13 日日终，本基金基金资产净值低于 2 亿元人民币，触发上述《基金合同》约定的自动终止情形，基金管理人将终止《基金合同》，并根据相关法律法规、基金合同等规定对本基金进行清算。

(二)清算起始日

根据《关于北信瑞丰鼎丰灵活配置混合型发起式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 11 月 14 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 11 月 13 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 11 月 14 日至 2022 年 12 月 22 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 11 月 13 日（基金最后运作日），本基金资产处置情况如下：

- 1、清算备付金为 179,544.09 元，其中上海清算备付金 95,504.02 元、应计利息 208.94 元，深圳清算备付金 83,659.59 元、应计利息 171.54 元。截至清算期结束日，清算备付金余额为 59,695.60 元，其中清算备付金应计利息余额为 5.36 元。
- 2、存出保证金为 39,110.46 元，其中上海存出保证金 12,713.99 元、应计利息 31.10 元，深圳存出保证金 26,302.47 元、应计利息 62.90 元。截至清算期结束日，存出保证金余额为 43,736.88 元，其中存出保证金应计利息余额为 3.94 元。
- 3、交易性金融资产中股票投资，其公允价值为 17,341,164.32 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 11 月 13 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	600256	广汇能源	130,000.00	9.63	1,251,615.00	10.7400	1,396,200.00
2	000155	川能动力	49,000.00	19.88	973,895.87	22.0800	1,081,920.00
3	600188	兖矿能源	24,500.00	41.59	1,018,835.22	44.0100	1,078,245.00
4	601225	陕西煤业	50,000.00	20.61	1,030,556.76	20.8900	1,044,500.00
5	600348	华阳股份	54,000.00	18.40	993,425.73	18.3600	991,440.00
6	002128	电投能源	72,000.00	14.16	1,019,395.80	13.1400	946,080.00
7	600546	山煤国际	55,000.00	17.01	935,285.15	16.9200	930,600.00
8	600141	兴发集团	28,700.00	39.13	1,123,029.00	31.2300	896,301.00
9	000968	蓝焰控股	90,000.00	10.14	913,045.95	9.8800	889,200.00
10	000933	神火股份	52,500.00	16.27	854,343.00	16.7200	877,800.00
11	601101	昊华能源	120,000.00	6.97	836,307.69	6.8500	822,000.00
12	000983	山西焦煤	63,900.00	13.51	863,211.60	12.7300	813,447.00
13	002460	赣锋锂业	9,000.00	85.60	770,400.00	88.0000	792,000.00
14	002240	盛新锂能	15,300.00	44.99	688,301.10	47.9600	733,788.00
15	600985	淮北矿业	40,500.00	13.95	564,949.80	14.3100	579,555.00

16	600026	中远海能	30,000.00	17.75	532,619.00	18.4800	554,400.00
17	601699	潞安环能	27,000.00	16.15	436,088.70	17.9000	483,300.00
18	000792	盐湖股份	17,000.00	24.89	423,080.00	25.5200	433,840.00
19	002756	永兴材料	3,000.00	124.65	373,943.21	143.2000	429,600.00
20	002466	天齐锂业	4,000.00	99.10	396,400.00	102.1000	408,400.00
21	601872	招商轮船	54,000.00	7.14	385,560.00	7.2700	392,580.00
22	601898	中煤能源	29,000.00	10.93	316,880.00	9.2500	268,250.00
23	600395	盘江股份	37,000.00	10.00	369,950.00	7.1100	263,070.00
24	600123	兰花科创	16,000.00	15.54	248,640.00	14.3500	229,600.00
25	603130	云中马	256.00	19.72	5,048.32	19.7200	5,048.32
合计					17,324,806.90		17,341,164.32

4、交易性金融资产中债券投资，其公允价值为 6,192,859.56 元，该金额为各只债券的最后运作日估值金额之和，本基金最后运作日（2022 年 11 月 13 日）持有的债券明细如下：

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	128111	中矿转债	2200.00	907.79	1,997,128.74	850.58	1,872,178.66
2	110085	通 22 转 债	14000.00	154.14	2,157,951.77	130.92	1,834,494.03
3	127027	靖远转债	12400.00	142.44	1,766,270.18	128.28	1,596,200.02
4	113025	明泰转债	4000.00	208.89	835,576.48	221.78	889,986.85
合计					6,756,927.17		6,192,859.56

截至本财务报表批准报出日(2022 年 12 月 22 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。

(三)负债清偿情况

于 2022 年 11 月 13 日（基金最后运作日），本基金负债清偿情况如下：

- 1、应付证券清算款为上交所证券清算款 450.00 元，该款项已于 2022 年 11 月 14 日支付。
- 2、应付赎回款为 1,054,059.51 元，该款项已于 2022 年 11 月 14 日、

2022年11月15日从托管账户划出。

- 3、应付管理人报酬为 15,748.91 元，该款项已于 2022 年 12 月 2 日支付。
- 4、应付托管费为 2,624.81 元，该款项已于 2022 年 12 月 2 日支付。
- 5、应交税费为 20.52 元，该款项已于 2022 年 12 月 13 日支付。
- 6、其他负债为 130,672.35 元，包括应付赎回费、应付交易费用、预提 2022 年度审计费及清算审计费、预提 2022 年信息披露费及预提清算律师费。
 - a) 应付赎回费为 1,068.40 元，该款项已于 2022 年 11 月 14 日、2022 年 11 月 15 日支付；
 - b) 应付交易费用为 31,438.09 元，该款项已于 2022 年 12 月 7 日支付。
 - c) 预提 2022 年度审计费为 34,740.03 元，已于 2022 年 12 月 7 日支付；
 - d) 预提 2022 年信息披露费为 43,425.83 元，根据最终签订信息披露服务合同书，本基金需要支付的信息披露费为 43,400.00 元，该款项已于 2022 年 12 月 7 日支付；差值 25.83 元根据合同无需支付，已于 12 月 7 日冲销；
 - e) 预提清算律师费为 20,000.00 元，该款项已于 2022 年 12 月 7 日支付。

(四)清算期间的清算损益情况

单位：元

项目	自 2022 年 11 月 14 日 至 2022 年 12 月 22 日止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入	9,458.24
投资收益-股票投资收益	-698,521.50
投资收益-债券投资收益	-660,800.87
公允价值变动损益（损失以“-”填列）	558,621.75
其他收入	156.74
清算期间收益小计	-791,085.64
二、清算期间费用	
交易费用	30,342.22

税金及附加	0.16
其他费用	183.02
清算期间费用小计	30,525.40
三、清算期间净收益	-821,611.04

注：

1. 利息收入为清算期间计提的银行存款利息、清算备付金利息、存出保证金利息；
2. 公允价值变动损益为清算期持有的股票、债券在清算期间的公允价值变动；
3. 其他收入为赎回费收入；
4. 其他费用为银行汇划费、冲回信息披露费。

(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11月13日（基金最后运作日）基金净资产	27,042,627.28
加：清算期间净收益	-821,611.04
减：基金净赎回金额（于2022年11月14日确认的投资者申购、赎回申请）	125,377.84
二、2022年12月22日（清算期结束日）基金净资产	26,095,638.40

于2022年12月22日（清算期结束日），本基金剩余财产为26,095,638.40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11月14日（清算期起始日）至2022年12月22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12月23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、《北信瑞丰鼎丰灵活配置混合型发起式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鼎丰灵活配置混合型发起式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热线 400-061-7297 咨询相关情况。

北信瑞丰鼎丰灵活配置混合型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2022 年 12 月 22 日