

中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：中科沃土基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 22 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，投资者在做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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§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	12
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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18

§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	42
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	42
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.11 投资组合报告附注	42
§8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	44
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	44
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
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 其他重大事件	49
§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	51

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	中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金
基金简称	中科沃土沃祥债券发起
基金主代码	004550
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 6 月 29 日
基金管理人	中科沃土基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	79,716,868.65 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券资产，严格管理股票资产的投资比例，在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金是以债券资产的投资为主的债券型投资基金，通过债券资产的投资获取平稳收益，并适度参与股票资产的投资以增强回报，投资策略主要包括大类资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股票投资策略等。
业绩比较基准	10%*沪深 300 指数收益率+90%*中债综合指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中科沃土基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨敏	郭明
	联系电话	020-23388979	010-66105799
	电子邮箱	yangmin@richlandasm.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-018-3610	95588
传真		020-23388997	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-5668	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		广东省广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 21 楼 01	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	单元自编 06-08 号	
邮政编码	510620	100140
法定代表人	朱为绎	易会满

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、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.richlandasm.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 21 楼

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,325,549.89
本期利润	-1,391,359.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0142
本期加权平均净值利润率	-1.45%
本期基金份额净值增长率	-1.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,183,148.33
期末可供分配基金份额利润	-0.0148
期末基金资产净值	78,548,764.87
期末基金份额净值	0.9853
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-1.47%

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。

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

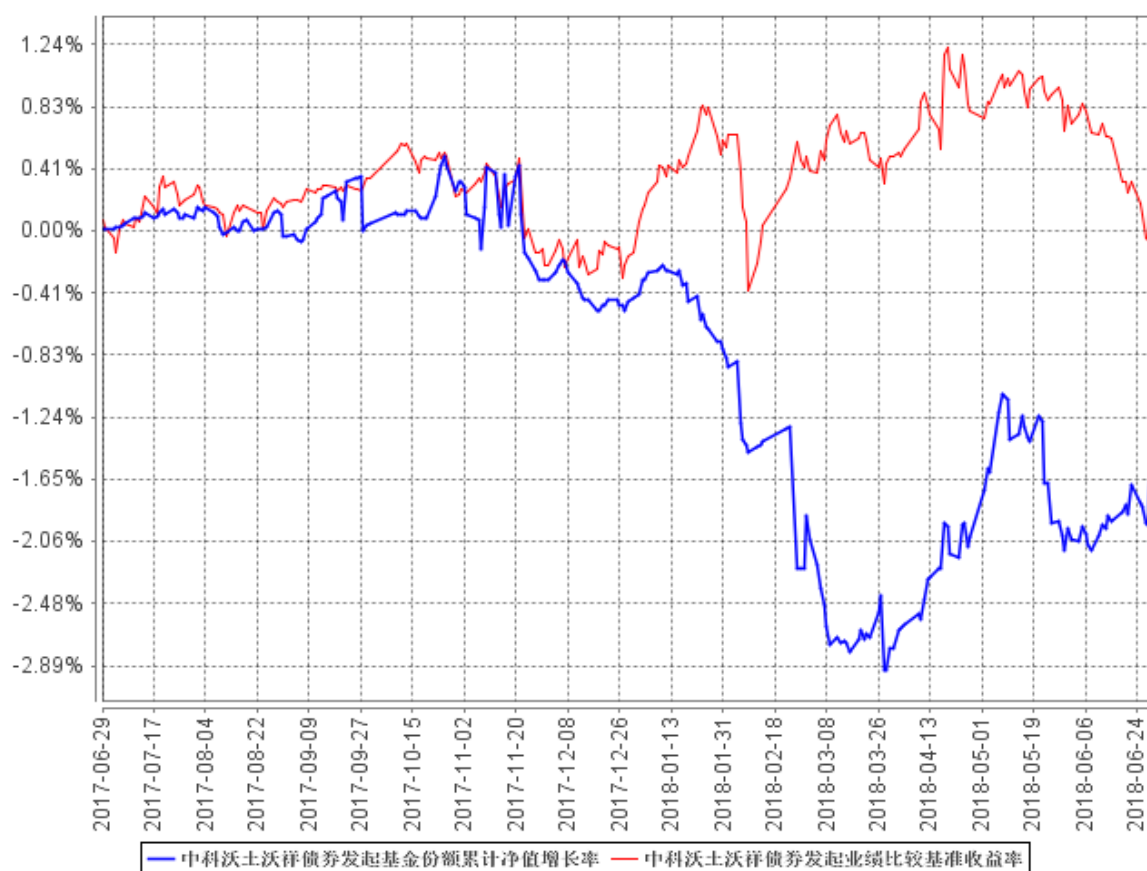
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.52%	0.13%	-0.46%	0.13%	0.98%	0.00%
过去三个月	1.35%	0.15%	-0.09%	0.14%	1.44%	0.01%
过去六个月	-1.02%	0.16%	0.65%	0.13%	-1.67%	0.03%

过去一年	-1.48%	0.13%	0.32%	0.10%	-1.80%	0.03%
自基金合同生效起至今	-1.47%	0.13%	0.34%	0.10%	-1.81%	0.03%

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增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



注：本基金合同于 2017 年 6 月 29 日生效，按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中科沃土基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2015]1937 号文批准，于 2015 年 9 月 6 日正式成立，注册资本 1 亿元，是国内第 101 家公募基金管理公司，也是一家拥有 PE 背景的公募基金管理公司。中科沃土带着中科招商、粤科金融等主要股东强大的精神基因和优秀的文化基因，始终贯彻“持有人利益至上”的首要经营准则，遵循诚信、规范、稳健的经营方针，崇尚价值投资理念和长期、平稳、盈利的投资风格，致力于为持有人提供专业、精品、创新的投资理财服务，创造成长价值，汇聚阳光财富。截至 2018 年 6 月 30 日，中科沃土旗下共管理 5 只开放式基金：中科沃土货币市场基金、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
杨凡	基金经理	2017 年 7 月 5 日	—	6 年	经济学硕士。曾任金鹰基金管理有限公司研究部研究员，广发证券股份有限公司自营部研究员，现任中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金和中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
马洪娟	固定收益部副总经理、基金经理	2017 年 6 月 29 日	—	7 年	金融学博士。曾任金鹰基金管理有限公司研究员、基金经理，现任中科沃土基金管理有限公司固定收益部副总经理、中科沃土货币市场基金和中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金基金经理。中国国籍，具有

					基金从业资格。
李昱	副总经理兼任权益投资部总经理、基金经理	2017 年 6 月 29 日	-	21 年	管理学硕士。曾任广发证券股份有限公司环市东营业部业务经理、投资理财部投资经理、资产管理部投资经理，新华基金管理有限公司专户管理部副总监、专户管理部负责人、基金管理部基金经理、基金管理部副总监，现任中科沃土基金管理有限公司副总经理兼任权益投资部总经理、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金和中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3. 因工作安排，李昱自 2018 年 07 月 26 日离任本基金基金经理。该事项已于 2018 年 07 月 26 日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上进行披露。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年一季度债券市场收益率呈现先上后下的状态，二季度债券市场收益率震荡下行。总体而言，报告期内利率债整体走牛而信用债分化明显，高等级信用债跟随利率债的走势，而中低等级信用债在二季度随着融资环境的大幅恶化、信用风险的逐步暴露的情况下信用利差有所走阔。报告期内本基金债券持仓进行了一定的调整，增配一定量的利率债，适度拉长久期。

报告期内上证综指下行，部分板块和个股存在结构性行情，权益投资部分围绕新经济及大消费产业布局，结构配置以消费、医药为主，仓位根据市场态势动态调整，控制相对得当。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9853 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.02%，业绩比较基准收益率为 0.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年下半年，基本面方面，我们认为下半年经济仍有一定的下行压力，从国内来看，由于资本约束和金融监管，持续低迷的社融可能会使上半年经济所表现出来的韧性难以持续，从外围来看，贸易摩擦仍在持续，从国内外因素来看经济增长均面临一定的不利因素。货币政策方面，在今年融资渠道开正门堵偏门的大环境下，为了确保表内信贷和债券融资能够顺利承接部分表外融资需求，预计货币市场资金仍呈现相对宽松的状态。从通胀来看，通胀水平维持低位运行，通胀担忧基本消除。

本基金债券投资在下半年仍将以利率债和中高等级信用债为主，适度提升组合杠杆和久期。权益投资上仓位根据市场态势动态调整，力争获得持续稳定的绝对收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，定期对估值政策和程序进行评价。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金日常估值由基金事务部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，提出估值建议，确保估值的公允性。监察风控部负责对基金估值程序和方法进行核查，确保估值相关各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

§ 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祥债券型发起式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的有关规定，不存在任何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，中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金的管理人——中科沃土基金管理有限公司在中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中科沃土基金管理有限公司编制和披露的中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	95,119.30	565,530.27
结算备付金		822,572.92	987,308.06
存出保证金		34,370.39	42,036.60
交易性金融资产	6.4.7.2	72,272,579.20	102,733,108.50
其中：股票投资		7,816,154.00	985,508.00
基金投资		-	-
债券投资		64,456,425.20	101,747,600.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	7,500,000.00	22,200,000.00
应收证券清算款		1,806,617.95	66,069.82
应收利息	6.4.7.5	1,253,373.72	1,269,224.21
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		83,784,633.48	127,863,277.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		3,000,000.00	-
应付证券清算款		1,835,628.13	-
应付赎回款		584.36	491,737.42
应付管理人报酬		46,007.25	77,780.73
应付托管费		13,144.93	22,223.05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	118,800.99	59,378.94

应交税费		6,009.38	-
应付利息		1,303.34	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	214,390.23	184,869.64
负债合计		5,235,868.61	835,989.78
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	79,716,868.65	127,601,569.94
未分配利润	6.4.7.10	-1,168,103.78	-574,282.26
所有者权益合计		78,548,764.87	127,027,287.68
负债和所有者权益总计		83,784,633.48	127,863,277.46

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9853 元，基金份额总额 79,716,868.65 份。

6.2 利润表

会计主体：中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 6 月 29 日(基 金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-484,980.15	16,085.31
1.利息收入		1,739,845.19	16,189.28
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,750.13	16,189.28
债券利息收入		1,560,913.31	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		166,181.75	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,170,798.62	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-378,590.86	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,842,212.96	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	50,005.20	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	934,190.15	-103.97
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	11,783.13	-

减：二、费用		906,379.59	6,668.41
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	334,295.74	3,525.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	95,513.09	1,007.31
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	259,417.73	0.01
5. 利息支出		41,821.67	-
其中：卖出回购金融资产支出		41,821.67	-
6. 税金及附加		4,202.12	-
7. 其他费用	6.4.7.20	171,129.24	2,135.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,391,359.74	9,416.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,391,359.74	9,416.90

注：本基金合同生效日为 2017 年 6 月 29 日，上年度可比期间为 2017 年 6 月 29 日至 2017 年 6 月 30 日，上年度可比期间不完整。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	127,601,569.94	-574,282.26	127,027,287.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,391,359.74	-1,391,359.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-47,884,701.29	797,538.22	-47,087,163.07
其中：1.基金申购款	6,779.31	-62.80	6,716.51
2.基金赎回款	-47,891,480.60	797,601.02	-47,093,879.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-	-

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	79,716,868.65	-1,168,103.78	78,548,764.87
项目	上年度可比期间 2017 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,416.90	9,416.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	183,824,290.09	-	183,824,290.09
其中：1.基金申购款	183,824,290.09	-	183,824,290.09
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	183,824,290.09	9,416.90	183,833,706.99

注：本基金合同生效日为 2017 年 6 月 29 日，上年度可比期间为 2017 年 6 月 29 日至 2017 年 6 月 30 日，上年度可比期间不完整。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金注

册的批复》（证监许可〔2017〕423 号），由基金发起人中科沃土基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）发起募集。本基金募集资金经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审验，并由其出具《验证报告》（安永华明（2017）验字第 61247680_G03 号）。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2017 年 6 月 29 日正式生效。本基金的基金管理人为中科沃土基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为：包括国内依法发行上市的债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、证券公司短期公司债、中期票据、地方政府债、次级债、可转换公司债、可交换公司债、短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、协议存款、通知存款、银行存款和国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金在本报告期间无需说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税〔2008〕1号)、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2012〕85号)、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2015〕101号)、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36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〕46号)、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》(财税〔2016〕70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〔2016〕140号)及其他相关税务法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(一) 2016 年 5 月 1 日起, 金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税, 对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入, 暂免征收企业所得税。

(三) 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50%计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入, 由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	95,119.30

定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	95,119.30

注：根据定期存款协议的规定，上述定期存款若提前支取，利息收入仍然按照原协议利率与实际天数计算。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	7,568,302.88	7,816,154.00	247,851.12
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	57,498,402.70	56,955,625.20
	银行间市场	7,648,689.32	7,500,800.00
	合计	65,147,092.02	64,456,425.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	72,715,394.90	72,272,579.20	-442,815.70

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期内无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 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	-	-
买入返售证券	7,500,000.00	-

合计	7,500,000.00	-
----	--------------	---

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	139.66
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	370.20
应收债券利息	1,255,077.84
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-2,229.38
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	15.40
合计	1,253,373.72

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	118,648.49
银行间市场应付交易费用	152.50
合计	118,800.99

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	0.43
预提费用	214,389.80
合计	214,390.23

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	127,601,569.94	127,601,569.94
本期申购	6,779.31	6,779.31
本期赎回(以“-”号填列)	-47,891,480.60	-47,891,480.60
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	79,716,868.65	79,716,868.65

注：期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	639,382.87	-1,213,665.13	-574,282.26
本期利润	-2,325,549.89	934,190.15	-1,391,359.74
本期基金份额交易产生的变动数	503,018.69	294,519.53	797,538.22
其中：基金申购款	-14.41	-48.39	-62.80
基金赎回款	503,033.10	294,567.92	797,601.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,183,148.33	15,044.55	-1,168,103.78

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,309.06
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	6,108.08
其他	332.99
合计	12,750.13

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	95,131,900.60
减：卖出股票成本总额	95,510,491.46
买卖股票差价收入	-378,590.86

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	199,859,932.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	198,181,764.66
减：应收利息总额	4,520,380.50
买卖债券差价收入	-2,842,212.96

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

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	50,005.20
基金投资产生的股利收益	-
合计	50,005.20

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	934,190.15
——股票投资	262,014.27
——债券投资	672,175.88
——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	934,190.15

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	11,772.58
基金转换费收入	10.55
合计	11,783.13

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	258,762.73
银行间市场交易费用	655.00
合计	259,417.73

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	11,124.09

信息披露费	148,765.71
银行汇划费	2,239.44
账户维护费	9,000.00
其他	—
合计	171,129.24

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中科沃土基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构，基金发起人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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无需支付关联方佣金。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017年6月29日(基金合同生效日) 至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	334,295.74	3,525.59
其中：支付销售机构的客户维护费	115,627.86	2,368.14

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年6月29日(基金合同生效日) 至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	95,513.09	1,007.31

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2017 年 6 月 29 日）持有的基金份额	-	10,000,000.00
期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	12.54%	7.87%

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 6 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	95,119.30	6,309.06	168,824,090.09	1,783.33

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止, 本基金无因认购新发/增发而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

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止, 本基金未持有暂时停牌流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止, 本基金未从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款, 无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,000,000.00 元, 于 2018 年 7 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

从投资决策的层次看, 投资决策委员会、投资部门负责人和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控, 并根据其不同权限实施风险控制; 从岗位职能的分工上看, 基金经理、监察风控部、集中交易部和基金事务部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理; 从

投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 38.69%。

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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	8,287,720.00
合计	0.00	8,287,720.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年（含）以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券、同业存单。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
--------	------------------------	--------------------------

A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年（含）以内的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年（含）以内的同业存单。

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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	4,935,000.00	0.00
AAA 以下	29,132,436.80	93,458,880.50
未评级	30,388,988.40	0.00
合计	64,456,425.20	93,458,880.50

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	95,119.30	-	-	-	95,119.30
结算备付金	822,572.92	-	-	-	822,572.92
存出保证金	34,370.39	-	-	-	34,370.39
交易性金融资产	32,669,425.80	24,286,199.40	7,500,800.00	7,816,154.00	72,272,579.20
买入返售金融资产	7,500,000.00	-	-	-	7,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,806,617.95	1,806,617.95
应收利息	-	-	-	1,253,373.72	1,253,373.72
资产总计	41,121,488.41	24,286,199.40	7,500,800.00	10,876,145.67	83,784,633.48
负债					
卖出回购金融资产款	3,000,000.00	-	-	-	3,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	1,835,628.13	1,835,628.13
应付赎回款	-	-	-	584.36	584.36
应付管理人报酬	-	-	-	46,007.25	46,007.25
应付托管费	-	-	-	13,144.93	13,144.93
应付交易费用	-	-	-	118,800.99	118,800.99
应付利息	-	-	-	1,303.34	1,303.34
应交税费	-	-	-	6,009.38	6,009.38
其他负债	-	-	-	214,390.23	214,390.23
负债总计	3,000,000.00	-	-	2,235,868.61	5,235,868.61
利率敏感度缺口	38,121,488.41	24,286,199.40	7,500,800.00	8,640,277.06	78,548,764.87
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	565,530.27	-	-	-	565,530.27
结算备付金	987,308.06	-	-	-	987,308.06
存出保证金	42,036.60	-	-	-	42,036.60
交易性金融资产	92,442,600.50	-	9,305,000.00	985,508.00	102,733,108.50
买入返售金融资产	22,200,000.00	-	-	-	22,200,000.00
应收证券清算款	-	-	-	66,069.82	66,069.82
应收利息	-	-	-	1,269,224.21	1,269,224.21
资产总计	116,237,475.43	-	9,305,000.00	2,320,802.03	127,863,277.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	491,737.42	491,737.42
应付管理人报酬	-	-	-	77,780.73	77,780.73

应付托管费	-	-	-	22,223.05	22,223.05
应付交易费用	-	-	-	59,378.94	59,378.94
其他负债	-	-	-	184,869.64	184,869.64
负债总计	-	-	-	835,989.78	835,989.78
利率敏感度缺口	116,237,475.43	-9,305,000.00	1,484,812.25	127,027,287.68	

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	利率上升 25 个基点	-173,866.30	-638,497.86
	利率下降 25 个基点	173,866.30	638,497.86

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	7,816,154.00	9.95	101,746,600.50	80.11
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	64,456,425.20	82.06		
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	72,272,579.20	92.01	101,746,600.50	80.11

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	28,346.47	33,390.95
	业绩比较基准下降 5%	-28,346.47	-33,390.95

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参考最近一期年报。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 7,816,154.00 元，属于第二层级的余额为 64,456,425.20 元，无属于第三层级的余额。（2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 985,508.00 元，属于第二层级的余额为 101,747,600.5 元，无属于第三层级的余额。）

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值

列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

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	7,816,154.00	9.33
	其中：股票	7,816,154.00	9.33
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	64,456,425.20	76.93
	其中：债券	64,456,425.20	76.93
	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	7,500,000.00	8.95
	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	917,692.22	1.10
8	其他各项资产	3,094,362.06	3.69
9	合计	83,784,633.48	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	5,108,889.00	6.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	62,190.00	0.08

F	批发和零售业	265,580.00	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	994,680.00	1.27
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	161,415.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,223,400.00	1.56
S	综合	-	-
	合计	7,816,154.00	9.95

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601138	工业富联	90,000	1,659,600.00	2.11
2	603466	风语筑	30,000	787,500.00	1.00
3	600588	用友网络	20,000	490,200.00	0.62
4	601003	柳钢股份	50,000	396,000.00	0.50
5	603678	火炬电子	15,000	373,800.00	0.48
6	002156	通富微电	33,000	357,390.00	0.45
7	002815	崇达技术	20,000	322,000.00	0.41
8	600667	太极实业	43,000	316,480.00	0.40
9	300684	中石科技	3,700	287,749.00	0.37
10	000636	风华高科	17,000	269,960.00	0.34
11	300413	快乐购	7,000	265,580.00	0.34
12	002384	东山精密	10,000	240,000.00	0.31

13	000977	浪潮信息	10,000	238,500.00	0.30
14	300144	宋城演艺	10,000	235,000.00	0.30
15	000681	视觉中国	7,000	200,900.00	0.26
16	300476	胜宏科技	13,000	200,200.00	0.25
17	002916	深南电路	3,000	190,530.00	0.24
18	002912	中新赛克	2,000	188,000.00	0.24
19	603367	辰欣药业	7,000	163,590.00	0.21
20	002023	海特高新	13,000	163,020.00	0.21
21	603986	兆易创新	1,500	162,780.00	0.21
22	603259	药明康德	1,700	161,415.00	0.21
23	300506	名家汇	3,000	62,190.00	0.08
24	300567	精测电子	700	55,720.00	0.07
25	300192	科斯伍德	3,000	28,050.00	0.04

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600535	天士力	3,145,053.00	2.48
2	300335	迪森股份	2,809,561.00	2.21
3	002697	红旗连锁	2,555,796.30	2.01
4	300437	清水源	2,056,700.96	1.62
5	001979	招商蛇口	2,034,862.00	1.60
6	300422	博世科	1,879,596.77	1.48
7	300021	大禹节水	1,820,015.47	1.43
8	603466	风语筑	1,787,933.50	1.41
9	600461	洪城水业	1,766,560.44	1.39
10	603877	太平鸟	1,712,976.98	1.35
11	601138	工业富联	1,703,975.00	1.34
12	300388	国祯环保	1,693,400.00	1.33
13	000425	徐工机械	1,677,910.00	1.32
14	600030	中信证券	1,580,450.00	1.24
15	300568	星源材质	1,496,254.00	1.18

16	300409	道氏技术	1,469,121.00	1.16
17	000002	万 科 A	1,453,293.00	1.14
18	603808	歌力思	1,428,484.00	1.12
19	000932	华菱钢铁	1,411,172.00	1.11
20	600588	用友网络	1,335,726.20	1.05

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600535	天士力	3,031,345.20	2.39
2	300335	迪森股份	2,585,009.00	2.04
3	002697	红旗连锁	2,209,444.25	1.74
4	001979	招商蛇口	2,064,431.85	1.63
5	600298	安琪酵母	2,020,013.00	1.59
6	300437	清水源	2,019,416.00	1.59
7	300422	博世科	1,822,506.45	1.43
8	300021	大禹节水	1,803,782.00	1.42
9	600461	洪城水业	1,741,804.60	1.37
10	603877	太平鸟	1,737,173.14	1.37
11	300388	国祯环保	1,695,711.00	1.33
12	000425	徐工机械	1,667,173.00	1.31
13	603808	歌力思	1,602,718.20	1.26
14	600030	中信证券	1,541,800.00	1.21
15	300568	星源材质	1,530,045.00	1.20
16	000002	万 科 A	1,423,661.00	1.12
17	000932	华菱钢铁	1,420,991.00	1.12
18	300409	道氏技术	1,412,870.00	1.11
19	601566	九牧王	1,304,797.00	1.03
20	600115	东方航空	1,252,500.00	0.99

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	102,079,123.19
卖出股票收入（成交）总额	95,131,900.60

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	7,023,499.40	8.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	23,365,489.00	29.75
	其中：政策性金融债	23,365,489.00	29.75
4	企业债券	34,067,436.80	43.37
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	64,456,425.20	82.06

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	018006	国开 1702	90,000	8,957,700.00	11.40
2	108602	国开 1704	83,050	8,305,000.00	10.57
3	1680312	16 古蔺债	80,000	7,500,800.00	9.55
4	010303	03 国债（03）	70,780	7,023,499.40	8.94
5	112424	16 文化 01	69,970	6,861,957.90	8.74

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期本基金未投资国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

(1) 本基金本报告期末未持有国债期货。

(2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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

7.11.2

本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

7.11.3 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	34,370.39
2	应收证券清算款	1,806,617.95
3	应收股利	—
4	应收利息	1,253,373.72
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—

9	合计	3,094,362.06
---	----	--------------

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中未存在流通受限情况。

§ 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

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
469	169,972.00	10,000,000.00	12.54%	69,716,868.65	87.46%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	889,774.80	1.1162%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

注：本基金的基金经理同时为基金管理人高级管理人员。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	12.54	10,000,000.00	12.54	3 年
基金管理人高级管理人员	228,962.98	0.29	228,962.98	0.29	3 年
基金经理等人员	198,859.63	0.25	198,859.63	0.25	3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-

合计	10,427,822.61	13.08	10,427,822.61	13.08	-
----	---------------	-------	---------------	-------	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2017 年 6 月 29 日 ）基金份额总额	183,824,290.09
本报告期期初基金份额总额	127,601,569.94
本报告期基金总申购份额	6,779.31
减：本报告期基金总赎回份额	47,891,480.60
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	79,716,868.65

§ 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，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	86,104,199.13	43.66%	62,968.81	43.66%	—
申万宏源	2	68,886,053.40	34.93%	50,376.64	34.93%	—
天风证券	2	42,220,771.26	21.41%	30,876.02	21.41%	—
东莞证券	2	—	—	—	—	—
银河证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	2	—	—	—	—	—
华泰证券	2	—	—	—	—	—
国金证券	2	—	—	—	—	—

国信证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

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

2、交易席位选择流程：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	19,630,993.49	6.52%	-	-	-	-
申万宏源	27,809,061.54	9.24%	333,100,000.00	49.58%	-	-
天风证券	253,473,212.20	84.23%	338,700,000.00	50.42%	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

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	中科沃土基金管理有限公司关于旗下基金 2017 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 1 月 2 日
2	中科沃土基金管理有限公司关于公司旗下基金固定收益品种估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 1 月 25 日
3	中科沃土基金管理有限公司关于新增中正达广为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 2 月 12 日
4	中科沃土基金管理有限公司关于开展旗下基金申购、定期定额投资、转换业务的费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 3 月 1 日
5	中科沃土基金管理有限公司关于修订公司旗下货币市场基金和部分证券投资基金基金合同有关条款的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 3 月 8 日
6	中科沃土基金管理有限公司关于新增上海挖财为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 3 月 21 日
7	关于旗下部分基金参加中泰证券开展的基金申购（含定期定额申购）业务的费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 3 月 27 日
8	中科沃土基金管理有限公司关于旗下部分基金参加银河证券开展的基金申购、定投业务的费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 5 月 17 日
9	中科沃土基金管理有限公司关于新增洪泰财富为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 5 月 31 日
10	中科沃土基金管理有限公司关于新增万家财富为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 6 月 22 日
11	中科沃土基金旗下基金 2018 年 6 月 29 日基金资产净值和基金份额净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	2018 年 3 月 26 日至 2018 年 6 月 30 日	20,005,312.33	-	-	20,005,312.33	25.10%
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内有一名个人投资者出现持有份额比例超过 20%的情况。原因是由于本基金基金规模缩减，导致其持有份额比例超过 20%。截至本报告期末，其持有份额比例为 25.10%。本报告期，未发现本基金产品实质上存在特有风险。							

§ 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祥债券型发起式证券投资基金注册的文件；
2. 《中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金基金合同》；
3. 《中科沃土沃祥债券型发起式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祥债券型发起式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

2018 年 8 月 28 日