

# 中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 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：广州农村商业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 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。

基金托管人广州农村商业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
<b>§4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	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	13
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	14
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	14
<b>§5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	39
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.....	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.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.11 投资组合报告附注.....	41
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>42</b>
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.....	42
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.....	42
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>43</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>44</b>
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.....	44
10.8 其他重大事件.....	45
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>46</b>
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.....	46
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>47</b>

12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

## § 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券型证券投资基金	
基金简称	中科沃土沃安中短期利率债券	
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 3 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	7,948,284.11 份	
下属分级基金的基金简称:	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
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	2,244,298.04 份	5,703,986.07 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。	
	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

### 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	曹萍	卿苗
	联系电话	020-37128608	020-28019512
	电子邮箱	caoping@richlandasm.com.cn	qingmiao@grcbank.com
客户服务电话		400-018-3610	95313
传真		020-23388997	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）	广州市黄浦区映日路 9 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	广州市天河区珠江新城华夏路 1 号

	单元自编 06-08 号	
邮政编码	510620	510623
法定代表人	智会杰	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	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

基金级别	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
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	28,764.10	36,688.26
本期利润	19,312.82	36,180.63
加权平均基金份额本期利润	0.0071	0.0123
本期加权平均净值利润率	0.70%	1.21%
本期基金份额净值增长率	0.77%	4.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	13,917.06	46,009.12
期末可供分配基金份额利润	0.0062	0.0081
期末基金资产净值	2,276,724.14	5,794,897.20
期末基金份额净值	1.0144	1.0159
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	5.02%	8.12%

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

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	0.12%	0.01%	0.17%	0.02%	-0.05%	-0.01%
过去三个月	0.60%	0.02%	0.31%	0.03%	0.29%	-0.01%
过去六个月	0.77%	0.03%	-0.06%	0.04%	0.83%	-0.01%
过去一年	1.83%	0.03%	0.15%	0.04%	1.68%	-0.01%



过去三年	5.02%	0.04%	0.57%	0.05%	4.45%	-0.01%
自基金合同生效起至今	5.02%	0.04%	0.57%	0.05%	4.45%	-0.01%

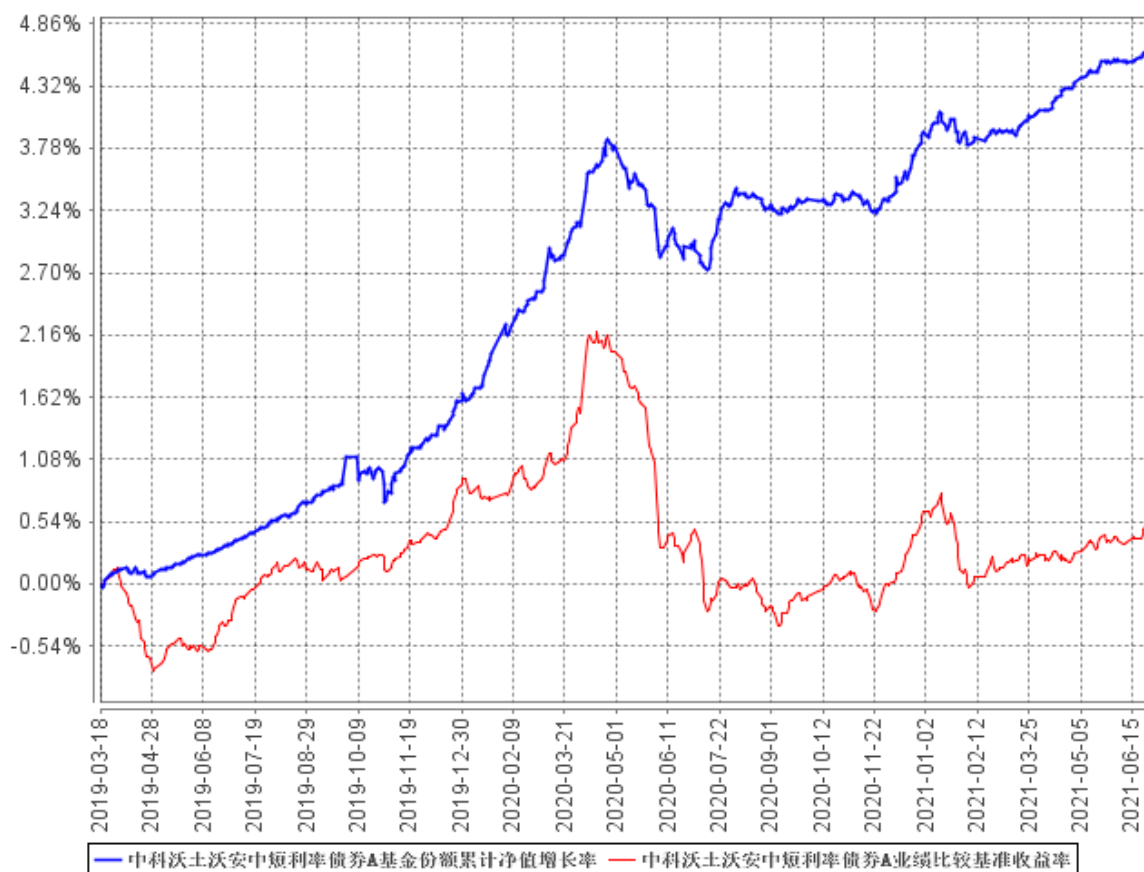
中科沃土沃安中短利率债券 C

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	0.10%	0.01%	0.17%	0.02%	-0.07%	-0.01%
过去三个月	0.60%	0.02%	0.31%	0.03%	0.29%	-0.01%
过去六个月	4.34%	0.36%	-0.06%	0.04%	4.40%	0.32%
过去一年	5.30%	0.25%	0.15%	0.04%	5.15%	0.21%
过去三年	8.12%	0.17%	0.57%	0.05%	7.55%	0.12%
自基金合同生效起至今	8.12%	0.17%	0.57%	0.05%	7.55%	0.12%

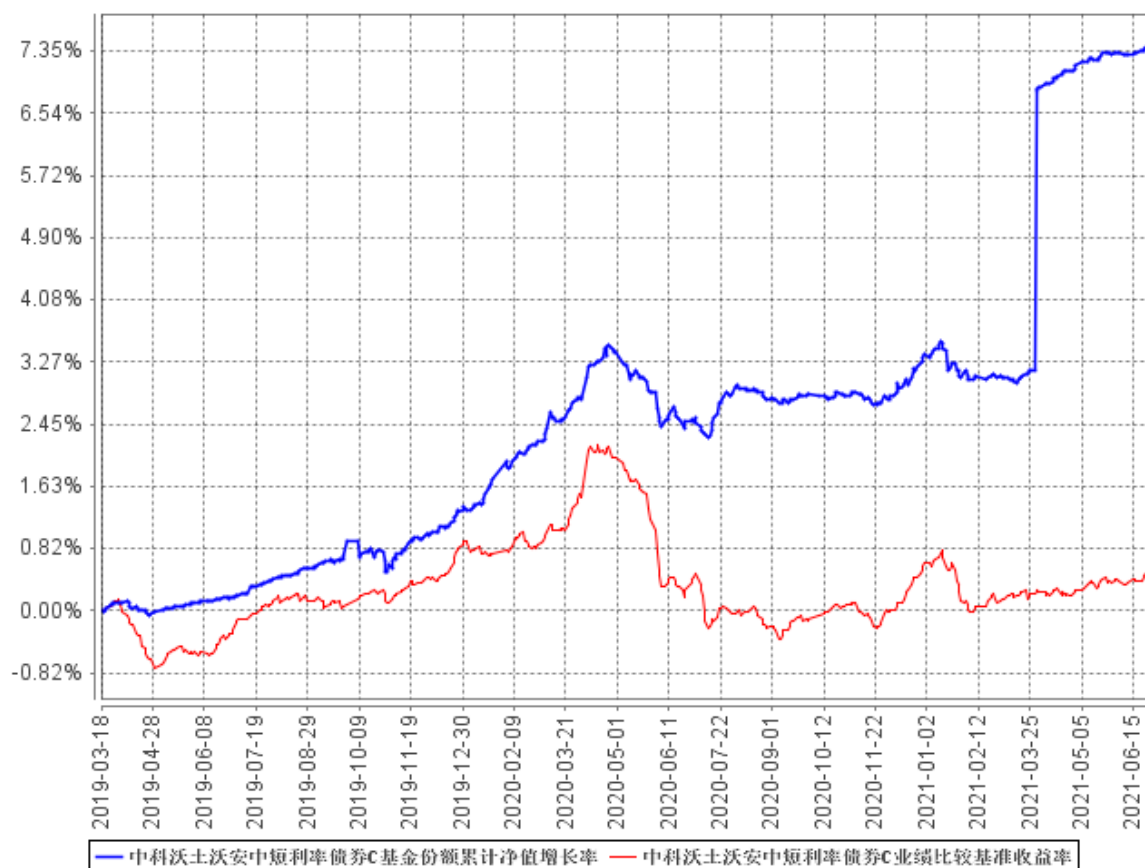
注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

### 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

中科沃土沃安中短利率债券A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



中科沃土沃安中短利率债券C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 2019 年 3 月 18 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 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 2021 年 6 月 30 日，中科沃土旗下共管理 7 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券型证券投资基金、中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金和中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金。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		
马洪娟	固定收益部副总经理、基金经理	2018 年 8 月 22 日	2021 年 4 月 27 日	10 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，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、中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金和中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
田钊	固定收益部投资副总监、基金经理	2019 年 12 月 6 日	-	8 年	金融工程硕士。曾任国开证券有限责任公司销售交易部结构化产品经理，中信建投证券股份有限公司资产管理部投资经理。现任中科沃土基金管理有限公司固定收益部投资副总监、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和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“离任日期”为公告确定的解聘日期，马洪娟的“任职日期”为基金合同生效之日，田钊的“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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期内，不存在本基金的基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 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。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3 日内、5 日内），对我司旗下所有投资组合在本报告期的同向交易价差情况进行了分析，根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

##### 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

报告期内债券市场经历了从熊市环境逐渐转变为小牛市的行情转变。在平稳度过 2020 年底跨

年时点后，春节前资金面陡然收紧，央行并没有对跨节资金需求做出超额对冲。市场上谨慎情绪开始蔓延，资金利率波动加大。1月26日，央行人士谈及“资产价格泡沫”、“货币政策应适度转向”，债市开始快速下跌。1月末央行连续净回笼，资金利率大幅飙升，扭转了市场预期。十年活跃国债 200016 收益率快速上行，一度逼近 3.30 水平。春节长假，海外市场走出一波再通胀交易行情，原油、铜等大宗商品价格暴涨，美债暴跌，节后国内债券收益率上行 4-6bp。

然而，2月下旬，市场发行货币政策未如预期般收紧。资金面持续平稳，缴税、跨季均没有出现大的波折。债市开始缓步上涨，一直持续至5月末。分析其原因，我们认为主要有以下几个方面原因：（1）资金面维持平稳，资金中枢并未明显上移；（2）信用风险频发，叠加对房地产、城投融资的管控。机构配置难度增加，有一定的配置压力；（3）市场情绪比较谨慎，投资者仓位普遍较低。5月下旬开始，随着地方债供给放量，部分投资者开始担心上述逻辑不再成立。债市又开始小幅调整，10年国债利率从低点 3.04% 上行至 3.14%。

报告期内，本基金在资产配置上以中短久期利率债为主，并通过主动调节久期，增加多种交易策略。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中科沃土沃安中短利率债券 A 基金份额净值为 1.0144 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.77%；截至本报告期末中科沃土沃安中短利率债券 C 基金份额净值为 1.0159 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.34%；同期业绩比较基准收益率为 -0.06%。

#### 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 2021 年下半年的债券市场，我们认为：（1）经济仍将维持稳中向好态势，但增长动能或边际放缓；（2）政策调控下商品涨幅减缓，通胀压力有望边际缓解，货币政策预计将继续以“稳”为主；（3）上半年地方债发行节奏较慢，集中供给或在三季度对债市形成扰动，但央行可能会适度宽松对冲供给压力和下半年到期的大量 MLF。综上，从中期角度来看我们认为下半年债市将处于比较有利的环境。

#### 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。

定价服务机按照商业合同约定提供定价服务。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“（三）基金收益分配原则”的相关规定，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%，收益分配后基金份额净值不能低于面值。本报告期内本基金已实施分配 2 次，A 级共分配利润 12,387.62 元，C 级共分配利润 239,415.59 元，符合合同规定。

#### **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半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 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券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	239,444.26	115,325.16
结算备付金		51,375.00	50,104.94
存出保证金		2,737.08	3,868.34
交易性金融资产	6.4.7.2	7,220,053.90	3,427,824.70
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		7,220,053.90	3,427,824.70
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	500,000.00	200,000.00
应收证券清算款		-	123,162.15
应收利息	6.4.7.5	114,474.86	36,308.64
应收股利		-	-
应收申购款		29,788.08	499.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		8,157,873.18	3,957,093.73
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		52,855.69	-
应付赎回款		11,061.70	10,036.70
应付管理人报酬		1,293.40	683.71
应付托管费		517.35	273.48
应付销售服务费		1,147.31	1.24
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	19,376.39	44,500.00
负债合计		86,251.84	55,495.13
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	7,948,284.11	3,857,424.40
未分配利润	6.4.7.10	123,337.23	44,174.20
所有者权益合计		8,071,621.34	3,901,598.60
负债和所有者权益总计		8,157,873.18	3,957,093.73

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，中科沃土沃安中短利率债券 A 基金份额净值 1.0144 元，基金份额总额 2,244,298.04 份；中科沃土沃安中短利率债券 C 基金份额净值 1.0159 元，基金份额总额 5,703,986.07 份。中科沃土沃安中短利率债券份额总额合计为 7,948,284.11 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		91,142.80	564,434.93
1.利息收入		80,768.29	405,500.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	635.39	9,706.98
债券利息收入		76,693.27	379,722.04
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,439.63	16,071.00
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		16,719.42	260,899.86
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	16,719.42	260,899.86
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
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	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-9,958.91	-109,994.65
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	3,614.00	8,029.70
<b>减：二、费用</b>		35,649.35	56,600.04
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,696.95	27,523.23
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,278.72	11,009.32
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,680.18	4,626.42
4. 交易费用	6.4.7.19	35.85	1,450.28
5. 利息支出		81.26	-
其中：卖出回购金融资产支出		81.26	-
6. 税金及附加		-	0.01
7. 其他费用	6.4.7.20	23,876.39	11,990.78
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		55,493.45	507,834.89
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		55,493.45	507,834.89

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	3,857,424.40	44,174.20	3,901,598.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	55,493.45	55,493.45
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）	4,090,859.71	275,472.79	4,366,332.50
其中：1.基金申购款	9,723,078.10	361,435.36	10,084,513.46
2.基金赎回款	-5,632,218.39	-85,962.57	-5,718,180.96
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-251,803.21	-251,803.21

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）	7,948,284.11	123,337.23	8,071,621.34
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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）	52,215,880.51	815,146.01	53,031,026.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	507,834.89	507,834.89
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）	-42,069,537.89	-381,303.64	-42,450,841.53
其中：1.基金申购款	48,608,555.51	1,107,966.73	49,716,522.24
2.基金赎回款	-90,678,093.40	-1,489,270.37	-92,167,363.77
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）	-	-831,925.95	-831,925.95
五、期末所有者权益（基金净值）	10,146,342.62	109,751.31	10,256,093.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.3 财务报表由下列负责人签署：

<u>          智会杰          </u>	<u>          智会杰          </u>	<u>          李峰          </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

中科沃土沃安中短期利率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券型证券投资基金。自同日起，《中科沃土沃安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“广州农商银行”)。

根据《中科沃土沃安中短期利率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》、各项具体会计准则及相关规定(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券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 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 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	239,444.26
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：	239,444.26

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	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	7,220,474.58	7,220,053.90
	银行间市场	-	-
	合计	7,220,474.58	7,220,053.90
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	7,220,474.58	7,220,053.90	-420.68

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末本基金无衍生金融工具。

#### 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 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	500,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	10.88
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	23.10
应收债券利息	114,439.58
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	1.30
合计	114,474.86

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本报告期末本基金无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

注：本报告期末本基金无应付交易费用。

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 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	-
预提费用	19,376.39
合计	19,376.39

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中科沃土沃安中短利率债券 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,851,354.99	3,851,354.99
本期申购	185,384.38	185,384.38
本期赎回(以“-”号填列)	-1,792,441.33	-1,792,441.33
- 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	2,244,298.04	2,244,298.04

金额单位：人民币元

中科沃土沃安中短利率债券 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,069.41	6,069.41
本期申购	9,537,693.72	9,537,693.72
本期赎回(以“-”号填列)	-3,839,777.06	-3,839,777.06
- 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	5,703,986.07	5,703,986.07

注：本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

中科沃土沃安中短利率债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,212.06	41,896.19	44,108.25
本期利润	28,764.10	-9,451.28	19,312.82
本期基金份额交易产生的变动数	-4,671.48	-13,935.87	-18,607.35
其中：基金申购款	537.48	1,742.88	2,280.36
基金赎回款	-5,208.96	-15,678.75	-20,887.71
本期已分配利润	-12,387.62	-	-12,387.62
本期末	13,917.06	18,509.04	32,426.10

单位：人民币元

中科沃土沃安中短利率债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-0.45	66.40	65.95
本期利润	36,688.26	-507.63	36,180.63
本期基金份额交易产生的变动数	248,736.90	45,343.24	294,080.14
其中：基金申购款	280,873.84	78,281.16	359,155.00
基金赎回款	-32,136.94	-32,937.92	-65,074.86
本期已分配利润	-239,415.59	-	-239,415.59
本期末	46,009.12	44,902.01	90,911.13

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	327.92
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	289.09
其他	18.38
合计	635.39

### 6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	16,719.42
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	16,719.42

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,188,929.51
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	10,043,933.48
减：应收利息总额	128,276.61
买卖债券差价收入	16,719.42

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本报告期内本基金无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本报告期内本基金无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本报告期内本基金无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

注：本报告期内本基金无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-9,958.91
——股票投资	-
——债券投资	-9,958.91
——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	-9,958.91

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,614.00
基金转换费收入	-
合计	3,614.00

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	35.85
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-

合计	35.85
----	-------

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
其他	-
合计	23,876.39

### 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（“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（“广州农商银行”）	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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,696.95	27,523.23
其中：支付销售机构的客户维护费	2,842.28	11,242.55

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，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，基金托管人复核后于次月首日起 2 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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,278.72	11,009.32

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

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，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 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	-	0.43	0.43
合计	-	0.43	0.43
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 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	-	3,505.37	3,505.37
合计	-	3,505.37	3,505.37

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，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

注：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 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

注：本基金本报告期内未与关联方进行转融通证券出借业务。

#### 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

注：本基金本报告期内未与关联方进行转融通证券出借业务。

### 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自有资金投资本基金的情况

注：本报告期内基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

#### 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

注：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。

### 6.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
广州农村商业银行股份有限公司	239,444.26	327.92	921,894.10	7,326.03

注：本基金的银行存款由基金托管人广州农村商业银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

### 6.4.11 利润分配情况

中科沃土沃安中短利率债券 A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配 合计	备注
		场内	场外					

1	2021 年 4 月 16 日	-	2021 年 4 月 16 日	0.0428	8,590.56	1,610.25	10,200.81	
2	2021 年 1 月 12 日	-	2021 年 1 月 12 日	0.0060	2,186.81	-	2,186.81	
合计	-	-	-	0.0488	10,777.37	1,610.25	12,387.62	

中科沃土沃安中短利率债券 C

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配 合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 4 月 16 日	-	2021 年 4 月 16 日	0.3873	221,730.47	17,685.12	239,415.59	
合计	-	-	-	0.3873	221,730.47	17,685.12	239,415.59	

**6.4.12 期末（2021 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**

注：截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券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**

注：截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金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**

截至本报告期末 2021 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 2021 年 6 月 30 日止，本基金未从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。



#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金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

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。

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。（2020 年 6 月 30 日：同）

##### 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	5,309,224.00	1,198,440.00

合计	5,309,224.00	1,198,440.00
----	--------------	--------------

注：1、债券评级取自第三方机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为剩余期限在一年内国债、政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无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

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	1,910,829.90	2,229,384.70
合计	1,910,829.90	2,229,384.70

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剩余期限在一年以上的国债、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

注：本基金本报告期末无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

注：本基金本报告期末无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 2021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	239,444.26	-	-	-	239,444.26
结算备付金	51,375.00	-	-	-	51,375.00
存出保证金	2,737.08	-	-	-	2,737.08
交易性金融资产	5,309,224.00	1,507,548.40	403,281.50	-	7,220,053.90
买入返售金融资产	500,000.00	-	-	-	500,000.00
应收利息	-	-	-	114,474.86	114,474.86
应收申购款	-	-	-	29,788.08	29,788.08
资产总计	6,102,780.34	1,507,548.40	403,281.50	144,262.94	8,157,873.18
负债					
应付证券清算款	-	-	-	52,855.69	52,855.69
应付赎回款	-	-	-	11,061.70	11,061.70
应付管理人报酬	-	-	-	1,293.40	1,293.40
应付托管费	-	-	-	517.35	517.35
应付销售服务费	-	-	-	1,147.31	1,147.31
其他负债	-	-	-	19,376.39	19,376.39
负债总计	-	-	-	86,251.84	86,251.84
利率敏感度缺口	6,102,780.34	1,507,548.40	403,281.50	58,011.10	8,071,621.34
上年度末 2020年12月	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

31 日					
资产					
银行存款	115,325.16	-	-	-	115,325.16
结算备付金	50,104.94	-	-	-	50,104.94
存出保证金	3,868.34	-	-	-	3,868.34
交易性金融资产	1,198,440.00	2,045,750.70	183,634.00	-	-3,427,824.70
买入返售金融资产	200,000.00	-	-	-	200,000.00
应收证券清算款	-	-	-	123,162.15	123,162.15
应收利息	-	-	-	36,308.64	36,308.64
应收申购款	-	-	-	499.80	499.80
资产总计	1,567,738.44	2,045,750.70	183,634.00	159,970.59	3,957,093.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,036.70	10,036.70
应付管理人报酬	-	-	-	683.71	683.71
应付托管费	-	-	-	273.48	273.48
应付销售服务费	-	-	-	1.24	1.24
其他负债	-	-	-	44,500.00	44,500.00
负债总计	-	-	-	55,495.13	55,495.13
利率敏感度缺口	1,567,738.44	2,045,750.70	183,634.00	104,475.46	3,901,598.60

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	1. 其他变量不变，只有利率变动通过债券公允价值变动对基金资产净值产生影响。		
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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1. 利率上升 25 个基点	-14,282.15	14,965.57
	2. 利率下降 25 个基点	14,282.15	-14,771.30

#### 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。

#### 6.4.14 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

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，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中属于第一层次的余额为 7,220,053.90 元，无属于第二或第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日，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中属于第二层次的余额为 3,427,824.70 元，无属于第一或第三层次的余额)。

##### (ii) 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。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 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，其账面价值与公允价值相差很小。

(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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,220,053.90	88.50
	其中：债券	7,220,053.90	88.50
	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	500,000.00	6.13
	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	290,819.26	3.56
8	其他各项资产	147,000.02	1.80
9	合计	8,157,873.18	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

注：本报告期末本基金未持有股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本报告期末本基金未持有股票。

### 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

注：本报告期末本基金未持有股票。

### 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

注：本报告期末本基金未持有股票。

#### 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

注：本报告期末本基金未持有股票。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本报告期末本基金未持有股票。

## 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	5,903,797.90	73.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,316,256.00	16.31
	其中：政策性金融债	1,316,256.00	16.31
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	7,220,053.90	89.45

## 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	019645	20 国债 15	27,000	2,708,370.00	33.55
2	010303	03 国债（03）	10,000	1,013,500.00	12.56
3	108604	国开 1805	8,000	802,160.00	9.94
4	010107	21 国债（7）	5,970	598,194.00	7.41
5	019649	21 国债 01	5,000	500,350.00	6.20

## 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

注：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

注：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

注：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

注：（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本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行出现或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

#### 7.11.2 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	2,737.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	114,474.86
5	应收申购款	29,788.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	147,000.02

#### 7.11.3 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.11.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末本基金未持有股票。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中科沃土沃安中短利率债券 A	369	6,082.11	-	-	2,244,298.04	100.00%
中科沃土沃安中短利率债券 C	133	42,887.11	-	-	5,703,986.07	100.00%
合计	502	15,833.24	-	-	7,948,284.11	100.00%

### 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	1,101.38	0.05%
	中科沃土沃安中短利率债券 C	17.26	0.00%
	合计	1,118.64	0.01%

### 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

注：无

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	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 3 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	3,851,354.99	6,069.41
本报告期基金总申购份额	185,384.38	9,537,693.72
减：本报告期基金总赎回份额	1,792,441.33	3,839,777.06
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	2,244,298.04	5,703,986.07

## § 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

中科沃土基金管理有限公司（以下简称“本公司”）自 2021 年 4 月 17 日起，智会杰先生担任公司副总经理职务。自 2021 年 5 月 21 日起，智会杰先生担任公司总经理职务，同日，于建伟先生离任公司总经理职务并转任公司副董事长职务。上述公司高管人员变动情况已根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法》等的相关规定进行了披露。

本报告期内基金托管人新聘任杜辉为资产托管部总经理助理。

### 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	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

#### 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	22,853,006.60	96.60%	35,000,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	803,767.89	3.40%	-	-	-	-

## 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	非货币市场基金分红公告	中证报及管理人网站	2021年1月8日
2	第四季度报告	中证报及管理人网站	2021年1月21日
3	基金管理人的法定名称、住所发生变更的公告	中证报及管理人网站	2021年3月6日
4	基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东事项公告	中证报及管理人网站	2021年3月20日
5	基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	中证报及管理人网站	2021年3月26日
6	年度报告	中证报及管理人网站	2021年3月30日
7	非货币市场基金分红公告	中证报及管理人网站	2021年4月14日
8	基金行业高级管理人员变更公告	中证报及管理人网站	2021年4月17日
9	第一季度报告	中证报及管理人网站	2021年4月21日
10	基金经理变更公告	中证报及管理人网站	2021年4月27日
11	基金产品资料概要更新	中证报及管理人网站	2021年4月29日
12	基金产品资料概要更新	中证报及管理人网站	2021年4月29日
13	招募说明书更新	中证报及管理人网站	2021年4月29日
14	基金行业高级管理人员变更公告	中证报及管理人网站	2021年5月22日
15	其他重大事项公告	中证报及管理人网站	2021年5月26日
16	其他重大事项公告	中证报及管理人网站	2021年5月28日
17	基金募集/申赎/扩募/代销/上市基金场内交易价格波动等风险提示公告	中证报及管理人网站	2021年6月4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
个人	1	20210402-20210405	0.00	1,191,951.94	397,317.31	794,634.63	10.00%
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

2021 年 8 月 31 日