

# 中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人: 中科沃土基金管理有限公司

基金托管人: 广州农村商业银行股份有限公司

送出日期: 2022 年 08 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人广州农村商业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月30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2022年1月1日至2022年6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	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	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
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	48
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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息	49

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	50
§9 开放式基金份额变动 .....	51
§10 重大事件揭示 .....	51
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
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 .....	54
§12 备查文件目录 .....	54
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 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	2,776,682.71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	1,626,902.58份	1,149,780.13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	曹萍
	联系电话	0757-86208608
	电子邮箱	caoping@richlandasm.com.cn
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）	广州市黄浦区映日路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	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	佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号千灯湖创投小镇核心区（自编号）十三座（B4）

#### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中科沃土基金管理有限公司	佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号千灯湖创投小镇核心区（自编号）十三座（B4）

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日-2022年06月30日)	
	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	11,642.48	7,875.24
本期利润	6,432.20	3,937.67
加权平均基金份额本期利润	0.0036	0.0027
本期加权平均净值利润率	0.36%	0.27%
本期基金份额净值增长率	0.36%	0.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	11,025.30	6,278.98
期末可供分配基金份额利润	0.0068	0.0055
期末基金资产净值	1,648,597.36	1,163,176.28
期末基金份额净值	1.0133	1.0117
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	6.55%	9.38%

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

中科沃土沃安中短期利率债券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	-0.02%	0.01%	0.02%	0.03%	-0.04%	-0.02%
过去三个月	0.25%	0.02%	0.37%	0.03%	-0.12%	-0.01%
过去六个月	0.36%	0.02%	-0.22%	0.05%	0.58%	-0.03%
过去一年	1.42%	0.02%	0.75%	0.04%	0.67%	-0.02%
过去三年	6.14%	0.04%	1.64%	0.05%	4.50%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	6.55%	0.04%	1.32%	0.05%	5.23%	-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	-0.03%	0.01%	0.02%	0.03%	-0.05%	-0.02%
过去三个月	0.20%	0.02%	0.37%	0.03%	-0.17%	-0.01%
过去六个月	0.25%	0.02%	-0.22%	0.05%	0.47%	-0.03%
过去一年	1.14%	0.02%	0.75%	0.04%	0.39%	-0.02%
过去三年	9.16%	0.15%	1.64%	0.05%	7.52%	0.10%
自基金合同 生效起至今	9.38%	0.14%	1.32%	0.05%	8.06%	0.09%

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

中科沃土沃安中短期利率债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



中科沃土沃安中短期利率债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：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2022年6月30日，中科沃土旗下共管理6只开放式基金：中科沃土货币市场基金、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金和中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金。

##### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
田钊	固定收益部投资副总监、基金经理	2019-12-06	2022-06-16	9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。

董清源	固定收益部基金经理	2022-05-26	-	9 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）资产管理有限公司副总经理，北京康思资本管理有限公司副总经理，现任中科沃土基金管理有限公司中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土货币市场基金、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祥债券型发起式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，“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。

#### 4.2 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

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

4月初，资金面超预期宽松，带动短端利率下行，同时受金融数据疲弱，上海等地疫情严重，“宽信用”政策效果未得到验证，机构投资者对于后市货币宽松的预期升温等因素影响，长端收益率下行至2.74%附近。当月中下旬，银行间流动性维持宽松，而货币宽松政策不及预期等诸多因素导致短端表现强于长端，10年活跃国债收益回调至2.85%附近。

进入5月份，资金利率中枢继续下移，银行间流动性维持极度宽松状态，短端资产维持强势，叠加北京疫情及经济电话会议的影响，长端利率下行至2.7%附近。5月末及6月初，因重点城市疫情逐步得到控制，稳增长政策频出，债市重回2.8%以上。6月份公布的金融数据好于预期，资金面因跨季因素向政策资金利率靠拢明显，长端利率进一步受到抑制。

整体来看，二季度利率走势主要受疫情及资金面影响。短端利率下行明显，而长端利率整体处于2.74%-2.85%的小区间震荡。

本基金在资产配置上以中短久期利率债为主，报告期内，本基金运用久期控制、仓位调整、波段交易等诸多手段，提高产品收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中科沃土沃安中短期利率债券A基金份额净值为1.0133元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.36%，同期业绩比较基准收益率为-0.22%；截至报告期末中科沃土沃安中短期利率债券C基金份额净值为1.0117元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.25%，同期业绩比较基准收益率为-0.22%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，宏观经济反弹力度大概率弱于预期，资金面有望延续宽松态势，债券市场结构性资产荒延续。在此背景下，以十年期国债为代表的长端国债有望获得机构投资者重新定价，收益率有望震荡下行。短端利率资产则大概率跟随资金面而维持低位震荡。本基金接下来将重点关注增量宏观政策、资金面的变化趋势及经济变化趋势，力争通过波段交易、久期策略等手段提高产品收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规的要求履行估值和净值计算的复核责任。本基金管理人已制定基金估值和份额计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；设有估值委员会，负责指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运营等方面的专业胜任能力。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。基金管理人改变估值技术，导致基金净值变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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1次，A类份额共分配利润6,277.76元，C类份额共分配利润6,838.48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债券型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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求，对基金管理人——中科沃土基金管理有限公司在本基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由本基金管理人——中科沃土基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	35,529.75	42,953.24
结算备付金		6,218.17	28,461.45
存出保证金		617.49	1,537.19
交易性金融资产	6.4.7.2	2,819,400.94	3,814,652.20
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,819,400.94	3,814,652.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	200,000.00

债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券 投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	100,157.81
应收股利		-	-
应收申购款		300.00	499.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	44,219.92
资产总计		2,862,066.35	4,232,481.61
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	29,915.40
应付管理人报酬		478.85	741.28
应付托管费		191.49	296.48
应付销售服务费		245.98	534.17
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	49,376.39	34,500.00
负债合计		50,292.71	65,987.33

<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	2,776,682.71	4,114,651.55
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	35,090.93	51,842.73
净资产合计		2,811,773.64	4,166,494.28
负债和净资产总计		2,862,066.35	4,232,481.61

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额总额2,776,682.71份，其中A类基金份额净值1.0133元，A类基金份额1,626,902.58份；C类基金份额净值1.0117元，C类基金份额1,149,780.13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：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		40,636.67	91,142.80
1. 利息收入		1,820.16	80,768.29
其中：存款利息收入	6.4.7.9	271.24	635.39
债券利息收入		-	76,693.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,548.92	3,439.63
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		47,963.06	16,719.42
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	47,963.06	16,719.42

资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
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	-	-
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.17	-9,147.85	-9,958.91
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	1.30	3,614.00
<b>减：二、营业总支出</b>		30,266.80	35,649.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	3,235.36	5,696.95
2. 托管费	6.4.10.2. 2	1,294.06	2,278.72
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	1,820.46	3,680.18
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		40.53	81.26
其中：卖出回购金融资产 支出		40.53	81.26
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.21	23,876.39	23,912.24
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		10,369.87	55,493.45
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,369.87	55,493.45
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		10,369.87	55,493.45

### 6.3 净资产（基金净值）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：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	4,114,651.55	-	51,842.73	4,166,494.28
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	4,114,651.55	-	51,842.73	4,166,494.28
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,337,968.84	-	-16,751.80	-1,354,720.64
（一）、综合收益总额	-	-	10,369.87	10,369.87
（二）、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）	-1,337,968.84	-	-14,005.43	-1,351,974.27
其中：1. 基金申购款	172,735.00	-	2,094.44	174,829.44
2. 基金赎回	-1,510,703.84	-	-16,099.87	-1,526,803.71

款				
(三)、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)	-	-	-13,116.24	-13,116.24
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,776,682.71	-	35,090.93	2,811,773.64
项目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	3,857,424.40	-	44,174.20	3,901,598.60
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	3,857,424.40	-	44,174.20	3,901,598.60
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,090,859.71	-	79,163.03	4,170,022.74
(一)、综合收益总额	-	-	55,493.45	55,493.45
(二)、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	-5,632,218.39	-	-85,962.57	-5,718,180.96

款				
(三)、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)	-	-	-251,803.21	-251,803.21
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	7,948,284.11	-	123,337.23	8,071,621.34

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：

智会杰

智会杰

李峰

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由中科沃土沃安债券型证券投资基金转型而来。中科沃土沃安债券型证券投资基金于2019年2月13日至2019年3月14日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会,投票表决通过了《关于中科沃土沃安债券型证券投资基金转型有关事项的议案》,同意将中科沃土沃安债券型证券投资基金转型为中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金。根据《中科沃土沃安债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》,自2019年3月18日起,中科沃土沃安债券型证券投资基金正式转型并更名为中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金。自同日起,《中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金基金合同》生效,原《中科沃土沃安债券型证券投资基金基金合同》失效。与此同时,中科沃土沃安债券型证券投资基金基金合同失效前的基金资产净值51,008,337.13元,于本基金基金合同生效时全部转为本基金的期初基金资产净值。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为中科沃土基金管理有限公司,基金托管人为广州农村商业银行股份有限公司(以下简称“广州农村商业银行”)。

根据《中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、

不收取申购费用的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的国债、央行票据、政策性金融债、债券回购、同业存单、银行存款、现金。本基金不参与股票、权证等资产的投资，同时本基金不投资于公司债、企业债、短期融资券、中期票据等信用债品种以及可转换债券、可交换债券。本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%，其中投资于中短期利率债的比例不低于非现金基金资产的80%，每个交易日日终，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债1-3 年政策性金融债指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于2022年6月30日，本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年中期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2022年6月30日的财务状况以及2022上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。除下述会计政策外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

##### 新金融工具准则

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或金融负债。

##### (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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

##### (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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他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。

### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

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或资产支持证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。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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。

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

##### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除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。

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。

##### 原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价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利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除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利息收入。

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。

#### 6.4.4.4 费用的确认和计量

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。

### 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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》、《企业会计准则第24号——套期会计》及《企业会计准则第37号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，财政部于2022年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》（财会[2022]14号），本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于2022年1月1日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为42,953.24元、28,461.45元、1,537.19元、200,000.00元、44,219.92元、100,157.81元和499.80元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为42,959.31元、28,475.53元、1,537.96元、199,881.64元、0.00元、100,157.81元和499.80元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为3,814,652.20元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为3,858,969.56元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和应付销售服务费，金额分别为29,915.40元、741.28元、296.48元和534.17元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和应付销售服务费，金额分别为29,915.40元、741.28元、296.48元和534.17元。

#### (b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	35,529.75
等于：本金	35,525.66
加：应计利息	4.09
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	35,529.75

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,770,865.37	49,982.14	2,819,400.94	-1,446.57
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,770,865.37	49,982.14	2,819,400.94	-1,446.57
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	2,770,865.37	49,982.14	2,819,400.94	-1,446.57	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 其他资产

本报告期末本基金无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	49,376.39
合计	49,376.39

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 中科沃土沃安中短利率债券A

金额单位：人民币元

项目 (中科沃土沃安中短利率债券 A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,776,974.33	1,776,974.33
本期申购	54,094.40	54,094.40
本期赎回(以“-”号填列)	-204,166.15	-204,166.15
本期末	1,626,902.58	1,626,902.58

##### 6.4.7.7.2 中科沃土沃安中短利率债券C

金额单位：人民币元

项目 (中科沃土沃安中短利率债券 C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,337,677.22	2,337,677.22
本期申购	118,640.60	118,640.60
本期赎回(以“-”号填列)	-1,306,537.69	-1,306,537.69
本期末	1,149,780.13	1,149,780.13

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。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 中科沃土沃安中短利率债券A

单位：人民币元

项目 (中科沃土沃安中短期利率债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	6,622.68	16,832.93	23,455.61
本期利润	11,642.48	-5,210.28	6,432.20
本期基金份额交易产生的变动数	-962.10	-953.17	-1,915.27
其中：基金申购款	196.33	472.22	668.55
基金赎回款	-1,158.43	-1,425.39	-2,583.82
本期已分配利润	-6,277.76	-	-6,277.76
本期末	11,025.30	10,669.48	21,694.78

#### 6.4.7.8.2 中科沃土沃安中短期利率债券C

单位：人民币元

项目 (中科沃土沃安中短期利率债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	7,110.65	21,276.47	28,387.12
本期利润	7,875.24	-3,937.57	3,937.67
本期基金份额交易产生的变动数	-1,868.43	-10,221.73	-12,090.16
其中：基金申购款	264.58	1,161.31	1,425.89
基金赎回款	-2,133.01	-11,383.04	-13,516.05
本期已分配利润	-6,838.48	-	-6,838.48
本期末	6,278.98	7,117.17	13,396.15

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	131.05
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	133.82
其他	6.37
合计	271.24

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益。

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

本报告期内本基金无基金投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	44,681.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,281.27
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	47,963.06

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）	2,851,761.35

成交总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,807,428.55
减：应计利息总额	41,047.85
减：交易费用	3.68
买卖债券差价收入	3,281.27

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

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

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

本报告期内本基金无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

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
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-9,147.85
—— 股票投资	-
—— 债券投资	-9,147.85
—— 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	-9,147.85

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	1.30
合计	1.30

注：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。

#### 6.4.7.20 信用减值损失

本报告期内本基金无信用减值损失。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06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
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（“广州农村商业银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行基金交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,235.36	5,696.95
其中：支付销售机构的客户维护费	1,615.88	2,842.28

注：支付基金管理人中科沃土基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,294.06	2,278.72

注：支付基金托管人广州农村商业银行的托管费按前一日基金资产净值0.08%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.08%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃安中短利率债券A	中科沃土沃安中短利率债券C	合计
中科沃土基金	0.00	0.90	0.90
合计	0.00	0.90	0.90
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

名称	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	合计
中科沃土基金	0.00	0.43	0.43
合计	0.00	0.43	0.43

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类的基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未出现基金管理人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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未出现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 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广州农村商业银行股份有限公司	35,529.75	131.05	239,444.26	327.92

注：本基金的银行存款由基金托管人广州农村商业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

中科沃土沃安中短利率债券A

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
1	2022-01-14	2022-01-14	0.035	5,390.50	887.26	6,277.76	-
合计			0.035	5,390.50	887.26	6,277.76	-

中科沃土沃安中短利率债券C

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
1	2022-01-14	2022-01-14	0.029	4,411.89	2,426.59	6,838.48	-
合计			0.029	4,411.89	2,426.59	6,838.48	-

#### 6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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、合规稽核部、风险管理部、集中交易部和基金事务部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人广州农村商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成

证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于2022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。

#### 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	996,748.69	799,520.00
合计	996,748.69	799,520.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为国债。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末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

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	1,822,652.25	3,015,132.20
合计	1,822,652.25	3,015,132.20

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为国债、政策性金融债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末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

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2022年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。

本基金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附注6.4.12。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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年0 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	35,529.75	-	-	-	35,529.75
结算备	6,218.17	-	-	-	6,218.17

付金					
存出保证金	617.49	-	-	-	617.49
交易性金融资产	2,099,923.99	705,506.44	13,970.51	-	2,819,400.94
应收申购款	-	-	-	300.00	300.00
资产总计	2,142,289.40	705,506.44	13,970.51	300.00	2,862,066.35
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	478.85	478.85
应付托管费	-	-	-	191.49	191.49
应付销售服务费	-	-	-	245.98	245.98
其他负债	-	-	-	49,376.39	49,376.39
负债总计	-	-	-	50,292.71	50,292.71
利率敏感度缺口	2,142,289.40	705,506.44	13,970.51	-49,992.71	2,811,773.64
上年度末 2021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	42,953.24	-	-	-	42,953.24
结算备付金	28,461.45	-	-	-	28,461.45
存出保证金	1,537.19	-	-	-	1,537.19
交易性金融资产	1,702,440.00	1,935,182.20	177,030.00	-	3,814,652.20
买入返售金融资产	200,000.00	-	-	-	200,000.00
应收证	-	-	-	100,157.81	100,157.81

券清算款					
应收利息	-	-	-	44,219.92	44,219.92
应收申购款	-	-	-	499.80	499.80
资产总计	1,975,391.88	1,935,182.20	177,030.00	144,877.53	4,232,481.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	29,915.40	29,915.40
应付管理人报酬	-	-	-	741.28	741.28
应付托管费	-	-	-	296.48	296.48
应付销售服务费	-	-	-	534.17	534.17
其他负债	-	-	-	34,500.00	34,500.00
负债总计	-	-	-	65,987.33	65,987.33
利率敏感度缺口	1,975,391.88	1,935,182.20	177,030.00	78,890.20	4,166,494.28

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	1. 利率上升25个基点	-4,604.62	-12,734.59
2. 利率下降25个基点	4,604.62	12,734.59	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，不参与股票、权证等资产的投资，同时不投资于公司债、企业债、短期融资券、中期票据等信用债品种以及可转换债券、可交换债券。于本期末和上一年度末，无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	2,819,400.94	3,814,652.20
第三层次	-	-
合计	2,819,400.94	3,814,652.20

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022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(2021年12月31日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,819,400.94	98.51
	其中：债券	2,819,400.94	98.51
	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	-	-
	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	41,747.92	1.46
8	其他各项资产	917.49	0.03
9	合计	2,862,066.35	100.00

### 7.2 报告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

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

本基金本报告期期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

### 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	1,743,996.11	62.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,075,404.83	38.25
	其中：政策性金融债	1,075,404.83	38.25
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	2,819,400.94	100.27

## 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	010303	03国债(3)	7,000	713,430.41	25.37
2	018008	国开1802	6,000	633,247.89	22.52
3	019664	21国债16	5,000	508,231.10	18.08
4	019658	21国债10	4,000	407,619.73	14.50
5	018010	国开1902	2,810	287,138.89	10.21

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期本基金未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期本基金未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 国家开发银行，于2022年3月21日被中国银行保险监督管理委员会因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为罚款440万元。

7.12.2 本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

7.12.3 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	617.49
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	300.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	917.49

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有股票。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

投资组合报告中，由于四舍五入原因，市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差；由于小数点后保留位数限制原因，市值占净值比例可能显示为零。

## § 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	296	5,496.29	0.00	0.00%	1,626,902.58	100.0 0%

沃安中短利率债券A						
中科沃土沃安中短利率债券C	55	20,905.09	0.00	0.00%	1,149,780.13	100.00%
合计	351	7,910.78	0.00	0.00%	2,776,682.71	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	1,115.74	0.07%
	中科沃土沃安中短利率债券C	17.26	0.0015%
	合计	1,133.00	0.0408%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	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	中科沃土沃安中短利率债券A	0
	中科沃土沃安中短利率债券C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中科沃土沃安中短利率债券A	0
	中科沃土沃安中短	0

	利率债券C	
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中科沃土沃安中短利率 债券A	中科沃土沃安中短利率 债券C
基金合同生效日(2019年03月18日)基金份额总额	48,838,582.97	-
本报告期期初基金份额总额	1,776,974.33	2,337,677.22
本报告期基金总申购份额	54,094.40	118,640.60
减：本报告期基金总赎回份额	204,166.15	1,306,537.69
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,626,902.58	1,149,780.13

## § 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

基金托管人新聘任张慧丹为资产托管部副总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生改变。

### 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	
长江证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	3,715,064.19	100.00%	14,230,000.00	100.00%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金2022年	中证报及管理人网站	2022-01-10

	临时公告_基金暂停（大额）申购（转换转入、赎回、转换转出、定期定额投资）公告		
2	中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金	中证报及管理人网站	2022-01-12
3	中科沃土基金管理有限公司关于新增申万宏源西部证券为旗下部分基金销售机构的公告	中证报及管理人网站	2022-03-18
4	中科沃土基金管理有限公司关于新增中植基金为旗下部分基金销售机构的公告	中证报及管理人网站	2022-03-18
5	中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金2022年第一季度报告	中证报及管理人网站	2022-04-22
6	中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金基金经理变更公告	中证报及管理人网站	2022-05-27
7	中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	中证报及管理人网站	2022-05-31
8	中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	中证报及管理人网站	2022-05-31
9	中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金基金经理变更公告	中证报及管理人网站	2022-06-17
10	中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中证报及管理人网站	2022-06-21
11	中科沃土沃安中短期利率债券型证券投资基金(C类份	中证报及管理人网站	2022-06-21

	额)基金产品资料概要更新		
12	中科沃土基金管理有限公司关于新增泰信财富基金为旗下部分基金销售机构的公告	中证报及管理人网站	2022-06-24
13	中科沃土基金管理有限公司关于新增福克斯(北京)基金为旗下部分基金销售机构的公告	中证报及管理人网站	2022-06-28

## § 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	20220101-20220117	948,610.83	0.00	948,610.83	0.00	0.00%
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

二〇二二年八月三十一日