

北信瑞丰尊赢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：华夏银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇一八年六月二十八日

清算报告公告日：二〇一八年八月十日

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

北信瑞丰尊赢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(2017)第 1080 号《关于准予北信瑞丰尊赢定期开放混合型证券投资基金注册的批复》注册募集,自 2017 年 10 月 30 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,基金托管人为华夏银行股份有限公司。

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《北信瑞丰尊赢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(2018 年 6 月 1 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 887.96 万元,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 2018 年 6 月 4 日在《中国证券报》和基金管理人网站(<http://www.bxrfund.com>)刊登了《关于北信瑞丰尊赢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 2018 年 6 月 2 日至 2018 年 6 月 28 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、基金托管人华夏银行股份有限公司、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 2018 年 6 月 2 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：关于北信瑞丰尊赢定期开放混合型证券投资基金
(基金简称：北信瑞丰尊赢定期开放，基金代码：004915)。
- 2、基金运作方式：契约型、定期开放式。
- 3、基金合同生效日：2017年10月30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。
- 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：华夏银行股份有限公司。

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：北信瑞丰尊赢定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2018年6月1日

单位：人民币元

资产负债表	最后运作日 2018年6月1日
资产：	
银行存款	3,472,964.43
结算备付金	319,959.89
存出保证金	24,938.12
债券投资	10,418,062.00
应收证券清算款	9,004,308.90
应收利息	162,438.53
资产合计	23,402,671.87
负债：	
应付赎回款	9,730,850.31
应付管理人报酬	18,760.13
应付托管费	3,126.69
应付交易费用	1,198.59
应付税费	2,414.96
其他负债	65,539.14
其中：应付赎回费	7,238.02
其中：预提费用	58,301.12
负债合计	9,821,889.82
所有者权益：	
实收基金	13,197,263.43
未分配利润	383,518.62
所有者权益合计	13,580,782.05
负债和所有者权益总计	23,402,671.87

注：

1、报告截止日2018年6月1日（本基金最后运作日），北信瑞丰尊赢定期开放混合型证券投资基金的份额净值为1.0291元，基金份额总额为13,197,263.43份。

2、截止2018年6月1日，还有部分债券未变现，已于2018年6月5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（2018 年 6 月 1 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《关于北信瑞丰尊赢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》，本基金清算起始日为 2018 年 6 月 2 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 2018 年 6 月 2 日至 2018 年 6 月 28 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《北信瑞丰尊赢定期开放混合型证券投资基金基金合同》第十九部分“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、 结算备付金为人民币 319,959.89 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 24,938.12 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、 债券投资为人民币 10,418,062.00 元，截至 2018 年 6 月 5 日止已全部卖出，卖出总金额为人民币 10,568,188.32 元，已于 2018 年 6 月 6 日前划入基金托管账户。
- 4、 应收证券清算款为人民币 9,004,308.90 元，已于 2018 年 6 月 4 日划入托管账户。
- 5、 应收利息为人民币 162,438.53 元，已于 2018 年 6 月 21 日前划入基金托管账户。

(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 9,730,850.31 元，该款项已于 2018 年 6 月 5 日支付。
- 2、 应付管理人报酬为人民币 18,760.13 元，该款项已于 2018 年 6 月 4 日、2018 年 6 月 13 日支付。
- 3、 应付托管费为人民币 3,126.69 元，该款项已于 2018 年 6 月 4 日、2018 年 6 月 13 日支付。
- 4、 应付交易费用为人民币 1,198.59 元，该款项已于 2018 年 6 月 14 日、2018 年 6 月 20 日支付。
- 5、 应付税费为人民币 2,414.96 元，该款项已于 2018 年 6 月 13 日、2018 年 6 月 14 日支付。

- 6、其他负债为人民币 65,539.14 元，包括应付赎回费、预提审计费、预提中证报信息披露费等。应付赎回费为人民币 7,238.02 元，该款项已于 2018 年 6 月 5 日支付；审计费为人民币 16,657.68 元，该款项已于 2018 年 6 月 19 日支付；中证报信息披露费为人民币 41,643.44 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 40,000.00 元，已于 2018 年 6 月 13 日支付，多计提的 1,643.44 元确认为清算期间收入。

(四)本次清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2018 年 6 月 2 日 至 2018 年 6 月 28 日 止清算期间
一、清算收益	
利息收入 ^(注 1)	11,783.96
投资收益	-8,326.98
其他收入 ^(注 2)	5,792.59
冲回多计提的信息披露费	1,643.44
清算收入小计	10,893.01
二、清算费用	
清盘律师费	20,000.00
银行间账户维护费 ^(注 3)	9,000.00
补记清算审计费	3,342.32
交易费用 ^(注 4)	165.74
其他费用 ^(注 5)	3.03
清算费用总计	32,511.09
三、清算净收益	-21,618.08

表中相关项目具体说明如下：

注 1：利息收入系债券未变现期间计提的利息收入、最后运作日回购利息收入、自 2018 年 6 月 2 日至 2018 年 6 月 28 日止清算期间银行存款、结算备付金、存出保证金利息；债券利息收入已于 2018 年 6 月 5 日前随债券变现；回购利息收入已于 2018 年 6 月 4 日变现。基金管理人将以自有资金先行垫付银行存款、备付金保证金利息。

注 2：其他收入为赎回费收入。

注 3：中央国债登记结算有限责任公司、上海清算所对开户会员按季收取账户维护费，该笔费用为 2018 年 4 月至 2018 年 6 月（办理销户手续期间）产生的费用，已于 2018 年 6 月 20 日支付。

注 4：交易费用为 2018 年 6 月 4 日、6 月 5 日债券变现产生的交易费用。

注 5：其他费用为债券变现前产生的金融商品利息收入税、附加税，已于 2018 年 6 月 14 日支付。

(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 2018 年 6 月 1 日基金净资产	13,580,782.05
减：2018 年 6 月 4 日赎回款（含应付赎回款、应付赎回费、赎回费收入）	4,701,142.13
加：清算期间净收益	-21,618.08
二、2018 年 6 月 28 日基金资产净值	8,858,021.84

截至本次清算期结束日 2018 年 6 月 28 日，本基金剩余财产为人民币 8,858,021.84 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。

2018 年 6 月 29 日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息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、《北信瑞丰尊赢定期开放混合型证券投资基金清算审计报告》；
- 2、《北信瑞丰尊赢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

北信瑞丰尊赢定期开放混合型证券投资基金

基金财产清算小组

2018年6月28日