
中科沃土沃安中短利率债债券型投资基金

2021年第4季度报告

2021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

报告送出日期:2022年01月23日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2022年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年10月1日起至2021年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

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	
报告期末基金份额总额	4,114,651.55份	
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	
下属分级基金的基金简称	中科沃土沃安A级	中科沃土沃安C级
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	1,776,974.33份	2,337,677.22份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2021年10月01日 - 2021年12月31日)	
	中科沃土沃安A级	中科沃土沃安C级
1. 本期已实现收益	6,374.25	7,816.00

2. 本期利润	7,555.20	9,128.94
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0040	0.0032
4. 期末基金资产净值	1,800,429.94	2,366,064.34
5. 期末基金份额净值	1.0132	1.0121

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A级净值表现

阶段	净值增长率①	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	0.40%	0.01%	0.62%	0.03%	-0.22%	-0.02%
过去六个月	1.06%	0.02%	0.97%	0.03%	0.09%	-0.01%
过去一年	1.84%	0.02%	0.91%	0.04%	0.93%	-0.02%
过去三年	6.17%	0.04%	1.54%	0.05%	4.63%	-0.01%
自基金合同生效起至今	6.17%	0.04%	1.54%	0.05%	4.63%	-0.01%

中科沃土沃安C级净值表现

阶段	净值增长率①	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	0.33%	0.01%	0.62%	0.03%	-0.29%	-0.02%
过去	0.89%	0.02%	0.97%	0.03%	-0.08%	-0.01%

六个月						
过去一年	5.27%	0.25%	0.91%	0.04%	4.36%	0.21%
自基金合同生效起至今	9.11%	0.16%	1.54%	0.05%	7.57%	0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
田钊	固定收益部投资副总监、基金经理	2019-12-06	-	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。
--	--	--	--	--	-------------------

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内债券市场宽幅震荡，10月，供给瓶颈推动大宗商品持续走高，通胀压力有所抬升的情况下，货币政策空间进一步受限，债券短期上涨动力不足。三季度金融数据新闻发布会上，央行认为十年期国债收益率在2.95%附近，总体处于较低水平，四季度银行体系流动性供求将继续保持基本平衡，市场的持续宽松预期落空，收益率剧烈调整。但此后央行维持了较宽松的短期资金投放，银行间资金充裕。且大幅调整后投资者重新进场意愿较强，同时，发改委出台多项保供措施缓解供给压力，大宗商品尤其是煤炭价格快速回落。在全年财政投放持续较慢、经济下行预期逐步增强的情况下，收益率折返至8月低位。考虑到经济下行压力进一步增大，央行于12月降准，但本次预期比较一致，并未能进一步推动收益率下行。

报告期内，本基金在资产配置上以中短久期利率债为主，选择比较中性的久期水平以应对市场，产品净值稳步增长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中科沃土沃安A级基金份额净值为1.0132元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.40%，同期业绩比较基准收益率为0.62%；截至报告期末中科沃土沃

安C级基金份额净值为1.0121元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.33%，同期业绩比较基准收益率为0.62%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	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	3,814,652.20	90.13
	其中：债券	3,814,652.20	90.13
	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	200,000.00	4.73
	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	71,414.69	1.69
8	其他资产	146,414.72	3.46
9	合计	4,232,481.61	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本报告期末本基金未持有股票。

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本报告期末本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	2,544,337.20	61.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,270,315.00	30.49
	其中：政策性金融债	1,270,315.00	30.49
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	3,814,652.20	91.56

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	010303	03国债(3)	11,500	1,167,825.00	28.03
2	018008	国开1802	7,000	715,610.00	17.18
3	019654	21国债06	4,000	400,120.00	9.60
4	019628	20国债02	4,000	400,040.00	9.60
5	019658	21国债10	4,000	399,400.00	9.59

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,537.19
2	应收证券清算款	100,157.81
3	应收股利	-
4	应收利息	44,219.92
5	应收申购款	499.80
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	146,414.72

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	中科沃土沃安A级	中科沃土沃安C级
报告期期初基金份额总额	1,950,888.96	3,257,478.22
报告期期间基金总申购份额	37,459.27	209,909.65
减：报告期期间基金总赎回份额	211,373.90	1,129,710.65
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-

报告期期末基金份额总额	1, 776, 974. 33	2, 337, 677. 22
-------------	-----------------	-----------------

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20211116-20211231	948, 610. 83	-	-	948, 610. 83	23. 05%

产品特有风险

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 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

2022年01月23日