

中科沃土货币市场基金 2017 年第 3 季度报告

2017 年 9 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

报告送出日期：2017 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2017 年 10 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中科沃土货币
基金主代码	002646
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 6 月 6 日
报告期末基金份额总额	503,444,784.54 份
投资目标	在综合考虑基金资产收益性、安全性和流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争获取超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金将在深入研究国内外宏观经济、货币政策、通货膨胀、信用状态等因素的基础上，分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势，并综合考虑各类投资品种的流动性、风险性和收益性，决定基金资产在银行存款及同业存单、债券回购、利率债、信用债、资产支持证券等各类资产的配置比例以及投资组合的平均剩余期限，并适时进行动态调整，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。具体投资策略包括资产配置策略、久期策略、流动性管理策略、银行存款及同业存单投资策略、债券回购投资策略、利率债品种的投资策略、信用债品种的投资策略等投资管理策略。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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

下属分级基金的基金简称	中科沃土货币 A	中科沃土货币 B
下属分级基金的交易代码	002646	002647
报告期末下属分级基金的份额总额	36,266,673.27 份	467,178,111.27 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017 年 7 月 1 日 — 2017 年 9 月 30 日）	
	中科沃土货币 A	中科沃土货币 B
1. 本期已实现收益	336,614.27	4,800,331.83
2. 本期利润	336,614.27	4,800,331.83
3. 期末基金资产净值	36,266,673.27	467,178,111.27

注：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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中科沃土货币 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.9573%	0.0002%	0.3450%	0.0000%	0.6123%	0.0002%

注：本基金收益分配按日结转。

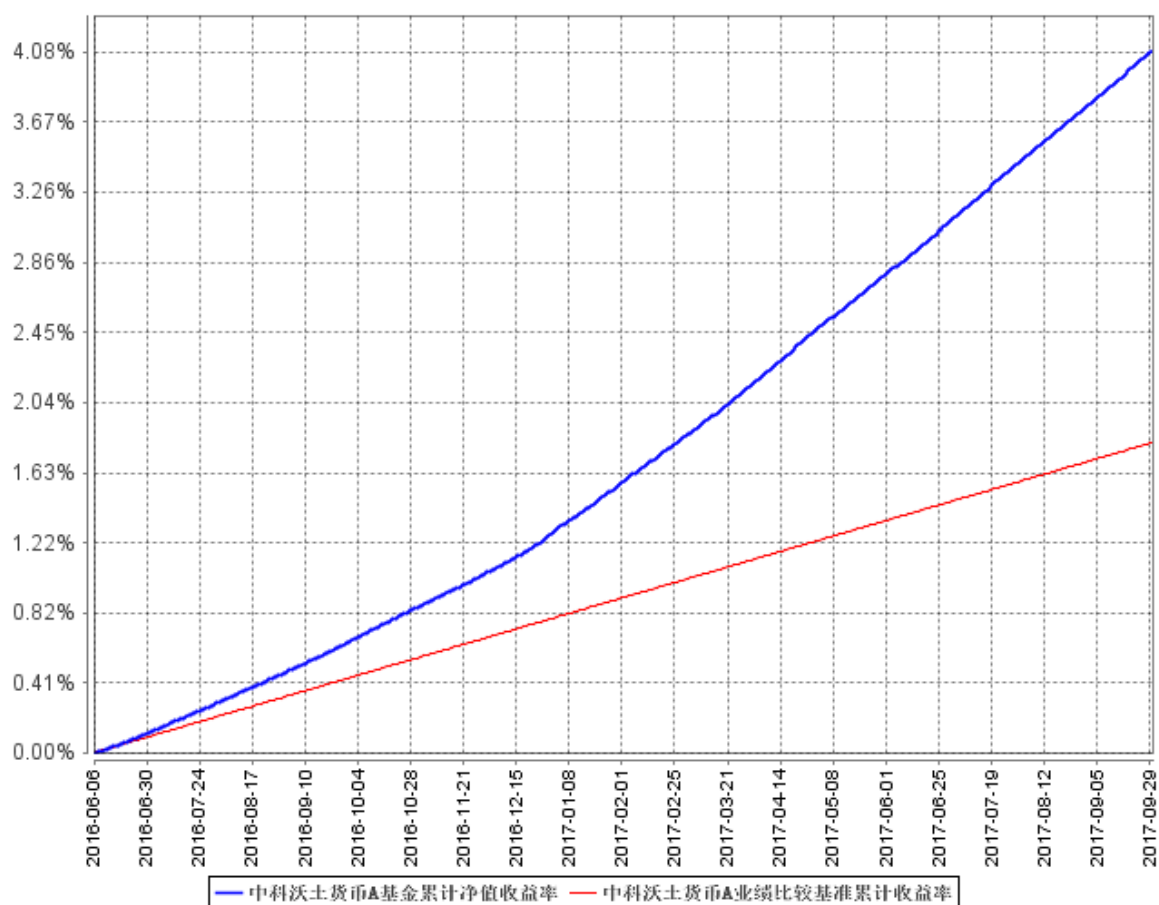
中科沃土货币 B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	1.0183%	0.0002%	0.3450%	0.0000%	0.6733%	0.0002%

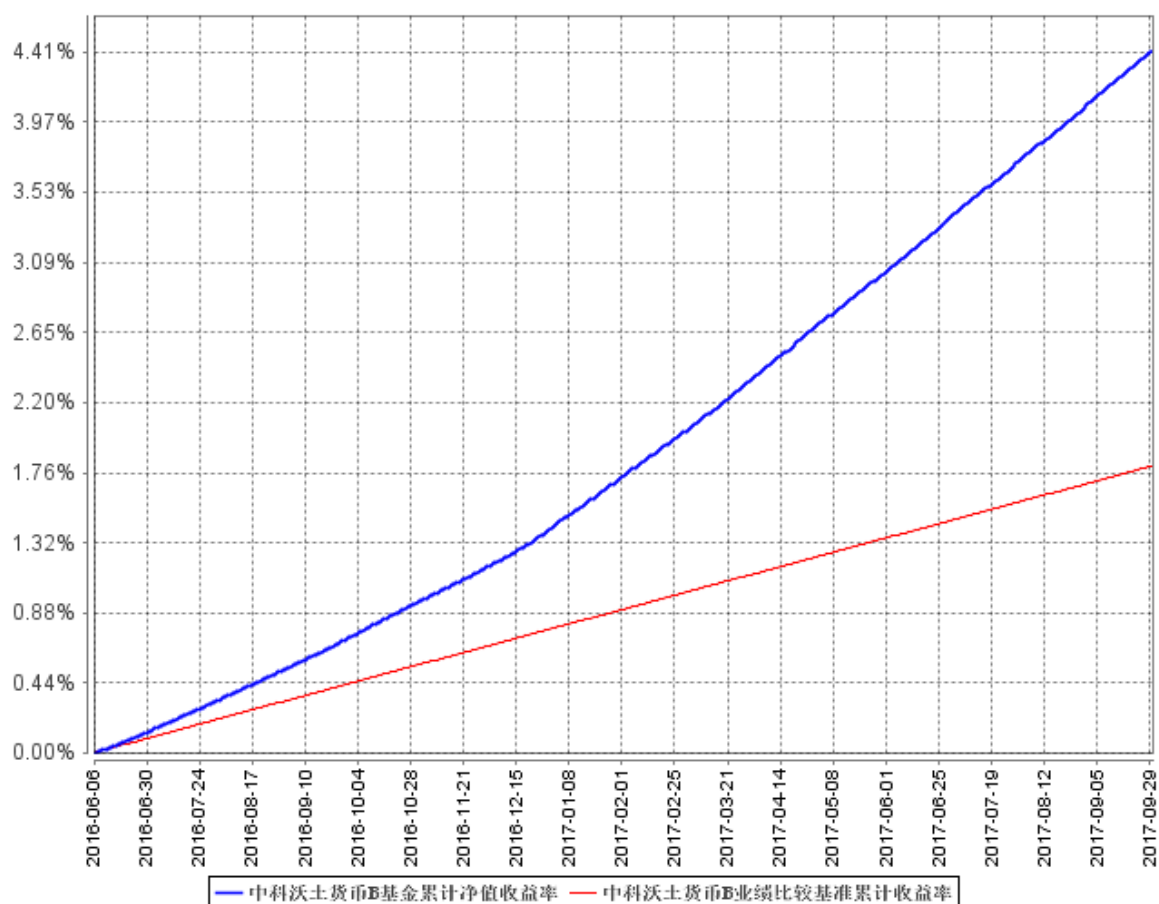
注：本基金收益分配按日结转。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中科沃土货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中科沃土货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2016 年 6 月 6 日生效，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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2016年6月6日	—	7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和中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本季度内货币政策仍维持稳健中性状态，资金价格较二季度略有抬升。临近季末，受超储率处于历史低位的影响，叠加 MPA 考核及缴税的影响，资金价格大幅上行，然而各银行的同业存单发行价格虽然创出了季内高点，但相对于二季度的高点相差较大。同时，随着《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的发布，各大公募机构纷纷提前实行新规，私募类证券资管产品的融资成本进一步提升，市场分层更为明显。

报告期内，本基金在资产配置上以高等级的同业存单、存款和回购为主，抓住资金利率较高的时点提升组合收益率。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期中科沃土货币 A 的基金份额净值收益率为 0.9573%，本报告期中科沃土货币 B 的基金份额净值收益率为 1.0183%，同期业绩比较基准收益率为 0.3450%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日以上基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	228,171,964.03	45.28
	其中：债券	228,171,964.03	45.28
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	98,031,627.05	19.45
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
3	银行存款和结算备付金合计	176,374,939.04	35.00
4	其他资产	1,366,004.16	0.27
5	合计	503,944,534.28	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	0.78	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	—	—
	其中：买断式回购融资	—	—

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	74
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	78
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	37

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金未出现投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	30.99	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	2.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	55.02	-
4	90 天(含)-120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	11.13	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.52	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金未出现投资组合平均剩余期限超过 240 天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,017,330.20	5.96
	其中：政策性金融债	30,017,330.20	5.96
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	198,154,633.83	39.36
8	其他	-	-
9	合计	228,171,964.03	45.32
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	111707239	17 招商银行 CD239	500,000	49,564,452.18	9.85
2	111708299	17 中信银行 CD299	500,000	49,555,223.43	9.84
3	111709259	17 浦发银行 CD259	500,000	49,520,520.46	9.84
4	111711268	17 平安银行 CD268	500,000	49,514,437.76	9.84
5	170308	17 进口 08	300,000	30,017,330.20	5.96

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0495%
报告期内偏离度的最低值	-0.0150%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0202%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本基金不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金采用“摊余成本法”计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,365,564.09
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	440.07
7	其他	-
8	合计	1,366,004.16

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中科沃土货币 A	中科沃土货币 B
报告期期初基金份额总额	32,808,031.03	410,770,128.39
报告期期间基金总申购份额	20,513,444.46	271,863,029.26
报告期期间基金总赎回份额	17,054,802.22	215,455,046.38
报告期期末基金份额总额	36,266,673.27	467,178,111.27

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2017 年 7 月 7 日	4,000,000.00	4,000,000.00	0.00%
2	赎回	2017 年 8 月 10 日	-3,000,000.00	-3,000,000.00	0.00%
3	赎回	2017 年 9 月 8 日	-2,000,000.00	-2,000,000.00	0.00%
4	红利再投资	2017 年 7 月 3 日	4,061.91	4,061.91	0.00%
5	红利再投资	2017 年 7 月 4 日	1,362.06	1,362.06	0.00%
6	红利再投资	2017 年 7 月 5 日	1,360.32	1,360.32	0.00%
7	红利再投资	2017 年 7 月 6 日	1,322.18	1,322.18	0.00%
8	红利再投资	2017 年 7 月 7 日	1,322.36	1,322.36	0.00%
9	红利再投资	2017 年 7 月 10 日	5,290.72	5,290.72	0.00%
10	红利再投资	2017 年 7 月 11 日	1,756.65	1,756.65	0.00%
11	红利再投资	2017 年 7 月 12 日	1,752.57	1,752.57	0.00%
12	红利再投资	2017 年 7 月 13 日	1,758.75	1,758.75	0.00%
13	红利再投资	2017 年 7 月 14 日	1,750.63	1,750.63	0.00%

14	红利再投资	2017 年 7 月 17 日	5,320.91	5,320.91	0.00%
15	红利再投资	2017 年 7 月 18 日	1,764.96	1,764.96	0.00%
16	红利再投资	2017 年 7 月 19 日	1,750.07	1,750.07	0.00%
17	红利再投资	2017 年 7 月 20 日	1,777.69	1,777.69	0.00%
18	红利再投资	2017 年 7 月 21 日	1,778.50	1,778.50	0.00%
19	红利再投资	2017 年 7 月 24 日	5,270.67	5,270.67	0.00%
20	红利再投资	2017 年 7 月 25 日	1,744.36	1,744.36	0.00%
21	红利再投资	2017 年 7 月 26 日	1,739.92	1,739.92	0.00%
22	红利再投资	2017 年 7 月 27 日	1,751.57	1,751.57	0.00%
23	红利再投资	2017 年 7 月 28 日	1,820.40	1,820.40	0.00%
24	红利再投资	2017 年 7 月 31 日	5,472.74	5,472.74	0.00%
25	红利再投资	2017 年 8 月 1 日	1,834.32	1,834.32	0.00%
26	红利再投资	2017 年 8 月 2 日	1,818.35	1,818.35	0.00%
27	红利再投资	2017 年 8 月 3 日	1,818.39	1,818.39	0.00%
28	红利再投资	2017 年 8 月 4 日	1,796.74	1,796.74	0.00%
29	红利再投资	2017 年 8 月 7 日	5,336.81	5,336.81	0.00%
30	红利再投资	2017 年 8 月 8 日	1,747.87	1,747.87	0.00%
31	红利再投资	2017 年 8 月 9 日	1,738.79	1,738.79	0.00%
32	红利再投资	2017 年 8 月 10 日	1,749.72	1,749.72	0.00%
33	红利再投资	2017 年 8 月 11 日	1,419.94	1,419.94	0.00%
34	红利再投资	2017 年 8 月 14 日	4,193.62	4,193.62	0.00%
35	红利再投资	2017 年 8 月 15 日	1,401.13	1,401.13	0.00%
36	红利再投资	2017 年 8 月 16 日	1,412.05	1,412.05	0.00%
37	红利再投资	2017 年 8 月 17 日	1,413.10	1,413.10	0.00%
38	红利再投资	2017 年 8 月 18 日	1,448.30	1,448.30	0.00%
39	红利再投资	2017 年 8 月 21 日	4,368.96	4,368.96	0.00%
40	红利再投资	2017 年 8 月 22 日	1,465.68	1,465.68	0.00%
41	红利再投资	2017 年 8 月 23 日	1,472.12	1,472.12	0.00%
42	红利再投资	2017 年 8 月 24 日	1,475.16	1,475.16	0.00%
43	红利再投资	2017 年 8 月 25 日	1,489.68	1,489.68	0.00%
44	红利再投资	2017 年 8 月 28 日	4,356.53	4,356.53	0.00%
45	红利再投资	2017 年 8 月 29 日	1,443.55	1,443.55	0.00%
46	红利再投资	2017 年 8 月 30 日	1,465.66	1,465.66	0.00%
47	红利再投资	2017 年 8 月 31 日	1,485.85	1,485.85	0.00%
48	红利再投资	2017 年 9 月 1 日	1,486.13	1,486.13	0.00%
49	红利再投资	2017 年 9 月 4 日	4,457.27	4,457.27	0.00%
50	红利再投资	2017 年 9 月 5 日	1,485.83	1,485.83	0.00%
51	红利再投资	2017 年 9 月 6 日	1,468.38	1,468.38	0.00%
52	红利再投资	2017 年 9 月 7 日	1,468.31	1,468.31	0.00%
53	红利再投资	2017 年 9 月 8 日	1,413.63	1,413.63	0.00%

54	红利再投资	2017 年 9 月 11 日	3,611.68	3,611.68	0.00%
55	红利再投资	2017 年 9 月 12 日	1,209.39	1,209.39	0.00%
56	红利再投资	2017 年 9 月 13 日	1,247.06	1,247.06	0.00%
57	红利再投资	2017 年 9 月 14 日	1,275.31	1,275.31	0.00%
58	红利再投资	2017 年 9 月 15 日	1,247.31	1,247.31	0.00%
59	红利再投资	2017 年 9 月 18 日	3,717.84	3,717.84	0.00%
60	红利再投资	2017 年 9 月 19 日	1,239.37	1,239.37	0.00%
61	红利再投资	2017 年 9 月 20 日	1,245.91	1,245.91	0.00%
62	红利再投资	2017 年 9 月 21 日	1,227.32	1,227.32	0.00%
63	红利再投资	2017 年 9 月 22 日	1,236.05	1,236.05	0.00%
64	红利再投资	2017 年 9 月 25 日	3,685.00	3,685.00	0.00%
65	红利再投资	2017 年 9 月 26 日	1,229.25	1,229.25	0.00%
66	红利再投资	2017 年 9 月 27 日	1,222.59	1,222.59	0.00%
67	红利再投资	2017 年 9 月 28 日	1,222.00	1,222.00	0.00%
68	红利再投资	2017 年 9 月 29 日	1,272.83	1,272.83	0.00%
合计			-862,249.28	-862,249.28	

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	2017 年 7 月 1 日至 2017 年 8 月 25 日	132,728,774.85 份	1,158,858.41 份	50,000,000.00 份	83,843,082.01 份	16.65%
产品特有风险							
中科沃土货币基金因市场波动、基金规模变动影响，导致该名机构投资者在本报告期间出现持有份额比例被动超过 20%的情况。该名投资者本报告期内由于持有份额变化，截止本报告期末其持有份额比例已降至 20%以下，故本基金产品实质上未发现特有风险。							

注：上述申购份额为红利再投资份额。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中科沃土货币市场基金注册的文件；

- 2、《中科沃土货币市场基金基金合同》；
- 3、《中科沃土货币市场基金托管协议》；
- 4、《中科沃土基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 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

2017 年 10 月 26 日