中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 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:2026 年 03 月 31 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2026年3月25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。

本报告中财务资料已经审计。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为基金财务出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2025年1月1日起至12月31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、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 10
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
4.9 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 16
§5 托管人报告 16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
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 16
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 16
§6 审计报告 16
6.1 审计报告基本信息 16
6.2 审计报告的基本内容 17
§7 年度财务报表 20
7.1 资产负债表 20
7.2 利润表 21
7.3 净资产变动表 23
7.4 报表附注 25
§8 投资组合报告 52
8.1 期末基金资产组合情况 52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 53
8.3 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 53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 53
8.6 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 54
8.7 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 54
8.8 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 54
8.9 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 54
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 54

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....55
8.12 投资组合报告附注.....55
§9 基金份额持有人信息.....55
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....56
9.3 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.....56
§10 开放式基金份额变动.....56
§11 重大事件揭示.....57
11.1 基金份额持有人大会决议.....57
11.2 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.....57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....57
11.4 基金投资策略的改变.....57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....57
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....58
11.8 其他重大事件.....59
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....62
12.1 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.....62
§13 备查文件目录.....62
13.1 备查文件目录.....62
13.2 存放地点.....63
13.3 查阅方式.....63

§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	13,651,640.12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	10,569,701.03份	3,081,939.09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		钟光正	蔡建

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	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
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26
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、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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025年		2024年		2023年	
	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	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	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	175,851.14	49,507.90	398,586.26	199,999.89	394,164.39	300,969.41
本期利润	131,057.49	28,241.74	430,239.79	215,692.21	426,672.28	298,957.19
加权平均基金份额本期利润	0.0135	0.0071	0.0305	0.0222	0.0267	0.0168
本期加权平均净值利润率	1.03%	0.65%	2.36%	2.06%	2.11%	1.59%
本期基金份额净值增长率	1.04%	0.77%	2.34%	2.09%	2.24%	2.31%
3.1.2 期末数据和指标	2025年末		2024年末		2023年末	
期末可供分配利润	-8,480,774.19	-3,127,354.70	-8,666,506.89	-6,800,865.01	-15,513,506.68	-15,824,936.71
期末可供分配基金份额利润	-0.8024	-1.0147	-0.8204	-1.0269	-0.8492	-1.0482
期末基金资产净值	13,966,550.56	3,374,425.59	13,814,466.51	7,195,447.11	23,343,279.72	16,067,986.95
期末基金份额净值	1.3214	1.0949	1.3078	1.0865	1.2779	1.0643
3.1.3 累计期末指标	2025年末		2024年末		2023年末	
基金份额累计净值增长率	40.09%	19.13%	38.65%	18.22%	35.48%	15.80%

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

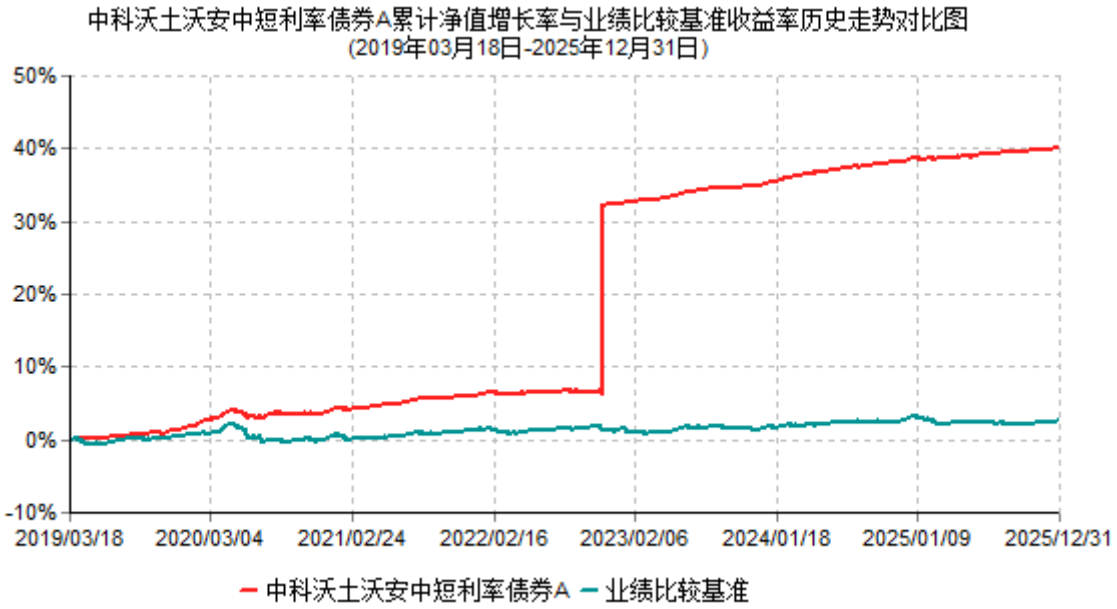
中科沃土沃安中短利率债券A

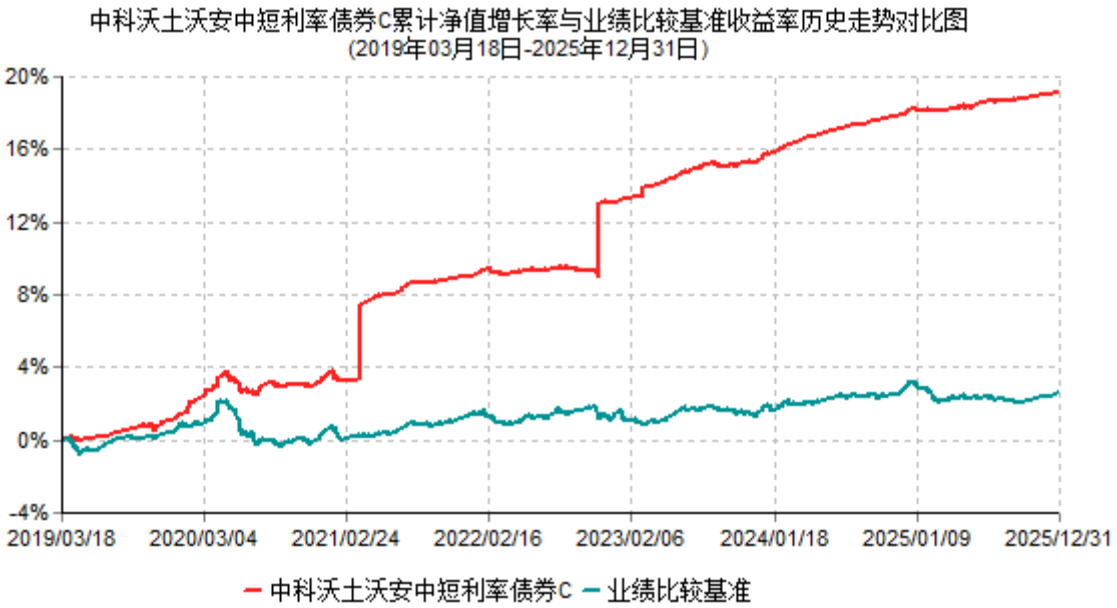
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.36%	0.01%	0.47%	0.01%	-0.11%	0.00%
过去六个月	0.58%	0.01%	0.19%	0.02%	0.39%	-0.01%
过去一年	1.04%	0.02%	-0.63%	0.03%	1.67%	-0.01%
过去三年	5.72%	0.02%	0.90%	0.04%	4.82%	-0.02%
过去五年	34.38%	0.70%	1.92%	0.04%	32.46%	0.66%
自基金合同生效起至今	40.09%	0.60%	2.57%	0.04%	37.52%	0.56%

中科沃土沃安中短利率债券C

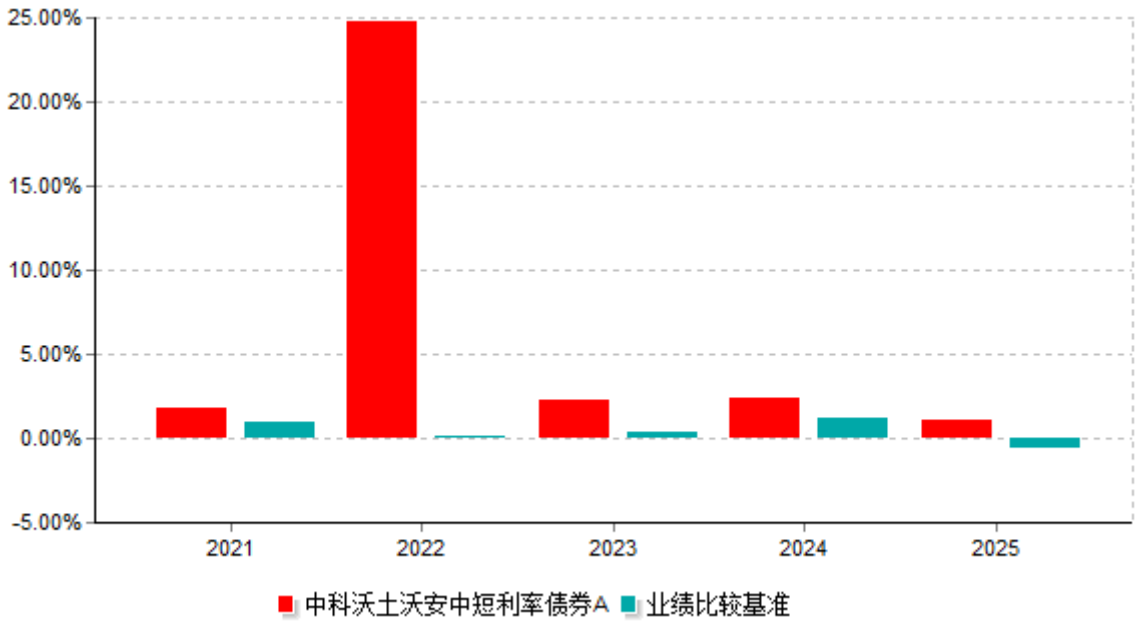
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.29%	0.01%	0.47%	0.01%	-0.18%	0.00%
过去六个月	0.44%	0.01%	0.19%	0.02%	0.25%	-0.01%
过去一年	0.77%	0.02%	-0.63%	0.03%	1.40%	-0.01%
过去三年	5.25%	0.03%	0.90%	0.04%	4.35%	-0.01%
过去五年	14.94%	0.16%	1.92%	0.04%	13.02%	0.12%
自基金合同生效起至今	19.13%	0.14%	2.57%	0.04%	16.56%	0.10%

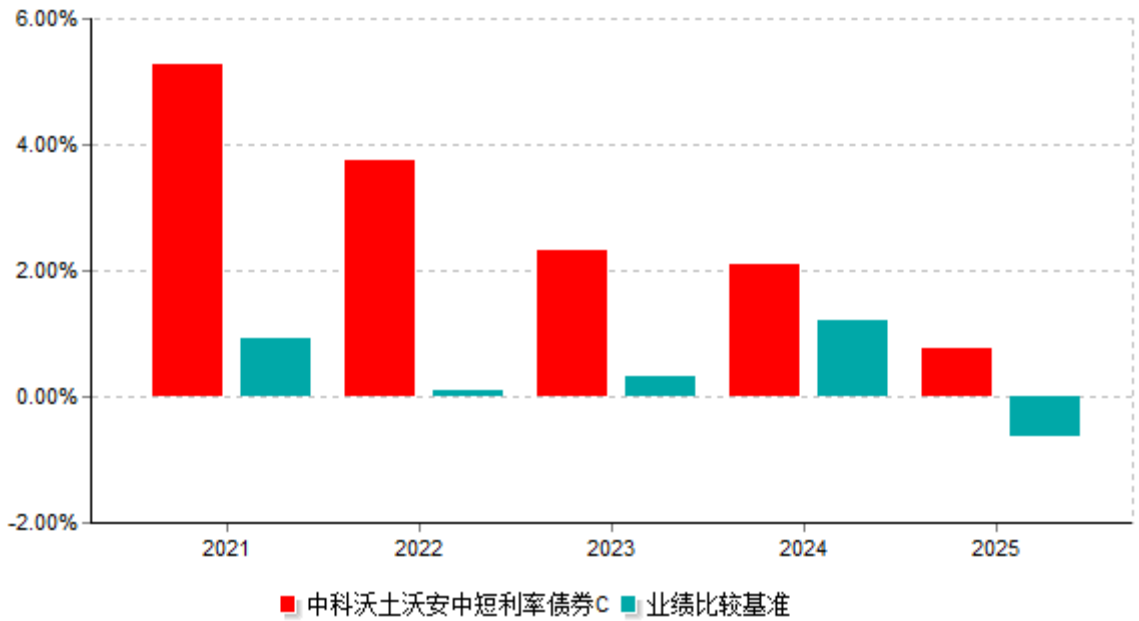
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

§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。中科沃土始终贯彻“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2025年12月31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	基金经理	2022-05-26	2025-06-25	12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，曾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。
卢振荣	公司总经理助理、固定收益部总经理、基	2025-03-05	-	17年	理学硕士。曾任东莞农商银行总行公司部客户经理、资

	金经理				金中心债券交易岗和票据交易岗，广东省农村信用社资金调剂中心交易员，广东南粤银行金融市场部主管、金融市场部债券交易部总经理、资金运营中心债券部总经理助理，现任中科沃土基金管理有限公司总经理助理、固定收益部总经理，中科沃土基金管理有限公司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、中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金、中科沃土沃盛纯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；
3.董清源自2025年6月25日起不再担任此基金的基金经理，已于2025年6月26日公告。

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中科沃土基金管理有限公司公平交易管理办法》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、交易执行的内部控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各投资组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统的公平交易功能将自动启用，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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。

4.3.3 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

2025年世界经济增长动能不足，美国的高关税政策将一定程度上提高全球贸易壁垒，通过贸易部门影响我国外需。同时，全球地缘局势动荡加剧，部分关键物资的需求上升带动价格上涨。全球利率地位运行的背景下，货币环境维持宽松。在当前市场环境下，

本基金继续强化资产配置的灵活性与期限结构的动态调整能力，同时在信用利差策略中注重风险控制，避免过度下沉。此外，流动性管理策略应进一步优化，以应对潜在的市场波动与监管政策变化。

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1.3214元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.04%，同期业绩比较基准收益率为-0.63%；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1.0949元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.77%，同期业绩比较基准收益率为-0.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026年中国宏观经济总量运行趋势呈现稳中向好的基本面特征。IMF在2026年1月发布的《世界经济展望报告》中，将2026年中国经济增长预期上调至5%，并指出中国对全球经济增长的贡献率将维持在30%左右，凸显了中国经济在全球经济中的核心地位 。宏观政策在2026年将延续“稳中求进”的基调，财政与货币政策协同发力支撑经济增长。2026年财政与货币政策的配合模式预计对债市压力小于2025年，债市整体维持区间震荡格局，交易机会将随10年期国债收益率接近或达到1.9%而显现。外部环境变化对中国经济运行的影响总体可控，但需警惕潜在风险因素。一方面，主要发达经济体需求保持稳健增长，叠加中美经贸关系有望企稳，中国外部需求仍将维持较快增长；另一方面，全球经济增长趋缓、地缘政治紧张局势升级以及美国贸易摩擦可能再次升温，均构成潜在风险。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规、监管要求的变化和业务发展的实际需要，围绕严守"三条底线"、防控内幕交易等进一步完善公司内部风险控制，强化制度的完善及对制度执行情况的监督检查，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，有效保证了旗下基金运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。主要监察稽核工作及措施如下：

（1）结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际，不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，适应公司产品与业务发展的需要，保持公司良好的内控环境。

（2）严守合规底线、开展合规风险管理工作是监察稽核工作的重中之重。围绕重点开展对全体员工的合规培训教育,促进公司合规文化建设；不断完善相关机制流程，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易和市场操纵等违法违规行为，完善利益冲突管理相关制度机制。

（3）坚持规范运作、稳健经营的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统，积极配合各类新产品、新业务、新投资工具的推出和应用，重点加强对高风险业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，加强对投资、交易等业务运作的日常合规检查和反馈提示，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规和基金合同的要求稳健、规范运作。

（4）对投资交易、销售宣传、人员规范及个人投资申报、运营维稳、反洗钱、IT治理等方面开展了定期或专项监察检查，推动公司合规、内控体系的健全完善。

（5）积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关的合规、风控问题提供意见和建议。

（6）切实把好法律风险和业务风险关；根据公司业务发展的需要，紧贴业务需求，不断提高合同审核效率，有效控制法律风险和业务风险；

（7）深入贯彻风险为本的监管精神，加强公司洗钱风险管理体系建设，建立优化客户、产品、业务的洗钱风险识别和洗钱风险自评估工作机制，探索实施符合基金业务特征的可疑交易监控模型和方法，开展反洗钱宣传培训、内部审计、信息报送、意见反馈等各项工作。

（8）紧跟法规变化和业务发展，认真做好公司及旗下各基金的各项信息披露工作，力求信息披露真实、完整、准确、及时、简明易懂。

（9）不断促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，充分法规合规监控与监察稽核的独立性、规范性、针对性与有效性。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 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资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。

4.8 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。

4.9 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《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损害基金份额持有人利益的行为。

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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2026]200Z0217号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了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"中科沃土沃安中短利率债券基金"）财务报表，包括2025年12月31日的资产负债表，2025年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）、中国证券投资基金业协会（以下简称"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，公允反映了中科沃土沃安中短利率债券基金2025年12月31日的财务状况以及2025年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于中科沃土沃安中短利率债券基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	中科沃土沃安中短利率债券基金的基金管理人中科沃土基金管理有限公司（以下简称"基金管理人"）管理层对其他信息负责。其他信息包括中科沃土沃安中短利率债券基金2025年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报

	告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中科沃土沃安中短利率债券基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中科沃土沃安中短利率债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督中科沃土沃安中短利率债券基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运

	用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中科沃土沃安中短利率债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中科沃土沃安中短利率债券基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	沈兆杰	姜爱悦
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1	

	至1001-26
审计报告日期	2026-03-25

§7 年度财务报表

7.1 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：2025年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	41,035.78	63,846.46
结算备付金		159,346.05	372,725.44
存出保证金		1,817.09	5,290.42
交易性金融资产	7.4.7.2	14,648,202.27	17,763,878.36
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		14,648,202.27	17,763,878.36
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	2,416,319.20	2,799,811.29
应收清算款		2,127.40	377.42
应收股利		-	-
应收申购款		105,859.30	61,355.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	18,000.00	4,500.00
资产总计		17,392,707.09	21,071,785.12
负债和净资产	**附注号**	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		42,518.13	38,641.29
应付管理人报酬		2,801.54	3,501.98
应付托管费		1,120.61	1,400.80
应付销售服务费		718.19	1,423.06
应付投资顾问费		-	-
应交税费		72.47	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	4,500.00	16,904.37
负债合计		51,730.94	61,871.50
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	13,651,640.12	17,186,123.13
未分配利润	7.4.7.9	3,689,336.03	3,823,790.49
净资产合计		17,340,976.15	21,009,913.62
负债和净资产总计		17,392,707.09	21,071,785.12

注：报告截止日2025年12月31日，基金份额总额13,651,640.12份。其中，A类基金份额总额10,569,701.03份，基金份额净值1.3214元；C类基金份额总额3,081,939.09份，基金份额净值1.0949元。

7.2 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：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月0

			1日至2024年12月31日
一、营业总收入		219,201.94	776,297.70
1.利息收入		20,510.36	86,484.72
其中：存款利息收入	7.4.7.10	747.96	7,346.04
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		19,762.40	79,138.68
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		261,301.16	640,714.00
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	261,301.16	640,714.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-66,059.81	47,345.85
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	3,450.23	1,753.13
减：二、营业总支出		59,902.71	130,365.70
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	34,371.21	57,547.81
2.托管费	7.4.10.2.2	13,748.64	23,019.12
3.销售服务费	7.4.10.2.3	11,023.67	26,183.45
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		741.42	-
其中：卖出回购金融资产支出		741.42	-

6.信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7.税金及附加		7.77	-
8.其他费用	7.4.7.20	10.00	23,615.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		159,299.23	645,932.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		159,299.23	645,932.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		159,299.23	645,932.00

7.3 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：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项 目	**本期 2025年01月01日至2025年12月31日**		
	实收基金	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产	17,186,123.13	3,823,790.49	21,009,913.62
二、本期期初净资产	17,186,123.13	3,823,790.49	21,009,913.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,534,483.01	-134,454.46	-3,668,937.47
（一）、综合收益总额	-	159,299.23	159,299.23
（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）	-3,534,483.01	-293,753.69	-3,828,236.70
其中：1.基金申购款	10,654,862.08	2,684,855.49	13,339,717.57

2.基金赎回款	-14,189,345.09	-2,978,609.18	-17,167,954.27
（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	13,651,640.12	3,689,336.03	17,340,976.15
项 目	**上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31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）	-16,179,187.61	-2,222,165.44	-18,401,353.05
（一）、综合收益总额	-	645,932.00	645,932.00
（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）	-16,179,187.61	-2,868,097.44	-19,047,285.05
其中：1.基金申购款	38,169,321.73	3,756,225.11	41,925,546.84
2.基金赎回款	-54,348,509.34	-6,624,322.55	-60,972,831.89
（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	17,186,123.13	3,823,790.49	21,009,913.62

产			

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

钟光正	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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

本财务报表由本基金的基金管理人中科沃土基金管理有限公司于2026年3月25日批准报出。

7.4.2 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。

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。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1)金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2)金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险

为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，具体收益分配安排详见基金管理人届时公告；

2、每季度最后一个工作日，在符合有关基金分红条件的前提下，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的90%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

4、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下交易性金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券及可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券及可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
活期存款	41,035.78	63,846.46
等于：本金	41,025.32	63,833.29
加：应计利息	10.46	13.17
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	41,035.78	63,846.46

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年12月31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	交易所市场	14,526,656.13	123,462.27	14,648,202.27	-1,916.13

券	银行间市场	-	-	-	-
	合计	14,526,656.13	123,462.27	14,648,202.27	-1,916.13
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		14,526,656.13	123,462.27	14,648,202.27	-1,916.13
项目		上年度末 2024年12月31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	17,526,056.32	173,678.36	17,763,878.36	64,143.68
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	17,526,056.32	173,678.36	17,763,878.36	64,143.68
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		17,526,056.32	173,678.36	17,763,878.36	64,143.68

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2025年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,416,319.20	-
银行间市场	-	-
合计	2,416,319.20	-

项目	上年度末 2024年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,799,811.29	-
银行间市场	-	-
合计	2,799,811.29	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应收利息	-	-
其他应收款	18,000.00	4,500.00
待摊费用	-	-
合计	18,000.00	4,500.00

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31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	4,500.00	16,904.37
合计	4,500.00	16,904.37

7.4.7.8 实收基金

7.4.7.8.1 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 2025年01月01日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,563,318.54	10,563,318.54
本期申购	7,685,410.72	7,685,410.72
本期赎回（以“-”号填列）	-7,679,028.23	-7,679,028.23
本期末	10,569,701.03	10,569,701.03

7.4.7.8.2 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 2025年01月01日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,622,804.59	6,622,804.59
本期申购	2,969,451.36	2,969,451.36
本期赎回（以“-”号填列）	-6,510,316.86	-6,510,316.86
本期末	3,081,939.09	3,081,939.09

7.4.7.9 未分配利润

7.4.7.9.1 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	-8,666,506.89	11,917,654.86	3,251,147.97
本期期初	-8,666,506.89	11,917,654.86	3,251,147.97
本期利润	175,851.14	-44,793.65	131,057.49
本期基金份额交易产生的变动数	9,881.56	4,762.51	14,644.07
其中：基金申购款	-6,216,231.09	8,639,073.62	2,422,842.53
基金赎回款	6,226,112.65	-8,634,311.11	-2,408,198.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,480,774.19	11,877,623.72	3,396,849.53

7.4.7.9.2 中科沃土沃安中短利率债券C

单位：人民币元

项目 (中科沃土沃安中短利率债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,800,865.01	7,373,507.53	572,642.52
本期期初	-6,800,865.01	7,373,507.53	572,642.52
本期利润	49,507.90	-21,266.16	28,241.74
本期基金份额交易产生的变动数	3,624,002.41	-3,932,400.17	-308,397.76
其中：基金申购款	-3,037,932.09	3,299,945.05	262,012.96
基金赎回款	6,661,934.50	-7,232,345.22	-570,410.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,127,354.70	3,419,841.20	292,486.50

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
活期存款利息收入	303.05	529.05
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	431.19	6,738.71
其他	13.72	78.28
合计	747.96	7,346.04

7.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	267,724.35	524,951.85
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,423.19	115,762.15
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	261,301.16	640,714.00

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	18,102,274.90	43,894,171.97

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,862,809.19	43,322,673.85
减：应计利息总额	245,888.90	455,735.97
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-6,423.19	115,762.15

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
1.交易性金融资产	-66,059.81	47,345.85
——股票投资	-	-
——债券投资	-66,059.81	47,345.85
——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	-66,059.81	47,345.85

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
基金赎回费收入	3,450.19	1,753.13
转换费收入	0.04	-
合计	3,450.23	1,753.13

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。

7.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
审计费用	-	12,404.37
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
账户维护费	10.00	11,210.95
合计	10.00	23,615.32

注: 根据中科沃土基金管理有限公司的决议，本报告期及上年度可比期内本基金管理人承担了本基金部分基金费用，如审计费用等相关费用。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至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。

7.4.9 关联方关系

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、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
珠海横琴沃泽投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海横琴沃信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
广州西拓投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海横琴沃富投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海横琴沃智投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海横琴沃土投资有限公司	基金管理人的股东
珠海横琴沃海投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
广东中广投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东普瑞投资发展合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
广东省粤科金融集团有限公司	基金管理人的股东
广东中科科创创业投资管理有限责任公司	基金管理人的股东

注：1.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2.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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的基金交易。

7.4.10.1.6 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	34,371.21	57,547.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	17,156.72	27,259.99
应支付基金管理人的净管理费	17,214.49	30,287.82

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	13,748.64	23,019.12

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。

7.4.10.2.3 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 2025年01月01日至2025年12月31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	0.00	4.21	4.21
合计	0.00	4.21	4.21
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31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	0.00	1,004.58	1,004.58
合计	0.00	1,004.58	1,004.58

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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

本基金本报告期内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适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 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

本基金本报告期内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适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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

于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.6 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 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31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	41,035.78	303.05	63,846.46	529.05

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。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

根据中科沃土基金管理有限公司的决议，本报告期内本基金管理人承担了本基金部分基金费用，如审计费用等相关费用。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	501,624.52	12,626,254.52
合计	501,624.52	12,626,254.52

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。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	14,146,577.75	5,137,623.84
合计	14,146,577.75	5,137,623.84

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。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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发行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开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。 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。于本年度末，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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2025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	41,035.78	-	-	-	41,035.78
结算备付金	159,346.05	-	-	-	159,346.05
存出保证金	1,817.09	-	-	-	1,817.09
交易性	8,562,494.38	5,267,946.74	817,761.15	-	14,648,202.27

金融资产					
买入返售金融资产	2,416,319.20	-	-	-	2,416,319.20
应收清算款	-	-	-	2,127.40	2,127.40
应收申购款	-	-	-	105,859.30	105,859.30
其他资产	-	-	-	18,000.00	18,000.00
资产总计	11,181,012.50	5,267,946.74	817,761.15	125,986.70	17,392,707.09
负债					
应付赎回款	-	-	-	42,518.13	42,518.13
应付管理人报酬	-	-	-	2,801.54	2,801.54
应付托管费	-	-	-	1,120.61	1,120.61
应付销售服务费	-	-	-	718.19	718.19
应交税费	-	-	-	72.47	72.47
其他负债	-	-	-	4,500.00	4,500.00
负债总计	-	-	-	51,730.94	51,730.94
利率敏感度缺口	11,181,012.50	5,267,946.74	817,761.15	74,255.76	17,340,976.15
上年度末 2024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	63,846.46	-	-	-	63,846.46
结算备付金	372,725.44	-	-	-	372,725.44
存出保证金	5,290.42	-	-	-	5,290.42
交易性金融资产	14,652,076.99	3,111,801.37	-	-	17,763,878.36
买入返售金融资产	2,799,811.29	-	-	-	2,799,811.29
应收清算款	-	-	-	377.42	377.42
应收申购款	-	-	-	61,355.73	61,355.73
其他资产	-	-	-	4,500.00	4,500.00
资产总计	17,893,750.60	3,111,801.37	-	66,233.15	21,071,785.12
负债					
应付赎回款	-	-	-	38,641.29	38,641.29
应付管理人报酬	-	-	-	3,501.98	3,501.98
应付托管费	-	-	-	1,400.80	1,400.80
应付销售服务费	-	-	-	1,423.06	1,423.06
其他负债	-	-	-	16,904.37	16,904.37
负债总计	-	-	-	61,871.50	61,871.50
利率敏	17,893,750.60	3,111,801.37	-	4,361.65	21,009,913.62

感度缺口					

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。

7.4.13.4.1.2 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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
	1.利率上升25个基点	-51,625.02	-26,860.56
	2.利率下降25个基点	52,223.54	26,977.52

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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（上期末：同）。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	14,648,202.27	17,763,878.36
第三层次	-	-
合计	14,648,202.27	17,763,878.36

7.4.14.2.2 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。

本基金本报告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。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上期末：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	14,648,202.27	84.22

	其中：债券	14,648,202.27	84.22
	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	2,416,319.20	13.89
	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	200,381.83	1.15
8	其他各项资产	127,803.79	0.73
9	合计	17,392,707.09	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

本基金本报告期内未持有股票。

8.4.2 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

本基金本报告期内未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

8.5 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	14,648,202.27	84.47
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	14,648,202.27	84.47

8.6 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	019761	24国债24	50,000	4,991,968.49	28.79
2	019696	23国债03	30,000	3,068,901.37	17.70
3	019771	25国债06	25,000	2,540,550.00	14.65
4	019779	25国债10	18,000	1,822,392.00	10.51
5	019790	25国债17	9,000	905,004.74	5.22

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 本基金本报告期内未持有股票。

8.12.3 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	1,817.09
2	应收清算款	2,127.40
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	105,859.30
6	其他应收款	18,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	127,803.79

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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	1,470	7,190.27	7.58	0.00%	10,569,693.45	100.00%
中科沃土沃安中短利率债券C	773	3,986.98	918.36	0.03%	3,081,020.73	99.97%
合计	2,243	6,086.33	925.94	0.01%	13,650,714.18	99.99%

9.2 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	292.64	0.0028%
	中科沃土沃安中短利率债券C	0.00	0.00%
	合计	292.64	0.0021%

9.3 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

本报告期末本公司高级管理人员、基金投资和研究未持有本开放式基金份额。

§10 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	10,563,318.54	6,622,804.59
本报告期基金总申购份额	7,685,410.72	2,969,451.36
减：本报告期基金总赎回份额	7,679,028.23	6,510,316.86
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,569,701.03	3,081,939.09

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。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，本基金管理人解聘林青公司副总经理职务，于2025年12月11日公告。本报告期内，本基金托管人聘任杨华为资产托管部总经理助理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略无重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内为基金进行审计的会计师事务所为容诚会计师事务所（特殊普通合伙），本年度支付给容诚会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用15,000.00元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	中科沃土基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025年08月26日

采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正
受到调查或处罚等措施的原因	其他问题（财务指标）
受到处罚的依据	违反《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》的规定
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人目前正积极推进整改进度。
其他	-

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内管理人相关从业人员未受到调查或处罚的情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人未受到调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何调查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-

证券(原海通)						

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。

11.7.2 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	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	24,402,046.22	97.92%	215,090,000.00	100.00%	-	-	-	-
国泰海通证券(原海通)	518,391.44	2.08%	-	-	-	-	-	-

11.8 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债券型证券投资基金2024年第四季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025-01-21

2	中科沃土基金管理有限公司关于新增盈米基金为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-01-22
3	中科沃土基金管理有限公司关于新增汇成基金为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-01-22
4	中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-06
5	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	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-08
6	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	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-08
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	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-08
8	中科沃土基金管理有限公司关于变更上海分公司地址的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-27
9	中科沃土基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年度）	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-31
10	中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金2024年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-31
11	中科沃土基金管理有限公司关于新增攀赢基金为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-04-15
12	中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金2025年	中国证监会规定报刊及网站	2025-04-22

	第一季度报告		
13	中科沃土基金管理有限公司关于新增上海联泰基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-05-28
14	中科沃土基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理基金相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-05-28
15	中科沃土基金管理有限公司关于新增上海天天基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-06-18
16	中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-06-26
17	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	中国证监会规定报刊及网站	2025-06-28
18	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	中国证监会规定报刊及网站	2025-06-28
19	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	中国证监会规定报刊及网站	2025-06-28
20	中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金2025年第二季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025-07-18
21	中科沃土基金管理有限公司关于终止中国人寿保险股份有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-08-14
22	中科沃土基金管理有限公司	中国证监会规定报刊及网站	2025-08-15

	关于旗下基金估值调整的公告		
23	中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金2025年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2025-08-29
24	中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金2025年第三季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025-10-28
25	关于不法分子冒用中科沃土基金管理有限公司名义从事诈骗活动的风险提示	中国证监会规定报刊及网站	2025-10-30
26	中科沃土基金管理有限公司关于新增上海好买基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-11-13
27	中科沃土基金管理有限公司关于新增万得基金为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-12-11
28	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	中国证监会规定报刊及网站	2025-12-11

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§13 备查文件目录

13.1 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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

13.3 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

二〇二六年三月三十一日