

# 中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金

## 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.....	5
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.....	10
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.....	11
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.....	12
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.....	12
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息.....	42

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
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情况 .....	43
§9 开放式基金份额变动 .....	43
§10 重大事件揭示 .....	44
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	44
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 .....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
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 .....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
10.8 其他重大事件 .....	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	47
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 .....	47
§12 备查文件目录 .....	47
12.1 备查文件目录 .....	47
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中科沃土沃安中短期利率债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03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	21,911,909.50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	13,521,438.27份	8,390,471.23份

### 2.2 基金产品说明

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。

### 2.3 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	中国证券报
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)	
	中科沃土沃安中短期利率债券A	中科沃土沃安中短期利率债券C
本期已实现收益	212,072.35	108,029.09
本期利润	275,412.02	144,196.28
加权平均基金份额本期利润	0.0168	0.0123
本期加权平均净值利润率	1.30%	1.15%
本期基金份额净值增长率	1.30%	1.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	-11,308,241.43	-8,715,427.22
期末可供分配基金份额利润	-0.8363	-1.0387
期末基金资产净值	17,503,580.03	9,035,001.17
期末基金份额净值	1.2945	1.0768
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	37.24%	17.16%

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。

4.本基金合同生效日为2019年3月18日。

#### 3.2 基金净值表现

### 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	0.21%	0.01%	0.21%	0.02%	0.00%	-0.01%
过去三个月	0.56%	0.02%	0.41%	0.03%	0.15%	-0.01%
过去六个月	1.30%	0.02%	0.47%	0.04%	0.83%	-0.02%
过去一年	2.30%	0.02%	0.69%	0.04%	1.61%	-0.02%
过去三年	30.64%	0.91%	1.87%	0.04%	28.77%	0.87%
自基金合同生效起至今	37.24%	0.68%	2.45%	0.05%	34.79%	0.63%

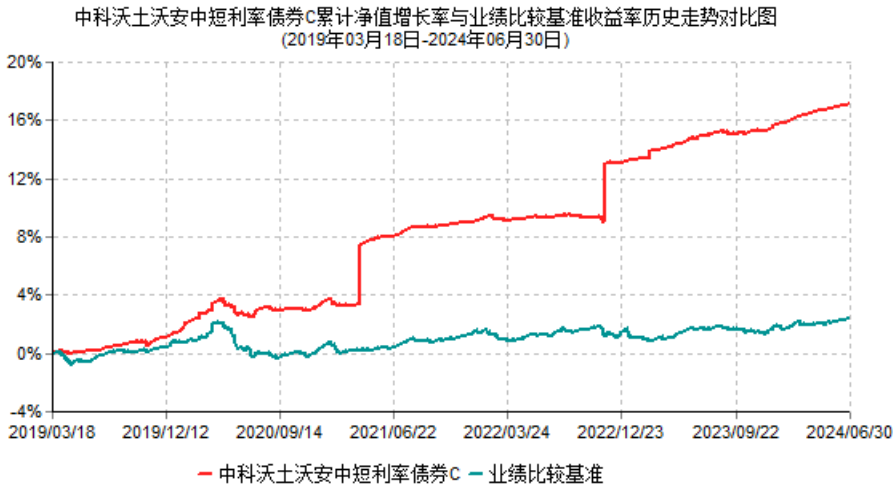
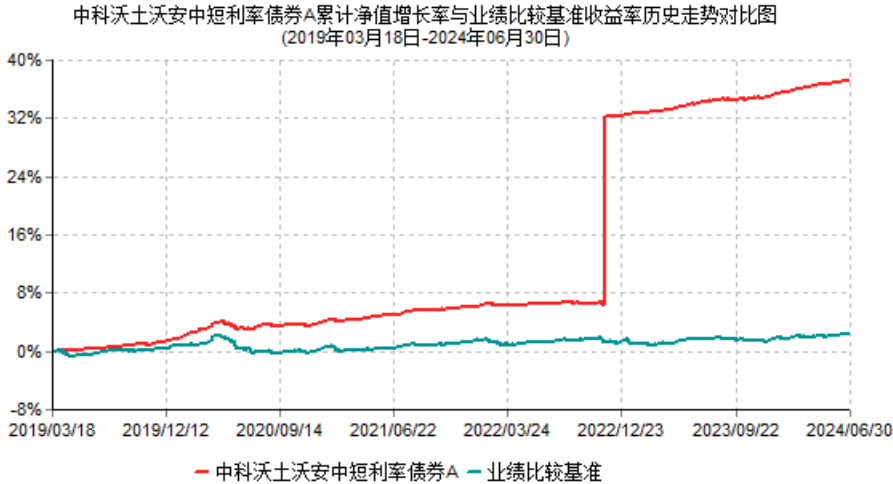
#### 中科沃土沃安中短利率债券C

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	0.19%	0.01%	0.21%	0.02%	-0.02%	-0.01%
过去三个月	0.49%	0.02%	0.41%	0.03%	0.08%	-0.01%
过去六个月	1.17%	0.02%	0.47%	0.04%	0.70%	-0.02%
过去一年	1.98%	0.02%	0.69%	0.04%	1.29%	-0.02%
过去三年	8.34%	0.14%	1.87%	0.04%	6.47%	0.10%
自基金合同生效起至今	17.16%	0.16%	2.45%	0.05%	14.71%	0.11%

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





## §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		
董清源	固定收益部基金经理	2022-05-26	-	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”为公告确定的聘任日期；

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，通过久期和仓位的灵活调整，配合及其他债券投资策略，希望在控制回撤的基础上，尽力提高组合的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中科沃土沃安中短利率债券A基金份额净值为1.2945元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.30%，同期业绩比较基准收益率为0.47%；截至报告期末中科沃土沃安中短利率债券C基金份额净值为1.0768元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.17%，同期业绩比较基准收益率为0.47%。

### 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，这将持续利好债券市场，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

本报告期内本基金未进行利润分配。

#### 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，本基金存在连续六十个工作日以上基金资产净值低于五千万元的情形，已向监管部门提交解决方案。

## §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债券型证券投资基金的托管过程中，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：中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金

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	27,267.84	370,735.77
结算备付金		423,906.00	574,604.47
存出保证金		4,002.92	17,495.46
交易性金融资产	6.4.7.2	23,144,828.20	33,023,065.85
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		23,144,828.20	33,023,065.85
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	3,000,000.00	5,699,316.29
应收清算款		738.49	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,725.83	140,326.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		26,603,469.28	39,825,544.15
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2024年06月30日</b>	<b>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		-	307,265.13
应付赎回款		2,103.95	58,926.57
应付管理人报酬		4,622.96	7,043.41
应付托管费		1,849.18	2,817.38
应付销售服务费		1,921.21	3,724.99
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	54,390.78	34,500.00
负债合计		64,888.08	414,277.48
<b>净资产：</b>			

实收基金	6.4.7.7	21,911,909.50	33,365,310.74
未分配利润	6.4.7.8	4,626,671.70	6,045,955.93
净资产合计		26,538,581.20	39,411,266.67
负债和净资产总计		26,603,469.28	39,825,544.15

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额总额21,911,909.50份，其中A类基金份额净值1.2945元，A类基金份额13,521,438.27份；C类基金份额净值1.0768元，C类基金份额8,390,471.23份。

## 6.2 利润表

会计主体：中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金

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 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		511,061.11	385,436.16
1.利息收入		55,189.79	32,602.76
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,537.85	3,198.09
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		50,651.94	29,404.67
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		355,054.10	290,526.31
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	355,054.10	290,526.31
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
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	-	-
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	99,506.86	47,833.07
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	1,310.36	14,474.02
<b>减：二、营业总支出</b>		91,452.81	74,920.56
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	33,540.88	25,519.58
2.托管费	6.4.10.2.2	13,416.34	10,207.86
3.销售服务费	6.4.10.2.3	15,594.81	14,262.87
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	1,053.86
其中：卖出回购金融资产支出		-	1,053.86
6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.20	28,900.78	23,876.39
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		419,608.30	310,515.60
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		419,608.30	310,515.60
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		419,608.30	310,515.60

### 6.3 净资产变动表

会计主体：中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金

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	33,365,310.74	6,045,955.93	39,411,266.67
二、本期期初净资产	33,365,310.74	6,045,955.93	39,411,266.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-11,453,401.24	-1,419,284.23	-12,872,685.47
（一）、综合收益总额	-	419,608.30	419,608.30
（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）	-11,453,401.24	-1,838,892.53	-13,292,293.77
其中：1.基金申购款	22,095,221.83	2,181,246.08	24,276,467.91
2.基金赎回款	-33,548,623.07	-4,020,138.61	-37,568,761.68
（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）	-	-	-
四、本期期末净资产	21,911,909.50	4,626,671.70	26,538,581.20
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	7,877,045.93	1,771,470.88	9,648,516.81

产			
二、本期期初净资产	7,877,045.93	1,771,470.88	9,648,516.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	38,560,572.80	4,632,113.91	43,192,686.71
（一）、综合收益总额	-	310,515.60	310,515.60
（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）	38,560,572.80	4,321,598.31	42,882,171.11
其中：1.基金申购款	124,377,287.98	10,551,311.15	134,928,599.13
2.基金赎回款	-85,816,715.18	-6,229,712.84	-92,046,428.02
（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）	-	-	-
四、本期期末净资产	46,437,618.73	6,403,584.79	52,841,203.52

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

中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金(以下简称"本基金")是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于2019年2月13

日至2019年3月14日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，投票表决通过了《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》，同意将中科沃土沃安债券型证券投资基金转型为中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金。根据《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》，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转型并更名为中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金。自同日起，《中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金基金合同》生效，原《中科沃土沃安债券型证券投资基金基金合同》失效。与此同时，中科沃土沃安债券型证券投资基金基金合同失效前的基金资产净值51,008,337.13元，于本基金基金合同生效时全部转为本基金的期初基金资产净值。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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"广州农村商业银行")。

根据《中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，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。本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%，其中投资于中短期利率债的比例不低于非现金基金资产的80%，每个交易日日终，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债1-3年政策性金融债指数收益率。

#### 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》、《中科沃土沃安中短期利率债债券型证券

投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于本报告期末，本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍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

本基金2024年中期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2024年6月30日的财务状况以及2024上半年度的经营成果和基金净值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	27,267.84
等于：本金	27,265.37
加：应计利息	2.47
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	27,267.84

**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				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	22,733,075.31	295,448.20	23,144,828.20	116,304.69
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	22,733,075.31	295,448.20	23,144,828.20	116,304.69
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	22,733,075.31	295,448.20	23,144,828.20	116,304.69	

**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	3,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	3,000,000.00	-

注：交易所买入返售证券余额中包含的交易所固收平台质押式协议回购的余额为零。

#### 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从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	49,890.78
预提费用-账户维护费	4,500.00
合计	54,390.78

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 中科沃土沃安中短利率债券A

金额单位：人民币元

项目 (中科沃土沃安中短利率债券 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	18,267,507.45	18,267,507.45
本期申购	3,379,842.51	3,379,842.51
本期赎回（以“-”号填列）	-8,125,911.69	-8,125,911.69

本期末	13,521,438.27	13,521,438.27
-----	---------------	---------------

#### 6.4.7.7.2 中科沃土沃安中短利率债券C

金额单位：人民币元

项目 (中科沃土沃安中短利率债券 C)	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	15,097,803.29	15,097,803.29
本期申购	18,715,379.32	18,715,379.32
本期赎回（以“-”号填列）	-25,422,711.38	-25,422,711.38
本期末	8,390,471.23	8,390,471.23

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 中科沃土沃安中短利率债券A

单位：人民币元

项目 (中科沃土沃安中短利率债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-15,513,506.68	20,589,278.95	5,075,772.27
本期期初	-15,513,506.68	20,589,278.95	5,075,772.27
本期利润	212,072.35	63,339.67	275,412.02
本期基金份额交易产生的变动数	3,993,192.90	-5,362,235.43	-1,369,042.53
其中：基金申购款	-2,856,230.09	3,812,679.79	956,449.70
基金赎回款	6,849,422.99	-9,174,915.22	-2,325,492.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,308,241.43	15,290,383.19	3,982,141.76

##### 6.4.7.8.2 中科沃土沃安中短利率债券C

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
----	-------	-------	---------



(中科沃土沃安中短期利率债券C)			
上年度末	-15,824,936.71	16,795,120.37	970,183.66
本期期初	-15,824,936.71	16,795,120.37	970,183.66
本期利润	108,029.09	36,167.19	144,196.28
本期基金份额交易产生的变动数	7,001,480.40	-7,471,330.40	-469,850.00
其中：基金申购款	-19,594,211.41	20,819,007.79	1,224,796.38
基金赎回款	26,595,691.81	-28,290,338.19	-1,694,646.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,715,427.22	9,359,957.16	644,529.94

#### 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	335.65
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	4,151.76
其他	50.44
合计	4,537.85

#### 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	306,550.96
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	48,503.14
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	355,054.10

**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	18,838,469.38
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	18,601,451.86
减：应计利息总额	188,514.38
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	48,503.14

**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

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	99,506.86
——股票投资	-
——债券投资	99,506.86
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	99,506.86

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	1,310.36
合计	1,310.36

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。  
2.本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

#### 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	-
证券出借违约金	-
账户维护费	9,010.00
合计	28,900.78

#### 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

截至本财务报表批准报出日，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有通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 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有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 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有通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 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有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 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	33,540.88	25,519.58
其中：应支付销售机构的客户维护费	15,280.51	10,882.18
应支付基金管理人的净管理费	18,260.37	14,637.40

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0.20%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×0.20%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2024年01月01日至2024年06月30日	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	13,416.34	10,207.86

注：支付基金托管人广州农村商业银行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	0.00	1,003.97	1,003.97
合计	0.00	1,003.97	1,003.97
获得销售服务费的各关联方名称	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	0.00	1,658.80	1,658.80
合计	0.00	1,658.80	1,658.80

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.25%的年费率计提，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。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值×0.25%/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

本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资金投资本基金。

##### 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

本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 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	27,267.84	335.65	358,756.69	1,846.81

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之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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市场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市场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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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	3,554,652.74	4,038,860.27
合计	3,554,652.74	4,038,860.27

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。

#### 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	19,590,175.46	28,984,205.58
合计	19,590,175.46	28,984,205.58

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、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。

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约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》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，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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%。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转

让的情况参见报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。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15%。

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。于本报告期末，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。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。

本基金的基金管理人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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年0	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
---------------	------	------	------	-----	----

6月30日					
资产					
货币资金	27,267.84	-	-	-	27,267.84
结算备付金	423,906.00	-	-	-	423,906.00
存出保证金	4,002.92	-	-	-	4,002.92
交易性金融资产	10,359,809.70	12,785,018.50	-	-	23,144,828.20
买入返售金融资产	3,000,000.00	-	-	-	3,000,000.00
应收清算款	-	-	-	738.49	738.49
应收申购款	-	-	-	2,725.83	2,725.83
资产总计	13,814,986.46	12,785,018.50	-	3,464.32	26,603,469.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,103.95	2,103.95
应付管理人报酬	-	-	-	4,622.96	4,622.96
应付托管费	-	-	-	1,849.18	1,849.18
应付销售服务费	-	-	-	1,921.21	1,921.21
其他负债	-	-	-	54,390.78	54,390.78
负债总计	-	-	-	64,888.08	64,888.08
利率敏感度缺	13,814,986.46	12,785,018.50	-	-61,423.76	26,538,581.20

口					
上年度末 2023年12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	370,735.77	-	-	-	370,735.77
结算备付金	574,604.47	-	-	-	574,604.47
存出保证金	17,495.46	-	-	-	17,495.46
交易性金融资产	11,267,340.29	21,755,725.56	-	-	33,023,065.85
买入返售金融资产	5,699,316.29	-	-	-	5,699,316.29
应收申购款	-	-	-	140,326.31	140,326.31
资产总计	17,929,492.28	21,755,725.56	-	140,326.31	39,825,544.15
负债					
应付清算款	-	-	-	307,265.13	307,265.13
应付赎回款	-	-	-	58,926.57	58,926.57
应付管理人报酬	-	-	-	7,043.41	7,043.41
应付托管费	-	-	-	2,817.38	2,817.38
应付销售服务费	-	-	-	3,724.99	3,724.99
其他负	-	-	-	34,500.00	34,500.00

债					
负债总计	-	-	-	414,277.48	414,277.48
利率敏感度缺口	17,929,492.28	21,755,725.56	-	-273,951.17	39,411,266.67

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	-53,412.85	-122,822.01
	2.利率下降25个基点	53,714.06	123,654.38

#### 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，同时不投资于公司债、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。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	23,144,828.20	33,023,065.85
第三层次	-	-
合计	23,144,828.20	33,023,065.85

##### 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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	23,144,828.20	87.00
	其中：债券	23,144,828.20	87.00
	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	3,000,000.00	11.28
	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	451,173.84	1.70
8	其他各项资产	7,467.24	0.03
9	合计	26,603,469.28	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期内未持有股票。

## 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	23,144,828.20	87.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-



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	23,144,828.20	87.21

### 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	019693	22国债28	67,000	6,805,156.96	25.64
2	019691	22国债26	55,000	5,624,946.44	21.20
3	019696	23国债03	40,000	4,086,664.11	15.40
4	019709	23国债16	35,000	3,554,652.74	13.39
5	019723	23国债20	30,000	3,073,407.95	11.58

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期本基金未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期本基金未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 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。

**7.12.2** 本基金本报告期内未持有股票。

**7.12.3 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	4,002.92
2	应收清算款	738.49
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,725.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,467.24

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末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**

本基金本报告期末未持有股票。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§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	持有	户均持有的	持有人结构
----	----	-------	-------

级别	人户数 (户)	基金份额	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	1,495	9,044.44	0.00	0.00%	13,521,438.27	100.00%
中科 沃土 沃安 中短 利率 债券C	1,369	6,128.91	47,200.98	0.56%	8,343,270.25	99.44%
合计	2,864	7,650.81	47,200.98	0.22%	21,864,708.52	99.78%

### 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	1,104.15	0.0082%
	中科沃土沃安中短利率债券C	1,864.96	0.0222%
	合计	2,969.11	0.0136%

### 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情况

截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资、研究部门负责人和本基金基金经理未持有本开放式基金份额。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	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(2019年03月18日)基金份额总额	48,838,582.97	-
本报告期期初基金份额总额	18,267,507.45	15,097,803.29
本报告期基金总申购份额	3,379,842.51	18,715,379.32
减：本报告期基金总赎回份额	8,125,911.69	25,422,711.38
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,521,438.27	8,390,471.23

注：本基金C类份额合同生效日为2019年3月18日，生效当日份额为0。

## §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	
长江证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	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		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
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	27,442,540.15	100.00%	547,730,000.00	100.00%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

**10.8 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	中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金2023年第四季度报告	中国证券报	2024-01-19
2	中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金2023年年度报告	中国证券报	2024-03-29
3	中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金2024年第一季度报告	中国证券报	2024-04-22
4	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	中国证券报	2024-05-13
5	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	中国证券报	2024-05-20

6	中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金招募说明书更新	中国证券报	2024-06-05
7	中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新A类份额	中国证券报	2024-06-05
8	中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新C类份额	中国证券报	2024-06-05
9	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	2024-06-24
10	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	中国证券报	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	20240104 - 20240114	-	9,212,257.94	9,212,257.94	-	-
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>							

## §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  
二〇二四年八月二十八日