

# 中科沃土货币市场基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 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: 2024 年 08 月 28 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。本中期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2024年8月27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。

本报告期自2024年1月1日至2024年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.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 债券回购融资情况.....	41
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	42
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	43
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离.....	43
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细.....	44
7.9 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息.....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45

8.4 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情况.....	46
§9 开放式基金份额变动 .....	46
§10 重大事件揭示.....	46
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4 基金投资策略的改变 .....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	48
10.9 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
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 .....	50
§12 备查文件目录.....	50
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点 .....	51
12.3 查阅方式 .....	51

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中科沃土货币市场基金	
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06月06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	40,741,684.20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	9,950,204.31份	30,791,479.89份

### 2.2 基金产品说明

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。
--	-------------------

### 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	李峰	王海燕
	联系电话	0757-86208608	020-22389089
	电子邮箱	lifeng0214@richlandasm.com.cn	wanghaiyan@grcbank.com
客户服务电话		400-018-3610	95313
传真		0757-86208604	020-28019340
注册地址		佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号千灯湖创投小镇核心区（自编号）十三座（B4）	广州市黄埔区映日路9号
办公地址		佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号千灯湖创投小镇核心区（自编号）十三座（B4）	广州市天河区珠江新城华夏路1号
邮政编码		528200	510623
法定代表人		于建伟	蔡建

注：经佛山市南海区市场监督管理局核准，中科沃土基金管理有限公司法定代表人变更为于建伟先生，已于2024年7月11日公告。

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.richlandasm.com.cn">http://www.richlandasm.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号千灯湖创投小镇核心区（自编号）十三座（B4）

### 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	佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号千灯湖创投小镇核心区(自编号)十三座(B4)

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	中科沃土货币A	中科沃土货币B
本期已实现收益	29,104.69	187,639.50
本期利润	29,104.69	187,639.50
本期净值收益率	0.3894%	0.5091%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末基金资产净值	9,950,204.31	30,791,479.89
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
累计净值收益率	18.7125%	20.9825%

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（不含公允价值变动损益）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损益。  
2.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.本基金利润分配是按日结转份额。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	收益率①	收益率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	0.0432%	0.0002%	0.1125%	0.0000%	-0.0693%	0.0002%
过去三个月	0.1473%	0.0002%	0.3413%	0.0000%	-0.1940%	0.0002%
过去六个月	0.3894%	0.0007%	0.6825%	0.0000%	-0.2931%	0.0007%
过去一年	1.0448%	0.0011%	1.3725%	0.0000%	-0.3277%	0.0011%
过去三年	4.4170%	0.0012%	4.1100%	0.0000%	0.3070%	0.0012%
自基金合同生效起至今	18.7125%	0.0027%	11.0513%	0.0000%	7.6612%	0.0027%

中科沃土货币B

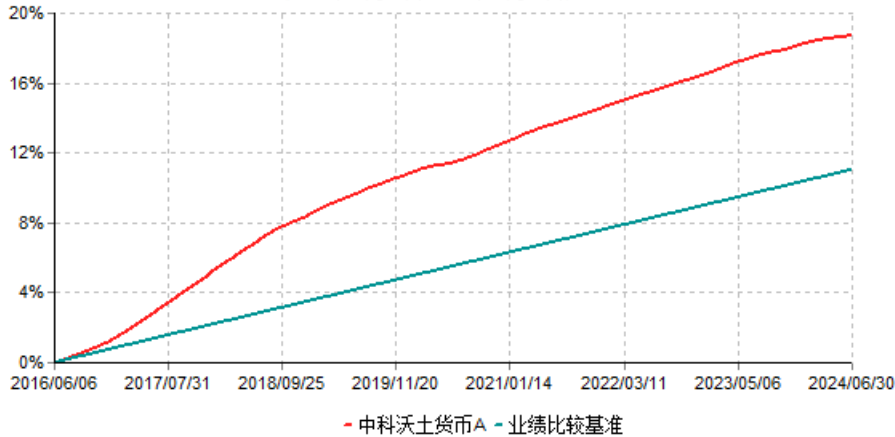
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.0629%	0.0002%	0.1125%	0.0000%	-0.0496%	0.0002%
过去三个月	0.2071%	0.0002%	0.3413%	0.0000%	-0.1342%	0.0002%
过去六个月	0.5091%	0.0007%	0.6825%	0.0000%	-0.1734%	0.0007%
过去一年	1.2890%	0.0011%	1.3725%	0.0000%	-0.0835%	0.0011%
过去三年	5.1732%	0.0012%	4.1100%	0.0000%	1.0632%	0.0012%
自基金合同生效起至今	20.9825%	0.0027%	11.0513%	0.0000%	9.9312%	0.0027%

注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

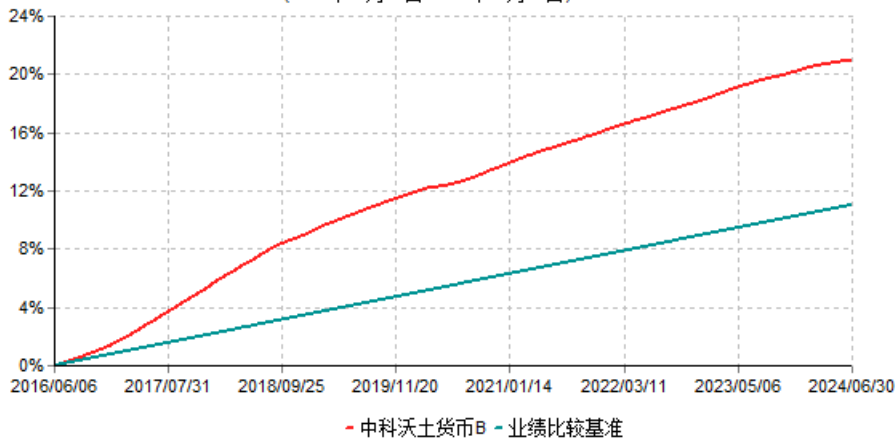
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



中科沃土货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年06月06日-2024年06月30日)



中科沃土货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年06月06日-2024年06月30日)



## §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2.42亿元，是国内第100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”的首要经营原则，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2024年6月30日，中科沃土旗下共管理6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。

**4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介**

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		
李欣桐	固定收益总监兼固定收益部总经理、基金经理	2021-04-09	2024-01-02	9年	国际经济法硕士。曾任粤开证券（原联讯证券）固定收益部交易员、资产管理部投资经理，北京康思资本管理有限公司投资交易部投资总监，中科沃土基金管理有限公司固定收益部副总经理（主持工作）、中科沃土货币市场基金、中科沃土沃盛纯债债券型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的基金经理，现任中科沃土基金管理有限公司固定收益总监兼固定收益部总经理。中国国籍，具有基金从业资格。
董清源	固定收益部基金经理	2022-05-16	-	11年	金融学硕士。曾任北京康思资本管理有限公司债券交易员、投资经理、投资总监，首建投信和（北京）资产管理有限公司常务副总经理，北京康思资本管理有限公司副总经理，现任中科沃土基金管理有限公司中科沃

					土沃盛纯债债券型证券投资基金、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土货币市场基金和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。中国国籍，具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

注：1.此处的“任职日期”、“离任日期”为公告确定的聘任、离任日期；  
2.证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

#### 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。

##### 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 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

一季度，经济景气度企稳回升，开局良好。工业增加值、固定资产投资、消费及进出口等方面数据均有边际改善，在国内宏观政策进一步加码发力的背景下，经济增长内

生动力进一步增强。在稳增长的诉求下，货币政策继续维持宽松，5年期LPR非对称调降，资产荒极致演绎，利差继续压缩，债券收益率曲线进一步走平。

二季度，经济基本面弱势整理、温和修复，内需不足制约经济发展。通胀和失业率相对稳定。银行间市场资金面合理宽裕，债券供给担忧减弱，特别国债发行节奏平缓，地产刺激政策影响低于预期，机构欠配压力较大，资产荒依旧严重，利率整体下行。

上半年，10年期国债收益率自年初2.56%下行至6月末2.2%，1年期AAA评级的国股同业存单收益率由2.44%降低至1.95%，均有明显下行。

报告期内，在保障流动性安全的大前提下，尽力通过大类资产配置及其他多种债券投资策略，提高组合的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中科沃土货币A基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.3894%，同期业绩比较基准收益率为0.6825%；截至报告期末中科沃土货币B基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.5091%，同期业绩比较基准收益率为0.6825%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在外部环境的不利因素增多，经济形势面临更多风险挑战的新背景下，维持积极的财政政策，加强逆周期调节至关重要，下半年特别国债和地方专项债的发行及使用进度有望提速。

同时，货币政策方面，为配合财政政策发力，同时在化解地方政府债务，稳定经济增长的大背景下，预计资金面合理宽裕仍旧是主基调。同时，随着美国通胀逐步走低，预计美国降息会逐步临近，央行稳定人民币汇率的压力会逐步降低，掣肘货币政策的因素越来越少，宽松空间有望进一步打开，下半年降息和降准值得期待，这将继续利好债券市场，以10年期国债为代表的债券收益率有望继续创历史新低，但受此前央行对于中长期利率走低进行了提醒并计划开展债券买卖操作的背景下，我们将对于中长期利率继续走低后所面临的回调风险保持更多的关注。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、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。本基金托管人根据法律法规的要求履行估值和净值计算的复核责任。

本基金管理人已制定基金估值和份额计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；设有估值委员会，负责指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金

估值运营等方面的专业胜任能力。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。基金管理人改变估值技术，导致基金净值变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 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“基金的收益与分配”之“（二）收益分配原则”的相关规定，本基金收益分配方式为红利再投资，每日分配、按日支付。本基金报告期内中科沃土货币A份额分配收益累计29,104.69元，中科沃土货币B份额分配收益累计187,639.50元。

#### 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

本报告期内，本基金存在连续二十个工作日以上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货币市场基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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。

#### 5.3 托管人对本中期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中期报告中的财务指标、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）

6.1 资产负债表

会计主体：中科沃土货币市场基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	4,229,665.62	3,266,356.69
结算备付金		65,797.26	-
存出保证金		4,014.59	-
交易性金融资产	6.4.7.2	20,646,642.36	40,560,196.40
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		20,646,642.36	40,560,196.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	16,004,128.88	18,702,803.59
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,000.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		40,951,248.71	62,529,356.68
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>

<b>负债：</b>			
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,032.81	14,499.77
应付托管费		2,675.42	3,866.59
应付销售服务费		2,305.32	1,426.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		1,017.06	2,774.76
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	193,533.90	134,603.57
负债合计		209,564.51	157,171.49
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	40,741,684.20	62,372,185.19
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		40,741,684.20	62,372,185.19
负债和净资产总计		40,951,248.71	62,529,356.68

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额总额40,741,684.20份，其中中科沃土货币A类基金份额净值1.0000元，基金份额9,950,204.31份；中科沃土货币B类基金份额净值1.0000元，基金份额30,791,479.89份。

## 6.2 利润表

会计主体：中科沃土货币市场基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至	上年度可比期间 2023年01月01日至202
----	-----	--------------------	----------------------------

		2024年06月30日	3年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		392,105.67	4,623,413.76
1.利息收入		194,583.13	1,421,698.53
其中：存款利息收入	6.4.7.9	50,537.14	48,033.46
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		144,045.99	1,373,665.07
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		197,522.54	3,201,715.23
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	197,522.54	3,201,715.23
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
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	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		175,361.48	860,833.43
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	64,661.78	546,526.34
2.托管费	6.4.10.2.2	17,243.15	145,740.33
3.销售服务费	6.4.10.2.3	10,985.37	31,634.96



4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		3,898.84	30,063.29
其中：卖出回购金融资产支出		3,898.84	30,063.29
6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		-	9,128.85
8.其他费用	6.4.7.20	78,572.34	97,739.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		216,744.19	3,762,580.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		216,744.19	3,762,580.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		216,744.19	3,762,580.33

### 6.3 净资产变动表

会计主体：中科沃土货币市场基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	62,372,185.19	-	62,372,185.19
二、本期期初净资产	62,372,185.19	-	62,372,185.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-21,630,500.99	-	-21,630,500.99
（一）、综合收益总额	-	216,744.19	216,744.19

(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-21,630,500.99	-	-21,630,500.99
其中: 1.基金申购款	57,649,564.86	-	57,649,564.86
2.基金赎回款	-79,280,065.85	-	-79,280,065.85
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-216,744.19	-216,744.19
四、本期期末净资产	40,741,684.20	-	40,741,684.20
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	419,624,954.93	-	419,624,954.93
二、本期期初净资产	419,624,954.93	-	419,624,954.93
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-300,846,216.66	-	-300,846,216.66
(一)、综合收益总额	-	3,762,580.33	3,762,580.33
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-300,846,216.66	-	-300,846,216.66
其中: 1.基金申购款	415,929,710.75	-	415,929,710.75

2.基金赎回款	-716,775,927.41	-	-716,775,927.41
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-3,762,580.33	-3,762,580.33
四、本期期末净资产	118,778,738.27	-	118,778,738.27

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:

于建伟

李峰

李峰

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

中科沃土货币市场基金(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[2016]686号《关于准予中科沃土货币市场基金注册的批复》核准,由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》和《中科沃土货币市场基金证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币4,913,055,442.79元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2016]48090148号验资报告验证。经向中国证监会备案,《中科沃土货币市场基金基金合同》于2016年6月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,913,055,442.79份基金份额,其中认购资金利息折合735,228.76份基金份额。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(以下简称“广州农商银行”)。

根据《中科沃土货币市场基金更新的招募说明书》,本基金根据适用的销售服务费率不同,将基金份额分为A类、B类两类份额。本基金A类、B类基金份额分别设置代码。在基金存续期内的任何一个开放日,如A类基金份额持有人持有的基金份额余额达到或超过5,000,000份,即升级为B类份额持有人,如B类基金份额持有人持有的基金份额余额低于5,000,000份,即降级为A类份额持有人。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中科沃土货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括现金,期限在1年以

内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率(税后)。

#### 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于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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的说明

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全

面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	4,229,665.62
等于：本金	4,228,710.79
加：应计利息	954.83
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,229,665.62

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目		本期末 2024年06月30日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	20,646,642.36	20,650,694.75	4,052.39	0.0099
	合计	20,646,642.36	20,650,694.75	4,052.39	0.0099
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	20,646,642.36	20,650,694.75	4,052.39	0.0099

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

**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 2024年06月30日			
----	--------------------	--	--	--

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	16,004,128.88	-
合计	16,004,128.88	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,561.56
其中：交易所市场	-
银行间市场	4,561.56
应付利息	-
预提费用	188,972.34
合计	193,533.90

**6.4.7.7 实收基金**

**6.4.7.7.1 中科沃土货币A**

金额单位：人民币元

项目 (中科沃土货币A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,633,571.92	4,633,571.92

本期申购	12,458,246.51	12,458,246.51
本期赎回（以“-”号填列）	-7,141,614.12	-7,141,614.12
本期末	9,950,204.31	9,950,204.31

**6.4.7.7.2 中科沃土货币B**

金额单位：人民币元

项目 (中科沃土货币B)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	57,738,613.27	57,738,613.27
本期申购	45,191,318.35	45,191,318.35
本期赎回（以“-”号填列）	-72,138,451.73	-72,138,451.73
本期末	30,791,479.89	30,791,479.89

注：红利再投及转入份额计入本期申购，转出份额计入本期赎回。

**6.4.7.8 未分配利润**

**6.4.7.8.1 中科沃土货币A**

单位：人民币元

项目 (中科沃土货币A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	29,104.69	-	29,104.69
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-29,104.69	-	-29,104.69
本期末	-	-	-

**6.4.7.8.2 中科沃土货币B**

单位：人民币元



项目 (中科沃土货币B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	187,639.50	-	187,639.50
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-187,639.50	-	-187,639.50
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	8,706.89
定期存款利息收入	41,662.23
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	163.15
其他	4.87
合计	50,537.14

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	197,154.48
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	368.06
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	197,522.54

**6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	201,555,723.88
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	198,996,246.23
减：应计利息总额	2,559,109.59
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	368.06

**6.4.7.13 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

本基金本报告期内无股利收益。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

**6.4.7.18 其他收入**

本基金本报告期内无其他收入。

**6.4.7.19 信用减值损失**

本基金本报告期无信用减值损失。

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
其他	300.00
合计	78,572.34

**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，本基金并无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表报出日，本基金并无须作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**

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**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("中科沃土基金")	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("广州农村商业银行")	基金托管人、基金销售机构

注：下述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**

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.5 基金交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行基金交易。

**6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期内及上年度可比期间未有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 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	64,661.78	546,526.34

其中：应支付销售机构的客户维护费	1,344.50	6,604.48
应支付基金管理人的净管理费	63,317.28	539,921.86

注：支付基金管理人中科沃土基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	17,243.15	145,740.33

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.08%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.08%/当年天数。

#### 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 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土货币A	中科沃土货币B	合计
中科沃土 基金管理 有限公司	7,307.71	1,730.58	9,038.29
广州农村 商业银行 股份有限 公司	128.53	0.00	128.53
合计	7,436.24	1,730.58	9,166.82
获得销售 服务费的	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		

各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土货币A	中科沃土货币B	合计
中科沃土基金管理 有限公司	12,201.01	17,023.97	29,224.98
广州农村 商业银行 股份有限 公司	176.25	0.00	176.25
合计	12,377.26	17,023.97	29,401.23

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日A类基金份额和B类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中科沃土基金，再由中科沃土基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额和B类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%和0.01%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日A/B类基金份额的基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中科沃土货币A

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	4,082,481.33	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	4,082,481.33	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

中科沃土货币B

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	7,067,380.41	12,085,086.33
报告期间申购/买入总份额	10,946.64	25,279,593.19
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	7,078,327.05	11,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	26,364,679.52
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	22.20%

注：1.期间申购/买入总份额包含红利再投及转入份额，赎回/卖出总份额包含转出份额。  
2.基金管理人中科沃土基金投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.5.2 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

中科沃土货币A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份	持有的基金份额	持有的基金份

		额占基金总份 额的比例		额占基金总份 额的比例
珠海横琴沃信投资合伙企业（有限合伙）	1,762,039.69	4.3249%	1,795,022.79	2.8779%

**6.4.10.6 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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广州农村商业银行股份有限公司	4,229,665.62	8,706.89	924,951.33	8,329.04

注：本基金的银行存款由基金托管人广州农村商业银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金**

中科沃土货币A

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润 分配合计	备注
29,083.54	-	21.15	29,104.69	-

中科沃土货币B

单位：人民币元



已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润 分配合计	备注
189,418.35	-	-1,778.85	187,639.50	-

#### 6.4.12 期末（2024年06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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末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

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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

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、合规风控部、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。

本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

##### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人广州农村商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净资产的10%。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

**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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	19,973,730.68
合计	-	19,973,730.68

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国债。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有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**

本基金本报告期末及上年度末未持有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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	20,646,642.36	20,586,465.72
合计	20,646,642.36	20,586,465.72

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政策性金融债。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有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**

本基金本报告期末及上年度末未持有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在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。

于本报告期末，本基金的卖出回购金融资产款（若有）计息且利息金额不重大；除此之外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

**6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过240天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过60天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过120天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的10%。于本报告期末，本基金无流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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**

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，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**

单位：人民币元

本期末 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,229,665.62	-	-	-	4,229,665.62
结算备付金	65,797.26	-	-	-	65,797.26
存出保证金	4,014.59	-	-	-	4,014.59
交易性金融资产	20,646,642.36	-	-	-	20,646,642.36
买入返售金融资产	16,004,128.88	-	-	-	16,004,128.88
应收申购款	-	-	-	1,000.00	1,000.00
资产总计	40,950,248.71	-	-	1,000.00	40,951,248.71
负债					
应付管	-	-	-	10,032.81	10,032.81

理人报 酬					
应付托 管费	-	-	-	2,675.42	2,675.42
应付销 售服务 费	-	-	-	2,305.32	2,305.32
应付利 润	-	-	-	1,017.06	1,017.06
其他负 债	-	-	-	193,533.90	193,533.90
负债总 计	-	-	-	209,564.51	209,564.51
利率敏 感度缺 口	40,950,248.71	-	-	-208,564.51	40,741,684.20
上年度 末 2023年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资 金	3,266,356.69	-	-	-	3,266,356.69
交易性 金融资 产	40,560,196.40	-	-	-	40,560,196.40
买入返 售金融 资产	18,702,803.59	-	-	-	18,702,803.59
资产总 计	62,529,356.68	-	-	-	62,529,356.68
负债					
应付管 理人报 酬	-	-	-	14,499.77	14,499.77
应付托	-	-	-	3,866.59	3,866.59

管费					
应付销售服务费	-	-	-	1,426.80	1,426.80
应付利润	-	-	-	2,774.76	2,774.76
其他负债	-	-	-	134,603.57	134,603.57
负债总计	-	-	-	157,171.49	157,171.49
利率敏感度缺口	62,529,356.68	-	-	-157,171.49	62,372,185.19

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

**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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	1.利率上升25个基点	-3,549.09	-4,601.66
	2.利率下降25个基点	3,558.90	4,603.02

**6.4.13.4.2 外汇风险**

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

**6.4.13.4.3 其他价格风险**

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，不参与股票、权证等资产的投资，本期末和上一年度末，无重大其他价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

其他价格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除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，不参与股票、权证等资产的投资。于本报告期末，本基金未持有交易性权益类投资，因此无重大其他价格风险。(上年度末：同)

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	20,646,642.36	40,560,196.40
第三层次	-	-
合计	20,646,642.36	40,560,196.40

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。



**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

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，其账面价值与公允价值相差很小。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

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**

**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	固定收益投资	20,646,642.36	50.42
	其中：债券	20,646,642.36	50.42
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	16,004,128.88	39.08
	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	4,295,462.88	10.49
4	其他各项资产	5,014.59	0.01
5	合计	40,951,248.71	100.00

**7.2 债券回购融资情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.98	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

**债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明**

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

**7.3 基金投资组合平均剩余期限**

**7.3.1 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	13
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	30
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

**报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明**

本基金合同约定“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过120天”，本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

**7.3.2 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	74.37	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	24.59	-
	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	-	-
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)	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

合计	98.96	-
----	-------	---

**7.4 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。

**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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,646,642.36	50.68
	其中：政策性金融债	20,646,642.36	50.68
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	20,646,642.36	50.68
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

**7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	190208	19国开08	100,000	10,341,557.39	25.38
2	190409	19农发09	100,000	10,305,084.97	25.29

**7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0103%
报告期内偏离度的最低值	-0.0030%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0023%

**报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明**

本基金本报告期内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**

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

**7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.9 投资组合报告附注**

**7.9.1 基金计价方法说明**

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。

**7.9.2 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。**

**7.9.3 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	4,014.59
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	1,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	5,014.59

## §8 基金份额持有人信息

### 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
中科沃土货币A	6,189	1,607.72	8,163,583.22	82.04%	1,786,621.09	17.96%
中科沃土货币B	1	30,791,479.89	30,791,479.89	100.00%	0.00	0.00%
合计	6,190	6,581.86	38,955,063.11	95.61%	1,786,621.09	4.39%

### 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	产品	30,789,844.13	75.57%
2	产品	1,901,069.58	4.67%
3	产品	1,901,069.58	4.67%
4	产品	1,901,069.58	4.67%
5	机构	1,762,039.69	4.32%
6	机构	464,163.28	1.14%
7	个人	338,659.18	0.83%
8	个人	270,863.92	0.66%
9	个人	195,367.55	0.48%
10	个人	125,780.85	0.31%

### 8.3 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	中科沃土货币A	467,892.80	4.7023%
	中科沃土货币B	0.00	0.00%
	合计	467,892.80	1.1484%

**8.4 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	中科沃土货币A	0~10
	中科沃土货币B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中科沃土货币A	0
	中科沃土货币B	0
	合计	0

**§9 开放式基金份额变动**

单位：份

	中科沃土货币A	中科沃土货币B
基金合同生效日(2016年06月06日)基金份额总额	308,525,213.20	4,605,265,458.35
本报告期期初基金份额总额	4,633,571.92	57,738,613.27
本报告期基金总申购份额	12,458,246.51	45,191,318.35
减：本报告期基金总赎回份额	7,141,614.12	72,138,451.73
本报告期期末基金份额总额	9,950,204.31	30,791,479.89

注：申购份额包含红利再投及转入份额，赎回份额包含转出份额。

**§10 重大事件揭示**

**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

**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**

本报告期内，自2024年6月28日起，本基金管理人新聘任于建伟为总经理，智会杰不再担任总经理职务；经佛山市南海区市场监督管理局核准，本基金管理人法定代表人变更为于建伟，智会杰不再担任法定代表人，已于2024年7月11日公告；自2024年7月26日起，本基金管理人新聘任袁柳生为副总经理。

本报告期内，本基金托管人聘任王海燕为资产托管部高级副经理。

### 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

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，公司财务指标存在不符合《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》相关规定的情形，中国证券监督管理委员会广东监管局要求公司限期内改善财务状况。公司在期限内已采取相关措施解决财务指标，截至2024年6月30日公司各项财务指标均已满足监管要求。

#### 10.6.2 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

#### 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	

国泰君安	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		基金交易	
	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	成交金 额	占当期 基金成 交总额 的比例
国泰君安	18,313,182.57	100.00%	14,500,000.00	100.00%	-	-	-	-

**10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况**

本基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过0.5%的情况。

**10.9 其他重大事件**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中科沃土货币市场基金基金 经理变更公告	证券时报	2024-01-03



2	中科沃土货币市场基金招募说明书更新	证券时报	2024-01-05
3	中科沃土货币市场基金基金产品资料概要更新A类份额	证券时报	2024-01-05
4	中科沃土货币市场基金基金产品资料概要更新B类份额	证券时报	2024-01-05
5	中科沃土货币市场基金2023年第四季度报告	证券时报	2024-01-19
6	中科沃土货币市场基金春节假期前暂停申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	证券时报	2024-02-01
7	中科沃土货币市场基金2023年年度报告	证券时报	2024-03-29
8	中科沃土货币市场基金清明节假期前暂停申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	证券时报	2024-03-29
9	中科沃土货币市场基金2024年第一季度报告	证券时报	2024-04-22
10	中科沃土货币市场基金劳动节假期前暂停申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	证券时报	2024-04-26
11	中科沃土基金管理有限公司关于关闭网上交易平台、微信交易平台（仅限富友支付渠道）的公告	证券时报	2024-05-13
12	中科沃土基金管理有限公司关于新增蚂蚁基金为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报	2024-05-20
13	中科沃土货币市场基金端午节假期前暂停申购、定期定额投资及转换转入业务的公	证券时报	2024-06-04

	告		
14	中科沃土货币市场基金招募说明书更新	证券时报	2024-06-05
15	中科沃土货币市场基金基金产品资料概要更新A类份额	证券时报	2024-06-05
16	中科沃土货币市场基金基金产品资料概要更新B类份额	证券时报	2024-06-05
17	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	证券时报	2024-06-24
18	中科沃土基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证券时报	2024-06-29

### §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	20240109 - 20240111	-	11,002,489.60	11,002,489.60	-	-
	2	20240101 - 20240630	30,632,127.70	157,716.43	-	30,789,844.13	75.57%
	3	20240510 - 20240512	-	10,004,683.71	10,004,683.71	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p>							

注：申购份额包含红利再投及转入份额，赎回份额包含转出份额。

### §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. 关于申请募集注册中科沃土货币市场基金之法律意见书；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 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  
二〇二四年八月二十八日