
中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金 清算报告

基金管理人：中科沃土基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日期：2020年8月14日

清算报告公告日期：2020年10月19日

一、基金简介

1、基本情况

中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系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]423号)文件批准,由中科沃土基金管理有限公司作为管理人,于2017年5月10日至2017年6月23日向社会公开募集,首次募集资金总额183,824,290.09元,其中募集资金产生利息55,559.82元。本基金募集资金经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审验,并由其出具《验证报告》(安永华明(2017)验字第61247680_G03号)。经向中国证监会备案,本基金基金合同于2017年6月29日正式生效。本基金为发起式证券投资基金,存续期不限定,本基金管理人为中科沃土基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金招募说明书》及《中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、证券公司短期公司债、中期票据、地方政府债、次级债、可转换公司债、可交换公司债、短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、协议存款、通知存款、银行存款和国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等金融工具,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资于股票和权证资产的比例不高于基金资产的20%，其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的3%，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其中，现金不包括结算备付金，存出保证金，应收申购款等。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：10%*沪深300 指数收益率+90%*中债综合指数收益率。本基金从2020年6月30日起进入清算期，基金清算期自2020年6月30日起至2020年7月8日止，并由普华永道会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，北京市盈科（广州）律师事务所对清算报告出具法律意见。

2、清算原因

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》的相关规定及《中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金基金合同》的约定，本基金的基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于两亿元的，基金合同自动终止。

本基金合同生效之日起三年后的对应日为2020年6月29日，截至2020年6月29日日终，本基金的基金资产净值低于2亿元，触发了《基金合同》中约定的合同终止条款，自2020年6月30日进入基金财产清算程序，且无需召开基金份额持有人大会。

3、清算起始日

根据《关于中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金基金财产清

算及基金合同终止的公告》，本基金于2020年6月30日起进入清算期，故本基金清算起始日为2020年6月30日。

二、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。

三、财务报告

资产负债表

会计主体：中科沃土基金管理有限公司

报告截止日：2020年6月29日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2020年6月29日 (基金最后运作日) |
|------------|--------------------------------|
| 资产： | |
| 银行存款 | 8,832,291.99 |
| 结算备付金 | 234,612.31 |
| 存出保证金 | 3,641.16 |
| 交易性金融资产 | 1,174,112.00 |
| 其中：股票投资 | - |
| 债券投资 | 1,174,112.00 |

| | |
|-------------------|----------------------|
| 买入返售金融资产 | 3,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | 1,400,379.73 |
| 应收利息 | 846.87 |
| 资产总计 | 14,645,884.06 |
| 负债和所有者权益 | |
| 负债: | |
| 应付赎回款 | 968,648.72 |
| 应付管理人报酬 | 8,889.22 |
| 应付托管费 | 2,539.80 |
| 应付交易费用 | 1,928.37 |
| 应付税费 | 9.97 |
| 其他负债 | 119,844.25 |
| 负债合计 | 1,101,860.33 |
| 所有者权益: | |
| 实收基金 | 13,406,818.07 |
| 未分配利润 | 137,205.66 |
| 所有者权益合计 | 13,544,023.73 |
| 负债和所有者权益总计 | 14,645,884.06 |

注:

1. 报告截止日2020年6月29日(基金最后运作日), 基金份额净值为1.0102元, 基金份额总额为13,406,818.07份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2020年1月1日至2020年6月29日(基金最后运作日)止期间。

四、清算情况

根据《基金合同》约定，自出现基金合同终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。2020年6月30日为本基金的运作终止日。本基金的清算期间为自2020年6月30日至2020年7月8日止（以下简称“清算期间”）。

清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《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。

2、资产清算情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币234,612.31元。清算期本基金增加结算备付金人民币133,770.31元，其中上海最低备付金账户增加人民币143,042.93元，深圳最低备付金减少人民币9,272.62元。截至清算期结束日结算备付金余额为人民币368,382.62元。

(2) 本基金最后运作日应收利息为人民币846.87元，其中应收银行存款利息人民币750.39元，应收存出保证金利息人民币1.53元，应收备付金利息94.95。清算期间银行存款产生应收利息人民币978.57元，存出保证金产生应收利息人民币 0.34元，应收备付金利息137.16元，应收买入返售利息收入533.01 元。截至清算期结束日，应收利息余额为人民币1,962.94 元。

3、负债清偿情况

本基金最后运作日的应付赎回款为人民币 968,648.72 元，已于清算期内支付。

本基金最后运作日的应付赎回费为人民币 62.76 元，已于清算期内支付。

本基金最后运作日的应付管理人报酬为人民币 8,889.22 元，已于清算期内支付。

本基金最后运作日的应付托管费为人民币 2,539.80 元，已于清算期内支付。

本基金最后运作日的应付交易费用为人民币 1,928.37 元，已于清算期内支付。

本基金最后运作日的应交税费为人民币 9.97 元，已于清算期内支付。

本基金最后运作日其他负债为人民币 119,781.49 元，为审计费、信息披露费已于 2020 年 8 月 13 日前支付完成。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目 | 自2020年6月30日起至2020年7月8日止清算期间 |
|---------------------------|-----------------------------|
| 一、收益 （损失以“-”填列） | 11,475.13 |
| 存款利息收入(注 1) | 1,649.08 |
| 其他收入(注 2) | 9,826.05 |
| 二、费用 | 488.86 |
| 其他费用(注 3) | 488.86 |
| 三、清算净收益 （损失以“-”填列） | 10,986.27 |

注1：存款利息收入系计提的清算期间的银行存款利息、保证金利息及基金在最后运作日买入返售金融资产利息。

注2：其他收入系冲减多预提的审计费及投资者在最后运作日申请赎回所产生的基金赎回费收入。

注3：其他费用系清算期间所产生的银行汇划费以及最后运作日申请赎回所产生的基金赎回费。

5、清算期间资产处置及负债清偿后的剩余资产情况

| 项目 | 金额 |
|------------------------------|---------------|
| 一、最后运作日基金净资产 | 13,544,023.73 |
| 加：清算期间净收益（损失以“-”填列） | 10,986.27 |
| 减：基金净赎回金额（于清算期间确认的最后运作日赎回申请） | 849,054.63 |
| 二、清算结束日基金净资产 | 12,705,955.37 |

6、清算期间资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

| 项目 | 截止到 2020 年 7 月 8 日可分配金额 |
|----------|-------------------------|
| 加 | |
| 银行存款 | 11,191,707.81 |
| 结算备付金 | 368,382.62 |
| 应收利息 | 1,962.94 |
| 总计 | 11,562,053.37 |
| 减 | |
| 预提费用 | 30,210.00 |
| 总计 | 30,210.00 |
| 剩余可分配金额为 | 11,531,843.37 |

1. 根据中国证券登记结算有限责任公司的规定，清算备付金账户

内的资金按市场规则每月调整, 交易保证金账户内的资金按市场规则每月调整, 因此清算备付金账户内的资金以及交易保证金账户内的资金及利息需等中国证券登记结算有限责任公司退款后(备付金退款时间约为合同结束后2个月, 保证金退款时间约为合同结束后7个月)方可清算。为加快清算速度, 管理人先行垫付款项, 待款项回来后返还管理人。

2. 由于中国证券登记结算有限责任公司及中国人民银行结算制度影响, 本计划对应收银行存款利息、应收保证金利息、应收备付金利息尚未正式结清。为加快清算速度, 管理人先行垫付款项, 待款项回来后返还管理人。

7、停止运作后的清算情况说明

本基金于2020年6月30日起进入清算期, 截至2020年7月8日, 经基金管理人以及基金托管人确认, 本基金剩余债券明细如下:

| 债券代码 | 债券名称 | 到期日期 | 原因 | 期末估值单价 | 数量(张) | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
|--------|--------|-------------|------|--------|--------|--------------|--------------|
| 112467 | 16天广01 | 2019年10月27日 | 债券违约 | 16.00 | 73,382 | 6,654,400.78 | 1,174,112.00 |

截至本次清算期结束日(2020年7月8日), 本基金所持上述债券无法兑付。因此待本基金所持该违约债券主体公司发布确定性公告后, 将实际变现金额按基金份额持有人持有的基金份额比例分配给基金

份额持有人。因上述债券变现金额存在不确定性，因而最终有可能无法按照清盘报告中净值予以清盘，实际清盘净值以所持债券实际变现金额为准。

根据本基金的《基金合同》约定以及《关于中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金基金财产清算及基金合同终止的公告》，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。因持有暂时无法变现的证券，本基金将先以已变现基金资产为限进行分配，待全部变现后将进入二次清算程序并进行二次分配。考虑到本基金清算的实际情况，在清算期间产生的律师费用由管理人先行垫付。

本基金的银行存款应收利息均为预计金额，可能与实际发生或支付金额存在差异，支付时以银行实际结算金额为准。清算过程中各项利息及费用与实际结算金额的尾差由管理人承担。

五、备查文件

1、备查文件目录

- (1) 中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金清算审计报告
- (2) 关于《中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金清算报告》的法律意见书

2、存放地点

基金管理人的办公住所

3、查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中科沃土基金管理有限公司

客服电话：400-018-3610

中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金财产清算小组

2020年8月14日