

中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资
基金证券投资基金（原中科沃土沃安债
券型证券投资基金基金转型）
2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：中科沃土基金管理有限公司

基金托管人：广州农村商业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人广州农村商业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

自 2019 年 3 月 18 日起中科沃土沃安债券型证券投资基金正式变更为中科沃土沃安中短期利率债券证券投资基金，原中科沃土沃安债券型证券投资基金报告期自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 17 日止，中科沃土沃安中短期利率债券证券投资基金报告期自 2019 年 3 月 18 日至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况（转型后）.....	6
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	7
2.2 基金产品说明（转型前）.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现（转型后）.....	10
3.2 基金净值表现（转型前）.....	12
§4 管理人报告	15
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	19
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	20
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）	21
6.1 资产负债表.....	21
6.2 利润表.....	22
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
6.4 报表附注.....	24
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）	41
6.1 资产负债表.....	41
6.2 利润表.....	42
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	43
6.4 报表附注.....	44
§7 投资组合报告（转型后）	60
7.1 期末基金资产组合情况.....	60
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	60
7.3 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61

7.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	61
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细	62
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	62
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	62
7.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.10 投资组合报告附注	62
§7 投资组合报告（转型前）	64
7.1 期末基金资产组合情况	64
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	64
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	64
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	67
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细	67
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	67
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	67
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.11 投资组合报告附注	68
§8 基金份额持有人信息（转型后）	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	69
§8 基金份额持有人信息（转型前）	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	71
§9 开放式基金份额变动(转型后)	72
§9 开放式基金份额变动(转型前)	73
§10 重大事件揭示	74
10.1 基金份额持有人大会决议	74
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
10.4 基金投资策略的改变	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	75
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）	75
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）	76
10.9 其他重大事件（转型后）	78
10.9 其他重大事件（转型前）	80
§11 影响投资者决策的其他重要信息	81
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	81
§12 备查文件目录	84
12.1 备查文件目录	84
12.2 存放地点	84
12.3 查阅方式	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金	
基金简称	中科沃土沃安中短利率债券	
基金主代码	004596	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 3 月 18 日	
基金管理人	中科沃土基金管理有限公司	
基金托管人	广州农村商业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	696, 948, 532. 23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中科沃土沃安中短利率 债券 A	中科沃土沃安中短利率 债券 C
下属分级基金的交易代码	004596	007034
报告期末下属分级基金的份额总额	543, 169, 372. 90 份	153, 779, 159. 33 份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	中科沃土沃安债券型证券投资基金
基金简称	中科沃土沃安债券
基金主代码	004596
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 8 月 22 日
基金管理人	中科沃土基金管理有限公司
基金托管人	广州农村商业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	47, 337, 780. 96 份
基金合同存续期	2018 年 8 月 22 日至 2019 年 3 月 17 日

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金通过重点投资中短期利率债券，在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要投资中短期利率债，通过对国内外宏观经济状况、货币政策、市场资金供求情况进行综合分析，主要在剩余期限不超过三年的国债、央行票据、政策性金融债中进行配置和选择。
业绩比较基准	中债 1-3 年政策性金融债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	在严格控制风险的前提下，采取稳健的投资策略，追求资产的长期平稳盈利，尽力满足投资者的稳健理财需求。
投资策略	本基金是以债券资产的投资为主的债券型投资基金，通过债券资产的投资获取平稳收益，并适度参与股票资产的投资以增强回报，投资策略主要包括大类资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股票投资策略等。
业绩比较基准	10%×沪深 300 指数收益率+90%×中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中科沃土基金管理有限公司	广州农村商业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曹萍	卿苗
	联系电话	020-37128608	020-28019512
	电子邮箱	caoping@richlandasm.com.cn	qingmiao@grcbank.com
客户服务电话		400-018-3610	95313
传真		020-23388997	020-28019340
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-5668	广州市黄浦区映日路 9 号
办公地址		广东省广州市天河区珠江西路 5 号 广州国际金融中心 21 楼 01 单元自编 06-08 号	广州市天河区珠江新城华夏路 1 号

邮政编码	510620	510623
法定代表人	朱为绎	王继康

注：本基金管理人于 2019 年 7 月 19 日公告，自 2019 年 7 月 18 日起公司法定代表人已变更为程文卫先生。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.richlandasm.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 21 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中科沃土基金管理有限公司	广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 2107

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	中科沃土沃安中短利率债券 A	中科沃土沃安中短利率债券 C
本期已实现收益	519,188.88	402,298.94
本期利润	591,921.85	253,827.26
加权平均基金份额本期利润	0.0063	0.0022
本期加权平均净值利润率	0.58%	0.20%
本期基金份额净值增长率	0.35%	0.18%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年 6 月 30 日	
期末可供分配利润	41,045,727.66	11,315,867.57
期末可供分配基金份额利润	0.0756	0.0736
期末基金资产净值	587,389,474.49	166,004,463.68
期末基金份额净值	1.0814	1.0795
3.1.3 累计期末指标	2019 年 6 月 30 日	
基金份额累计净值增长率	0.35%	0.18%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 17 日
本期已实现收益	2,835,681.64
本期利润	2,885,658.64
加权平均基金份额本期利润	0.0709
本期加权平均净值利润率	6.92%
本期基金份额净值增长率	7.04%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年 3 月 17 日
期末可供分配利润	3,457,910.12
期末可供分配基金份额利润	0.0730
期末基金资产净值	51,008,337.13

期末基金份额净值	1.0775
3.1.3 累计期末指标	2019 年 3 月 17 日
基金份额累计净值增长率	7.75%

- 注：1. 本基金合同生效日为 2018 年 8 月 22 日，截止 2019 年 3 月 17 日，本基金成立未满 1 年。
2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。
4. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中科沃土沃安中短利率债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.12%	0.01%	0.23%	0.03%	-0.11%	-0.02%
过去三个月	0.24%	0.01%	-0.43%	0.04%	0.67%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.35%	0.01%	-0.31%	0.04%	0.66%	-0.03%

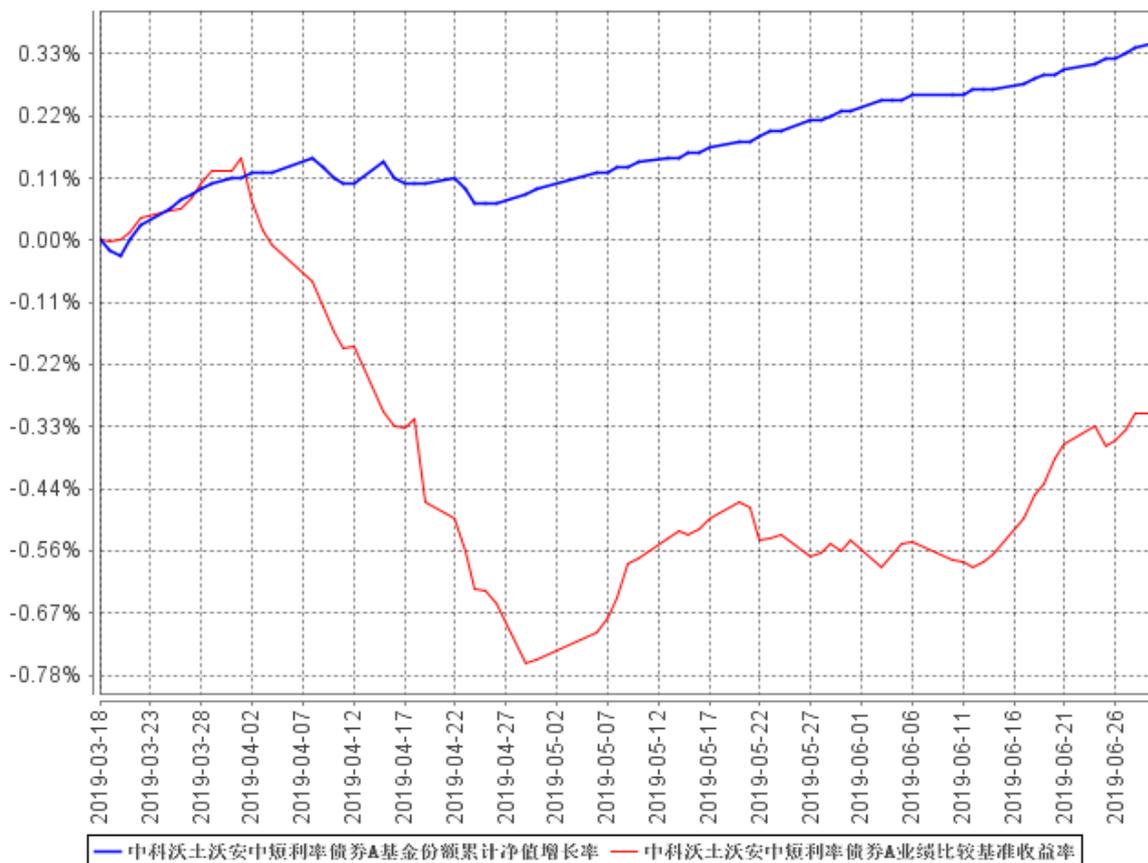
中科沃土沃安中短利率债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.08%	0.01%	0.23%	0.03%	-0.15%	-0.02%
过去三个月	0.06%	0.01%	-0.43%	0.04%	0.49%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.18%	0.01%	-0.31%	0.04%	0.49%	-0.03%

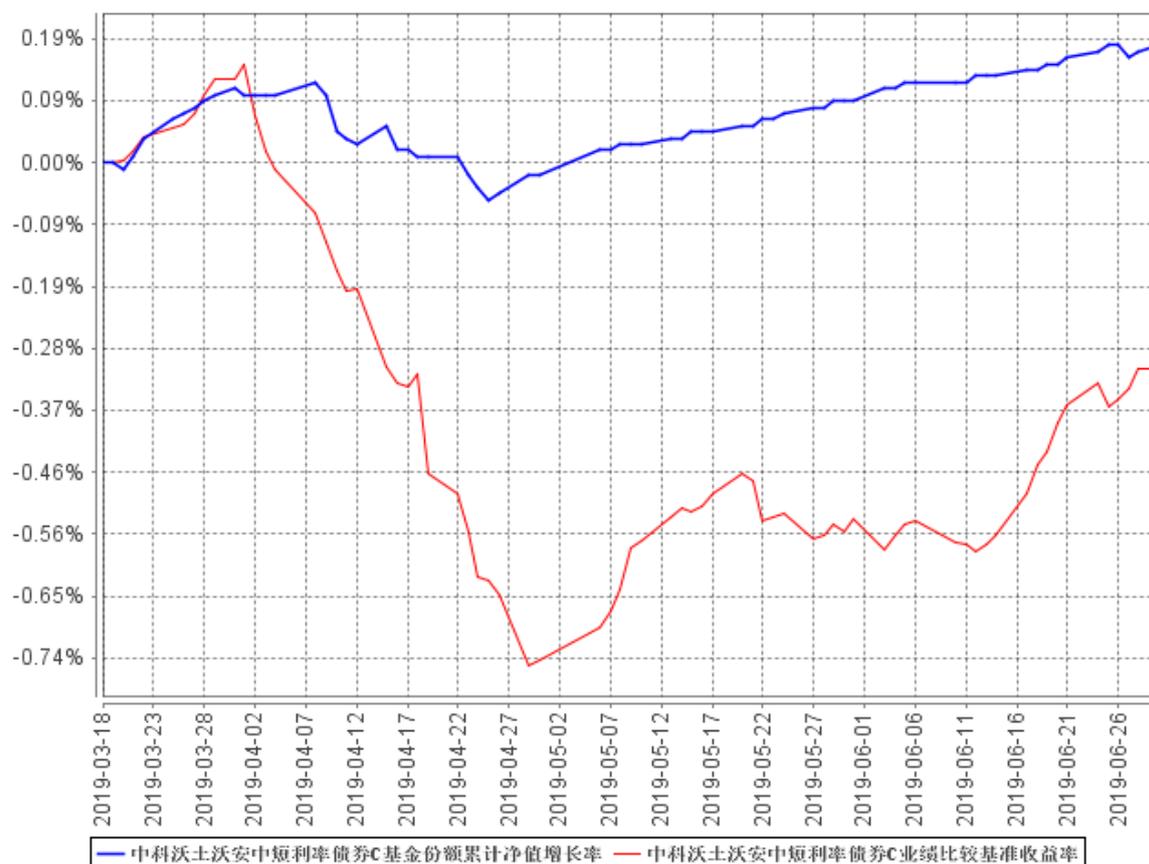
注：中科沃土沃安债券型证券投资基金自 2019 年 3 月 18 日起转型为中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中科沃土沃安中短利率债券A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中科沃土沃安中短利率债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金于 2019 年 3 月 18 日转型而来，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2. 按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

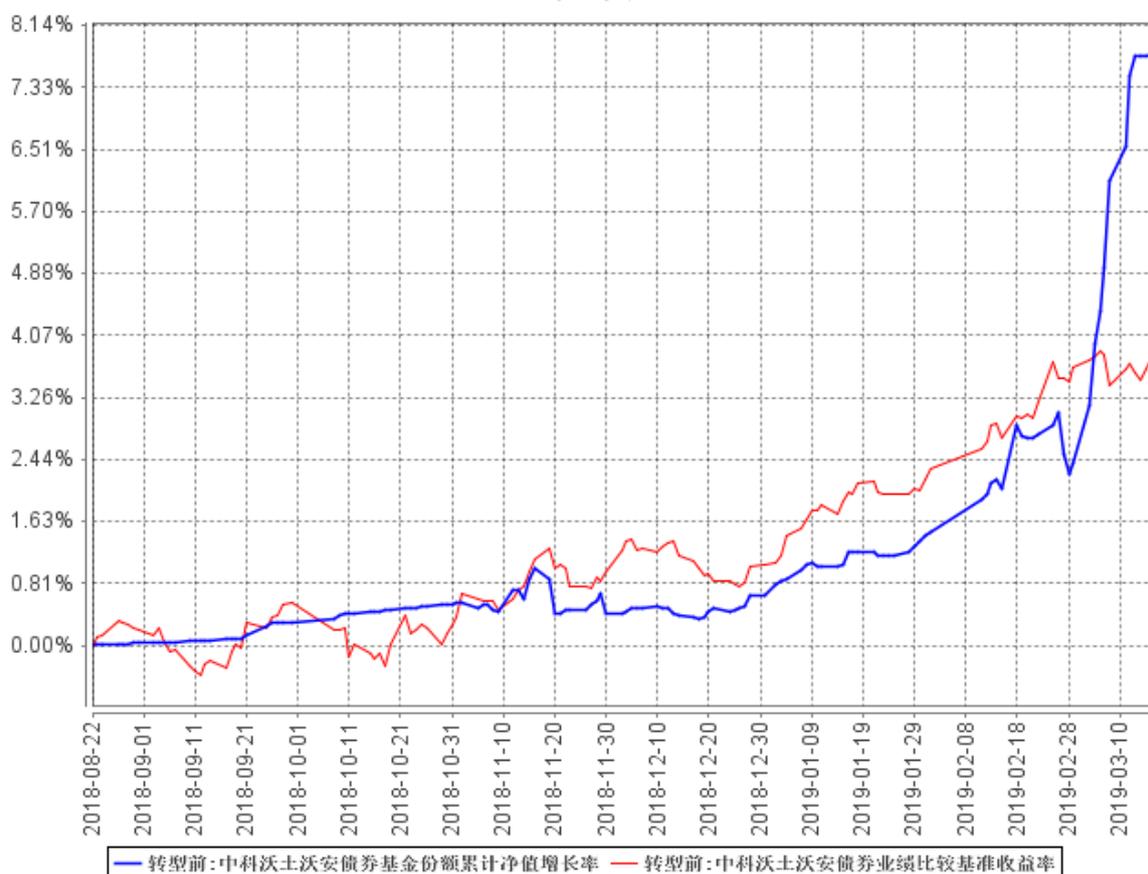
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.58%	0.42%	1.20%	0.18%	4.38%	0.24%
过去三个月	7.35%	0.27%	2.90%	0.14%	4.45%	0.13%
过去六个月	7.66%	0.27%	4.27%	0.15%	3.39%	0.12%
自基金合同生效起至今	7.75%	0.20%	3.92%	0.15%	3.83%	0.05%

注：1. 中科沃土沃安债券型证券投资基金自 2019 年 3 月 18 日起转型为中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金

2. 转型前，“过去三个月”计算期间为 2019 年 3 月 17 日前推 3 个月，即 2018 年 12 月 18 日至 2019 年 3 月 17 日，其他区间依此类推

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中科沃土沃安债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 注：1. 本基金合同于 2018 年 8 月 22 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2. 按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中科沃土基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2015]1937 号文批准，于 2015 年 9 月 6 日正式成立，注册资本 1.42 亿元，是国内第 101 家公募基金管理公司，也是一家拥有 PE 背景的公募基金管理公司。中科沃土带着中科招商、粤科金融等主要股东强大的精神基因和优秀的文化基因，始终贯彻“持有人利益至上”的首要经营准则，遵循诚信、规范、稳健的经营方针，崇尚价值投资理念和长期、平稳、盈利的投资风格，致力于为持有人提供专业、精品、创新的投资理财服务，创造成长价值，汇聚阳光财富。截至 2019 年 6 月 30 日，中科沃土旗下共管理 7 只开放式基金：中科沃土货币市场基金、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金和 中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马洪娟	固定收益部副总经理、基金经理	2019 年 3 月 18 日	-	9 年	金融学博士。曾任金鹰基金管理有限公司研究员、基金经理，现任中科沃土基金管理有限公司固定收益部副总经理、中科沃土货币市场基金、中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金和 中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
乐瑞祺	总经理助理、基金经理	2019 年 3 月 29 日	-	14 年	数量经济学硕士，曾任衡泰软件定量分析师、产品经理，博时基金基金经理助理，民生加银基金基金经理、投资部总监、投委会委员，方圆 360 资产管理有限公司执行总经理、投资经理，第一创

					业证券资产管理部投资总监，现任中科沃土基金管理有限公司总经理助理、中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金、中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金和中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

注：1. 此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，马洪娟的“任职日期”为基金合同生效之日，乐瑞祺的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马洪娟	固定收益部副总经理、基金经理	2018年8月22日	-	9年	金融学博士。曾任金鹰基金管理有限公司研究员、基金经理，现任中科沃土基金管理有限公司固定收益部副总经理、中科沃土货币市场基金、中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金和中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
李昱	副总经理兼任权益投资部总经理、基金经理	2018年8月22日	2019年5月8日	23年	管理学硕士。曾任广发证券股份有限公司环市东营业部业务经理、投资理财部投资经理、资产管理部投资经理，新华基金管理有限公司专户管理部副总监、专户管理部负责人、基金管理部基金经理、基金管理部副总监，中科沃土基金管理有限公司副总经理兼任权益投资部总经理、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、中科沃土转型升

					级灵活配置混合型证券投资基金和中科沃土沃安债券型证券投资基金基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

注：1. 此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，李昱、马洪娟的“任职日期”为基金合同生效之日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3 日内、5 日内），对我司旗下所有投资组合在本报告期的同向交易价差情况进行了分析，根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内债券市场收益率经历了先上后下的过程，整体收益率小幅上行。宏观经济方面，2019 年上半年 GDP 增速 6.3%，经济仍面临较大的下行压力，总体来看，基建投资反弹乏力，地产投资开始走弱，制造业投资持续低迷，进出口前景不明，消费成为稳增长的最重要支撑。通胀方面，猪肉和水果价格的大幅上涨推升了 CPI，也对通胀预期产生了一定的影响，但全年通胀高点或已过。政策方面，积极财政政策仍在推进，但在严控地方债务的前提下后续空间受到了制约。宽信用不断加码，但包商银行事件后续的影响短期难以消除，宽信用效果不佳。资金方面，上半年货币市场利率继续下行，但波动有所加大，包商银行事件导致流动性分层显著加剧。海外方面，美联储降息预期快速形成，海外多国纷纷开启降息周期，全球流动性或将全面宽松。报告期内，利率债方面，十年国债收益率基本走平，十年国开债收益率小幅下行 3bp，从年初的 3.64%下行至 6 月底的 3.61%附近。

报告期内，本基金对利率市场整体保持谨慎，持仓以中短久期的利率债配置为主，未来将根据债券市场变化灵活调整久期，为投资者获取稳健的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 3 月 17 日，中科沃土沃安债券型证券投资基金报告期内（2019 年 1 月 1 日-2019 年 3 月 17 日）份额净值为 1.0755 元，本报告期份额净值增长率为 7.04%，同期业绩比较基准增长率为 3.11%。

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金（中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金）报告期内（2019 年 3 月 18 日-2019 年 6 月 30 日）A 类基金份额净值为 1.0814 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.35%，C 类基金份额净值为 1.0795 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.18%，同期业绩比较基准收益率为-0.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年下半年，基本面方面，我们认为在地产开始走弱同时基建投资难以大幅走高的情况下，3 季度经济下行压力仍大，基本面仍然构成对债市的重要支撑。通胀的年内高点也于二季度展现，未来结构性通胀难以构成债市核心掣肘。海外，贸易战一波三折，未来前景仍难乐观，持久战或难以避免。资金面方面，随着各国央行纷纷降息，全球重回宽松时代，在全球共振式宽松的背景下，我国货币政策料将维持宽松状态，为债市营造良好的货币环境。

本基金在 2019 年下半年将根据市场变化合理调整组合久期以及杠杆水平，力争为投资者获取稳健回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，定期对估值政策和程序进行评价。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

基金日常估值由基金事务部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，提出估值建议，确保估值的公允性。监察风控部负责对基金估值程序和方法进行核查，确保估值相关各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关固定收益品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“（三）基金收益分配原则”的相关规定，本基金本年度未进行利润分配，符合合同规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期，本基金自 2019 年 4 月 29 日至 2019 年 6 月 6 日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求，对基金管理人——中科沃土基金管理有限公司在本基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由本基金管理人——中科沃土基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

6.1 资产负债表

会计主体：中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	2,448,125.53
结算备付金		300,100.52
存出保证金		42,882.24
交易性金融资产	6.4.7.2	379,852,700.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		379,852,700.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	225,982,149.97
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	10,738,096.39
应收股利		-
应收申购款		134,486,140.77
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		753,850,195.42
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		135,340.42
应付管理人报酬		78,524.79
应付托管费		31,409.89
应付销售服务费		32,270.19

应付交易费用	6.4.7.7	50,101.78
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	128,610.18
负债合计		456,257.25
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	696,948,532.23
未分配利润	6.4.7.10	56,445,405.94
所有者权益合计		753,393,938.17
负债和所有者权益总计		753,850,195.42

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0814 元，C 类基金份额净值 1.0795 元；基金份额总额 696,948,532.23 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 543,169,372.90 份，C 类基金份额总额 153,779,159.33 份。

6.2 利润表

会计主体：中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年3月18日(基金合同生效日)至2019 年6月30日
一、收入		1,158,336.48
1. 利息收入		1,715,113.75
其中：存款利息收入	6.4.7.11	147,310.15
债券利息收入		1,080,649.99
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		487,153.61
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-531,231.69
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-531,231.69
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-75,738.71

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	50,193.13
减：二、费用		312,587.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	138,825.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	55,530.36
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	92,913.07
4. 交易费用	6.4.7.19	10,558.19
5. 利息支出		1,723.70
其中：卖出回购金融资产支出		1,723.70
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	13,036.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		845,749.11
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		845,749.11

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金

本报告期：2019年3月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	47,337,780.96	3,670,556.17	51,008,337.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	845,749.11	845,749.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	649,610,751.27	51,929,100.66	701,539,851.93
其中：1. 基金申购款	1,767,747,010.38	140,245,824.72	1,907,992,835.10
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-1,118,136,259.11	-88,316,724.06	-1,206,452,983.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	696,948,532.23	56,445,405.94	753,393,938.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>程文卫</u>	<u>傅军</u>	<u>李茂</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金由中科沃土沃安债券型证券投资基金转型而来。

中科沃土沃安债券型证券投资基金根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予中科沃土沃安债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2017〕504号），由基金发起人中科沃土基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《中科沃土沃安债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）发起募集。本基金募集资金经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)审验，并由其出具《验证报告》（瑞华验字【2018】48090014号）。经向中国证监会备案，本基金基金合同于2018年8月22日正式生效。本基金的基金管理人为中科沃土基金管理有限公司，基金托管人为广州农村商业银行股份有限公司。

自2019年2月13日至2019年3月14日，中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金基金份额持有人大会一通讯方式召开，大会审议并通过了《关于中科沃土沃安债券型证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括审议修改基金名称、基金的申购和赎回、基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制及业绩比较基准、估值方法、基金费用等条款以及因基金转型及法律法规变更而对《基金合同》进行相应修改等事项。持有人大会决议生效并公告后的第一个工作日为本基金转型实施日。《中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金基金合同》自基金转型实施日起生效，《中科沃土沃安债券型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为：国内依法发行上市的国债、央行票据、政策性金融债、债券回购、同业存单、银行存款、现金。本基金不参与股票、权证等资产的投资，同时本基金不投资于公司债、企业债、短期融资券、中期票据等信用债品种以及可转换债券、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 3 月 18 日至 2019 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1. 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税或增值税。

2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	2,448,125.53
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	2,448,125.53

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约				
债券	交易所市场	19,630,800.00	19,667,700.00	36,900.00
	银行间市场	360,187,940.00	360,185,000.00	-2,940.00
	合计	379,818,740.00	379,852,700.00	33,960.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		379,818,740.00	379,852,700.00	33,960.00

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末本基金无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	206,000,000.00	-
银行间市场	19,982,149.97	-
合计	225,982,149.97	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	44,352.44
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	135.00
应收债券利息	10,561,445.98
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	132,143.67
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	19.30
合计	10,738,096.39

6.4.7.6 其他资产

注：本报告期末本基金无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	34,910.07
银行间市场应付交易费用	15,191.71
合计	50,101.78

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	128,610.18
合计	128,610.18

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中科沃土沃安中短利率债券 A		
项目	本期 2019年3月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	47,337,780.96	47,337,780.96
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	572,008,373.44	572,008,373.44
本期赎回(以“-”号填列)	76,176,781.50	76,176,781.50
本期末	543,169,372.90	543,169,372.90

金额单位：人民币元

中科沃土沃安中短利率债券 C		
项目	本期 2019年3月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	-	-

基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	1,195,738,636.94	1,195,738,636.94
本期赎回(以“-”号填列)	-1,041,959,477.61	-1,041,959,477.61
本期末	153,779,159.33	153,779,159.33

注：本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

中科沃土沃安中短利率债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	3,457,910.12	212,646.05	3,670,556.17
本期利润	519,188.88	72,732.97	591,921.85
本期基金份额交易产生的变动数	37,068,628.66	2,888,994.91	39,957,623.57
其中：基金申购款	42,718,774.99	3,251,387.98	45,970,162.97
基金赎回款	-5,650,146.33	-362,393.07	-6,012,539.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,045,727.66	3,174,373.93	44,220,101.59

金额单位：人民币元

中科沃土沃安中短利率债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	402,298.94	-148,471.68	253,827.26
本期基金份额交易产生的变动数	10,913,568.63	1,057,908.46	11,971,477.09
其中：基金申购款	87,862,232.82	6,413,428.93	94,275,661.75
基金赎回款	-76,948,664.19	-5,355,520.47	-82,304,184.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,315,867.57	909,436.78	12,225,304.35

6.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2019年3月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日
活期存款利息收入	96,347.49

定期存款利息收入	49,638.89
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,081.78
其他	241.99
合计	147,310.15

6.4.7.12 股票投资收益

注：本报告期末本基金未持有股票。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月18日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	889,538,264.73
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	874,081,733.19
减：应收利息总额	15,987,763.23
买卖债券差价收入	-531,231.69

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本报告期内本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

注：本报告期内本基金无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年3月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	-75,738.71
——股票投资	-
——债券投资	-75,738.71
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-

2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-75,738.71

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月18日(基金合同生效日)至2019年 6月30日
基金赎回费收入	50,079.20
基金转换费收入	113.93
合计	50,193.13

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月18日(基金合同生效日)至2019年 6月30日
交易所市场交易费用	46.94
银行间市场交易费用	10,511.25
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	10,558.19

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月18日(基金合同生效日)至2019 年6月30日
审计费用	11,636.10
信息披露费	-
账户维护费	1,400.00
合计	13,036.10

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中科沃土基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
广州农村商业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	138,825.95
其中：支付销售机构的客户维护费	26,951.79

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	55,530.36

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.08%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值基金

托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2019 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	中科沃土沃安中短利率债券 A	中科沃土沃安中短利率债券 C	合计
中科沃土基金管理有限公司	-	55,137.49	55,137.49
合计	-	55,137.49	55,137.49

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场（含回购）的交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
广州农村商业银行股份有限公司	2,448,125.53	96,347.49

注：本基金的银行存款由基金托管人广州农村商业银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的证券。

6.4.12.17 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌流通受限股票。

6.4.12.18 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.18.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.18.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资部门负责人和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察风控部、集中交易部和基金事务部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为债券型基金，理论上其风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人通过严格的备选库制度、对交易对手（包括存款银行）、证券发行人的信用评级进行跟踪，和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	361,683,800.00
合计	361,683,800.00

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日
AAA	-
AAA 以下	-
未评级	18,168,900.00
合计	18,168,900.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为剩余期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，监察风控部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2019年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,448,125.53	-	-	-	-	-	2,448,125.53
结算备付金	300,100.52	-	-	-	-	-	300,100.52

存出保证金	42,882.24	-	-	-	-	-	42,882.24
交易性金融资产	70,021,000.00	290,164,000.00	1,498,800.00	18,168,900.00	-	-	-379,852,700.00
买入返售金融资产	225,982,149.97	-	-	-	-	-	-225,982,149.97
应收利息	-	-	-	-	-	10,738,096.39	10,738,096.39
应收申购款	-	-	-	-	-	-134,486,140.77	134,486,140.77
资产总计	298,794,258.26	290,164,000.00	1,498,800.00	18,168,900.00	-	-145,224,237.16	753,850,195.42
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	135,340.42	135,340.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	78,524.79	78,524.79
应付托管费	-	-	-	-	-	31,409.89	31,409.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-	32,270.19	32,270.19
应付交易费用	-	-	-	-	-	50,101.78	50,101.78
其他负债	-	-	-	-	-	128,610.18	128,610.18
负债总计	-	-	-	-	-	456,257.25	456,257.25
利率敏感度缺口	298,794,258.26	290,164,000.00	1,498,800.00	18,168,900.00	-	-144,767,979.91	753,393,938.17

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2019年6月30日）
	利率上升 25 个基点	-162,288.40
	利率下降 25 个基点	162,288.40

注：本基金合同于 2019 年 3 月 18 日生效。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的股

票价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	379,852,700.00	50.42
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	379,852,700.00	50.42

注：本基金合同于 2019 年 3 月 18 日生效。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2019 年 6 月 30 日）
	业绩比较基准上升 5%	14,735.52
	业绩比较基准下降 5%	-14,735.52

注：本基金合同于 2019 年 3 月 18 日生效。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注 6.4.4.5。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为 379,852,700.00 元，无属于第一层级和第三层级的余额（2018 年 12 月 31 日：第二层级 30,803,575.90 元，无属于第一层级和第三层级的余额）。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体：中科沃土沃安债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 3 月 17 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 3 月 17 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	1,772,117.64
结算备付金		412,986.04
存出保证金		47,369.13
交易性金融资产	6.4.7.2	40,857,655.90
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		40,857,655.90
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	6,200,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	742,061.08
应收股利		-
应收申购款		3,116,637.55
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		53,148,827.34
负债和所有者权益		
	附注号	本期末 2019 年 3 月 17 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		200,000.00
应付证券清算款		1,748,678.34
应付赎回款		488.61
应付管理人报酬		14,296.73
应付托管费		2,042.38
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	34,910.07
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	140,074.08
负债合计		2,140,490.21
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	47,337,780.96
未分配利润	6.4.7.10	3,670,556.17
所有者权益合计		51,008,337.13
负债和所有者权益总计		53,148,827.34

注：报告截止日 2019 年 3 月 17 日，基金份额净值 1.0775 元，基金份额总额 47,337,780.96 份。

6.2 利润表

会计主体：中科沃土沃安债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 17 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 17 日
一、收入		3,048,572.20
1. 利息收入		288,729.05
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,962.03
债券利息收入		251,886.82
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		31,880.20
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,709,803.31
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,707,065.81
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	2,737.50
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	49,977.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	62.84
减：二、费用		162,913.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	60,694.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	8,670.65
3. 销售服务费		-

4. 交易费用	6.4.7.19	58,743.12
5. 利息支出		11,230.91
其中：卖出回购金融资产支出		11,230.91
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	23,574.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,885,658.64
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,885,658.64

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中科沃土沃安债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 17 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 17 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	40,426,886.67	266,636.49	40,693,523.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,885,658.64	2,885,658.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	6,910,894.29	518,261.04	7,429,155.33
其中：1. 基金申购款	7,063,134.10	521,507.70	7,584,641.80
2. 基金赎回款	-152,239.81	-3,246.66	-155,486.47
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	47,337,780.96	3,670,556.17	51,008,337.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

程文卫

傅军

李茂

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中科沃土沃安债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予中科沃土沃安债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2017〕504号），由基金发起人中科沃土基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《中科沃土沃安债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）发起募集。本基金募集资金经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并由其出具《验证报告》（瑞华验字【2018】48090014号）。经向中国证监会备案，本基金基金合同于2018年8月22日正式生效。本基金的基金管理人为中科沃土基金管理有限公司，基金托管人为广州农村商业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为：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、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）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2019年3月17日的财务状况以及2019年1月1日至2019年3月17日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税或增值税。

2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

3. 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在收到税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4. 对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 3 月 17 日
活期存款	1,772,117.64
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	1,772,117.64

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 3 月 17 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	20,710,655.90	19,708.71
	银行间市场	20,147,000.00	89,990.00
	合计	40,857,655.90	109,698.71
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	40,747,957.19	40,857,655.90	109,698.71

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末本基金无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019年3月17日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,200,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	6,200,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年3月17日
应收活期存款利息	3,706.20
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,614.24
应收债券利息	735,339.05
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,279.92
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	121.67
合计	742,061.08

6.4.7.6 其他资产

注：本报告期末本基金无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年3月17日
交易所市场应付交易费用	34,910.07
银行间市场应付交易费用	-
合计	34,910.07

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年3月17日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	140,074.08
合计	140,074.08

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年3月17日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	40,426,886.67	40,426,886.67
本期申购	7,063,134.10	7,063,134.10
本期赎回（以“-”号填列）	-152,239.81	-152,239.81
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	47,337,780.96	47,337,780.96

注：本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	202,600.42	64,036.07	266,636.49
本期利润	2,835,681.64	49,977.00	2,885,658.64
本期基金份额交易产生的变动数	419,628.06	98,632.98	518,261.04
其中：基金申购款	421,944.60	99,563.10	521,507.70
基金赎回款	-2,316.54	-930.12	-3,246.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,457,910.12	212,646.05	3,670,556.17

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 17 日
活期存款利息收入	3,353.83
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,498.63
其他	109.57
合计	4,962.03

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 17 日
卖出股票成交总额	23,083,584.00
减：卖出股票成本总额	20,376,518.19
买卖股票差价收入	2,707,065.81

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 17 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交金额	5,763,569.58
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,566,277.00
减：应收利息总额	194,555.08
买卖债券差价收入	2,737.50

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本报告期内本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

注：本报告期内本基金无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 17 日
1. 交易性金融资产	49,977.00
——股票投资	-
——债券投资	49,977.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	49,977.00

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 17 日
基金赎回费收入	62.84
基金转换费收入	-
合计	62.84

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 17 日
交易所市场交易费用	58,743.12
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	58,743.12

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 17 日
审计费用	7,974.08
信息披露费	-17,000.00
其他	25,000.00
账户维护费	7,600.00
合计	23,574.08

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中科沃土基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
广州农村商业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 17 日
当期发生的基金应支付的管理费	60,694.80
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	512.73

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 17 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,670.65

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇

法定节假日、公休日等, 支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注: 本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场(含回购)的交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注: 本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位: 份

关联方名称	本期末 2019年3月17日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例(%)
广州农村商业银行股份有限公司理财	40,003,602.74	84.51%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方 名称	本期 2019年1月1日至2019年3月17日	
	期末余额	当期利息收入
广州农村商业银行股份有限公司	1,772,117.64	3,353.83

注: 本基金的银行存款由基金托管人广州农村商业银行股份有限公司保管, 按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

注: 本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2019年3月17日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注: 截至本报告期末2019年3月17日止, 本基金无因认购新发/增发证券而持有的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

注：截至本报告期末 2019 年 3 月 17 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 3 月 17 日止，本基金未从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 3 月 17 日止，本基金未从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资部门负责人和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察风控部、集中交易部和基金事务部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为债券型基金，理论上其风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人通过严格的备选库制度、对交易对手（包括存款银行）、证券发行人的信用评级进行跟踪，和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

截至 2019 年 3 月 17 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 3 月 17 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	3,883,104.00
合计	3,883,104.00

注：1、债券评级取自第三方机构的项。

2、以上未评级的债券为剩余期限在一年内国政策性金融央行票据超短资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 3 月 17 日
AAA	-
AAA 以下	-
未评级	36,974,551.90
合计	36,974,551.90

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为剩余期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全

覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，监察风控部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2019年3月17 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,772,117.64	-	-	-	-	-	1,772,117.64
结算备付金	412,986.04	-	-	-	-	-	412,986.04
存出保证金	47,369.13	-	-	-	-	-	47,369.13
交易性金融资产	3,883,104.00	-	-	36,974,551.90	-	-	40,857,655.90
买入返售金融资产	6,200,000.00	-	-	-	-	-	6,200,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	742,061.08	742,061.08
应收申购款	-	-	-	-	-	3,116,637.55	3,116,637.55
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	12,315,576.81	-	-	36,974,551.90	-	3,858,698.63	53,148,827.34
负债							
卖出回购金融资产款	200,000.00	-	-	-	-	-	200,000.00
应付证券清算	-	-	-	-	-	1,748,678.34	1,748,678.34

款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	488.61	488.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	14,296.73	14,296.73
应付托管费	-	-	-	-	-	2,042.38	2,042.38
应付交易费用	-	-	-	-	-	34,910.07	34,910.07
其他负债	-	-	-	-	-	140,074.08	140,074.08
负债总计	200,000.00	-	-	-	-	-1,940,490.21	2,140,490.21
利率敏感度缺口	12,115,576.81	-	-	-36,974,551.90	-	-1,918,208.42	51,008,337.13
上年度末 2018年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	968,473.93	-	-	-	-	-	968,473.93
结算备付金	233,521.47	-	-	-	-	-	233,521.47
存出保证金	24,353.25	-	-	-	-	-	24,353.25
交易性金融资产	-	-2,106,720.00	-	28,696,855.90	-	-	-30,803,575.90
买入返售金融资产	8,500,000.00	-	-	-	-	-	8,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	764.38	764.38
应收利息	-	-	-	-	-	384,589.84	384,589.84
资产总计	9,726,348.65	-2,106,720.00	-	-	28,696,855.90	385,354.22	40,915,278.77
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	24,151.89	24,151.89
应付托管费	-	-	-	-	-	3,450.26	3,450.26
应付交易费用	-	-	-	-	-	15,153.46	15,153.46
其他负债	-	-	-	-	-	179,000.00	179,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	221,755.61	221,755.61
利率敏感度缺口	9,726,348.65	-2,106,720.00	-	-	28,696,855.90	163,598.61	40,693,523.16

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年3月17日）	上年度末（2018年12月31日）
	利率上升25个基点	-1,706.14	-135,546.74

利率下降 25 个基点	1,706.14	135,546.74
-------------	----------	------------

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的股票价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年3月17日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	40,857,655.90	80.10	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	40,857,655.90	80.10	-	-

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注 6.4.4.5。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2019 年 3 月 17 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为 40,857,655.90 元，无属于第一层级和第三层级的余额（2018 年 12 月 31 日：第二层级 30,803,575.90 元，无属于第一层级和第三层级的余额）。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告（转型后）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	379,852,700.00	50.39
	其中：债券	379,852,700.00	50.39
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	225,982,149.97	29.98
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,748,226.05	0.36
8	其他各项资产	145,267,119.40	19.27
9	合计	753,850,195.42	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本报告期末本基金未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本报告期末本基金未持有股票。

7.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本报告期末本基金未持有股票。

7.3 报告期内股票投资组合的重大变动

7.3.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本报告期末本基金未持有股票。

7.3.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本报告期末本基金未持有股票。

7.3.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本报告期末本基金未持有股票。

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	101,268,800.00	13.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	278,583,900.00	36.98
	其中：政策性金融债	278,583,900.00	36.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	379,852,700.00	50.42

7.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	120235	12 国开 35	1,200,000	120,252,000.00	15.96
2	180209	18 国开 09	700,000	70,021,000.00	9.29
3	120312	12 进出 12	500,000	50,110,000.00	6.65
4	180018	18 付息国债 18	500,000	50,040,000.00	6.64
5	199921	19 贴现国债 21	500,000	49,730,000.00	6.60

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

注：本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本报告期末本基金未持有贵金属。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本报告期末本基金未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.9.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：（1）本基金本报告期末未持有国债期货。

（2）本基金本报告期内未进行国债期货交易。

7.9.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.10.2 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	42,882.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,738,096.39
5	应收申购款	134,486,140.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	145,267,119.40

7.10.3 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.10.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末本基金未持有股票。

§ 7 投资组合报告（转型前）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,857,655.90	76.87
	其中：债券	40,857,655.90	76.87
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	6,200,000.00	11.67
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,185,103.68	4.11
8	其他资产	3,906,067.76	7.35
9	合计	53,148,827.34	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本报告期末本基金未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本报告期末本基金未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本报告期末本基金未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002241	歌尔股份	1,968,798.00	4.84
2	002124	天邦股份	1,752,515.00	4.31
3	002463	沪电股份	1,530,987.45	3.76
4	300498	温氏股份	1,437,336.00	3.53
5	002157	正邦科技	1,262,295.00	3.10
6	002714	牧原股份	1,233,412.00	3.03
7	600728	佳都科技	1,231,060.00	3.03
8	002567	唐人神	1,120,309.74	2.75
9	600004	白云机场	1,084,954.00	2.67
10	300024	机器人	1,058,975.00	2.60
11	600491	龙元建设	970,827.00	2.39
12	603027	千禾味业	925,363.00	2.27
13	600325	华发股份	704,284.00	1.73
14	600519	贵州茅台	699,890.00	1.72
15	600584	长电科技	635,936.00	1.56
16	002925	盈趣科技	577,994.00	1.42
17	002384	东山精密	577,141.00	1.42
18	002475	立讯精密	517,200.00	1.27
19	002230	科大讯飞	433,271.00	1.06
20	002896	中大力德	331,970.00	0.82

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002124	天邦股份	2,636,883.24	6.48
2	002241	歌尔股份	2,003,522.00	4.92
3	002463	沪电股份	1,663,701.00	4.09

4	002567	唐人神	1,658,375.00	4.08
5	300498	温氏股份	1,486,250.00	3.65
6	002714	牧原股份	1,467,200.00	3.61
7	002157	正邦科技	1,437,752.50	3.53
8	600728	佳都科技	1,397,000.00	3.43
9	600004	白云机场	1,195,043.36	2.94
10	300024	机器人	1,158,100.00	2.85
11	600491	龙元建设	1,014,000.00	2.49
12	603027	千禾味业	930,565.00	2.29
13	600519	贵州茅台	730,832.70	1.80
14	600325	华发股份	727,458.00	1.79
15	002384	东山精密	717,500.00	1.76
16	600584	长电科技	630,200.00	1.55
17	002925	盈趣科技	569,200.00	1.40
18	002475	立讯精密	553,386.20	1.36
19	002230	科大讯飞	423,008.00	1.04
20	300607	拓斯达	350,341.00	0.86

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	20,376,518.19
卖出股票收入（成交）总额	23,083,584.00

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,122,000.00	8.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	36,735,655.90	72.02
	其中：政策性金融债	36,735,655.90	72.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	40,857,655.90	80.10

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018007	国开 1801	125,810	12,705,551.90	24.91
2	180212	18 国开 12	100,000	10,123,000.00	19.85
3	180412	18 农发 12	100,000	10,024,000.00	19.65
4	010107	21 国债 (7)	40,000	4,122,000.00	8.08
5	018005	国开 1701	38,800	3,883,104.00	7.61

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

注：本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本报告期末本基金未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本报告期末本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：（1）本基金本报告期末未持有国债期货。

（2）本基金本报告期内未进行国债期货交易。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	47,369.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	742,061.08
5	应收申购款	3,116,637.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,906,067.76

7.11.3 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末本基金未持有股票。

§ 8 基金份额持有人信息（转型后）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中科沃土沃安中短利率债券 A	894	607,572.01	522,931,214.21	96.27%	20,238,158.69	3.73%
中科沃土沃安中短利率债券 C	55	2,795,984.72	19,008,185.61	12.36%	134,770,973.72	87.64%
合计	949	734,403.09	541,939,399.82	77.76%	155,009,132.41	22.24%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中科沃土沃安中短利率债券 A	78,064.14	0.0144%
	中科沃土沃安中短利率债券 C	19,136.73	0.0124%
	合计	97,200.87	0.0000%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
----	------	--------------------

本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持 有本开放式基金	中科沃土沃安中短利率债券 A	0~10
	中科沃土沃安中短利率债券 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开 放式基金	中科沃土沃安中短利率债券 A	0~10
	中科沃土沃安中短利率债券 C	0
	合计	0~10

§ 8 基金份额持有人信息（转型前）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
332	142,583.68	40,003,602.74	84.51%	7,334,178.22	15.49%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	58,660.86	0.1239%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

项目	中科沃土沃安中 短利率债券 A	中科沃土沃安中 短利率债券 C
基金合同生效日基金份额总额	47,337,780.96	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	572,008,373.44	1,195,738,636.94
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	76,176,781.50	1,041,959,477.61
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	543,169,372.90	153,779,159.33

§ 9 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	-
本报告期期初基金份额总额	40,426,886.67
本报告期期间基金总申购份额	7,063,134.10
减:本报告期期间基金总赎回份额	152,239.81
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	47,337,780.96

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

2019 年 3 月 15 日，中科沃土沃安债券型证券投资基金基金份额持有人大会进行决议，同意《关于中科沃土沃安债券型证券投资基金转型有关事项的议案》。中科沃土沃安债券型证券投资基金变更注册为中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2019 年 4 月 23 日发布公告，胡冬辉女士自 4 月 19 日起担任公司董事长，朱为绎先生自 4 月 19 日起不再担任公司董事长。本基金管理人于 5 月 30 日发布公告，李昱女士自 5 月 28 日起不再担任公司副总经理。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金进行转型，基金投资策略变更后内容如下所示：

1、资产配置策略

本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。

2、债券投资策略

本基金以中短期利率债为主要投资标的。本基金债券投资将采取利率预期与久期管理策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略。

（1）利率预期与久期管理策略

本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化，对 GDP、CPI、国际收支等引起利率变化的相关因素进行深入的研究，分析宏观经济运行的可能情景，并在此基础上判断包括财政政策、货币

政策在内的宏观经济政策取向，对市场利率水平和收益率曲线未来的变化趋势做出预测和判断，结合债券市场资金供求结构及变化趋势，确定固定收益类资产的久期配置。

当预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。以达到利用市场利率的波动和债券组合久期的调整提高债券组合收益率目的。

(2) 收益率曲线策略

收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，即通过对收益率曲线形状变化的预测，适时采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合，并进行动态调整。

(3) 骑乘策略

本基金应用骑乘策略，基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整。当收益率曲线比较陡峭时，即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平相对较高的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券收益率的下滑来获得资本利得收益。

(4) 息差策略

本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资收益的目的。该策略是指在回购利率低于债券收益率的情形下，通过正回购将所获得的资金投资于债券，利用杠杆放大债券投资的收益。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、基金托管人及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程：

- (1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。
- (2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	45,796,611.00	100.00%	509,300,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	30,582,689.13	70.37%	22,365.10	70.37%	-
国泰君安	1	12,877,413.06	29.63%	9,417.37	29.63%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	21,139,394.50	100.00%	146,700,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程：

- (1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。
- (2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

10.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中科沃土基金管理有限公司关于新增国融证券为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019年3月19日
2	中科沃土基金管理有限公司关于新增植信基金为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019年3月19日
3	中科沃土基金管理有限公司关于新增银河证券为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019年3月20日
4	中科沃土基金管理有限公司关于新增国金证券为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019年3月21日
5	中科沃土基金管理有限公司关于旗下基金开通转换业务的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019年3月26日
6	中科沃土基金管理有限公司关于新增陆金所为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019年3月28日
7	关于中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金的基金经理变更公告	中国证券报及基金管理人网站	2019年3月29日
8	中科沃土基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019年4月1日
9	中科沃土基金管理有限公司关于新增广州农商行为旗下部分	中国证券报及基金管理人网站	2019年4月8日

	基金销售机构的公告		
10	中科沃土基金管理有限公司关于新增长城证券为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 4 月 8 日
11	中科沃土基金管理有限公司关于新增基煜基金为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 4 月 19 日
12	中科沃土基金管理有限公司关于新增江海证券为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 4 月 23 日
13	中科沃土基金管理有限公司关于新增泰诚财富为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 4 月 26 日
14	关于中科沃土沃安债券型证券投资基金的基金经理变更公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 5 月 8 日
15	中科沃土基金管理有限公司关于新增信诚基金为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 5 月 10 日
16	中科沃土基金管理有限公司关于新增唐鼎耀华为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 5 月 24 日
17	中科沃土基金管理有限公司关于新增利得基金为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 6 月 4 日
18	中科沃土基金管理有限公司关于新增阳光人寿为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 6 月 6 日
19	中科沃土基金管理有限公司关于新增诺亚正行为旗下部分基	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 6 月 12 日

	金销售机构的公告		
20	中科沃土基金管理有限公司关于新增前海财厚为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 6 月 14 日

10.9 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中科沃土基金管理有限公司关于旗下基金 2018 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 1 月 2 日
2	中科沃土基金管理有限公司关于以通讯方式召开中科沃土沃安债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 2 月 13 日
3	中科沃土基金管理有限公司关于以通讯方式召开中科沃土沃安债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 2 月 14 日
4	中科沃土基金管理有限公司关于以通讯方式召开中科沃土沃安债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 2 月 15 日
5	中科沃土沃安债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 3 月 16 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019 年 4 月 10 日至 2019 年 4 月 28 日	27,816,411.68	-	27,816,411.68	-	-
	2	2019 年 4 月 8 日至 2019 年 4 月 8 日	92,712,775.82	-	92,712,775.82	-	-
	3	2019 年 6 月 13 日至 2019 年 6 月 16 日	-	92,548,819.99	-	92,548,819.99	13.28%
	4	2019 年 6 月 6 日至 2019 年 6 月 12 日	-	37,049,849.45	-	37,049,849.45	5.32%
	5	2019 年 6 月 13 日	-	185,098,565.48	-	185,098,565.48	26.56%

		至 2019 年6月 19日 和 2019 年6月 27日 至 2019 年6月 30日					
	6	2019 年6月 10日 至 2019 年6月 12日	-	18,537,399.20	18,533,000.00	4,399.20	0.00%
	7	2019 年6月 20日 至 2019 年6月 26日	-	463,306,152.71	463,306,152.71	-	-
	8	2019 年1月 1日至 2019 年3月 26日	-	27,816,411.68	27,816,411.68	-	-
个人	1	2019 年4月 10日 至 2019 年4月 11日	37,119,524.87	-	37,119,524.87	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予中科沃土沃安债券型证券投资基金募集的文件；
2. 《中科沃土沃安债券型证券投资基金基金合同》《中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《中科沃土沃安债券型证券投资基金托管协议》《中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
5. 基金托管人业务资格批件、营业执照；
6. 关于申请募集注册中科沃土沃安债券型证券投资基金之法律意见书；
7. 中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 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。

中科沃土基金管理有限公司

2019 年 8 月 26 日