中科沃土货币市场基金 2018年半年度报告摘要

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:2018年8月28日

§1 重要提示

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2018年8月17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日起至2018年6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中科沃土货币	
基金主代码	002646	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年6月6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	198,721,570.73份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中科沃土货币A	中科沃土货币B
下属分级基金的交易代码:	002646	002647
报告期末下属分级基金的份额总额	37,215,555.35份	161,506,015.38份

2.2 基金产品说明

投资目标	在综合考虑基金资产收益性、安全性和流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争获取超越业绩比较基准的稳定收益。	
投资策略	本基金将在深入研究国内外宏观经济、货币政策、通货膨胀、信用状态等因素的基础上,分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势,并综合考虑各类投资品种的流动性、风险性和收益性,决定基金资产在银行存款及同业存单、债券回购、利率债、信用债、资产支持证券等各类资产的配置比例以及投资组合的平均剩余期限,并适时进行动态调整,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。具体投资策略包括资产配置策略、久期策略、流动性管理策略、银行存款及同业存单投资策略、债券回购投资策略、利率债品种的投资策略、信用债品种的投资策略等投资管理策略。	
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
	中科沃土货币A	中科沃土货币B

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	杨敏	卿苗
	联系电话	020-23388979	020-28019512
	电子邮箱	yangmin@richlandasm.com.cn	qingmiao@grcbank.com
客户服务电话		400-018-3610	95313
传真		020-23388997	020-28019340

2.4 信息披露方式

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

§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

基金级别	中科沃土货币A	中科沃土货币B
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)	报告期(2018年1月1日－2018年6月30日)
本期已实现收益	777,822.86	3,646,167.51
本期利润	777,822.86	3,646,167.51
本期净值收益率	1.8096%	1.9309%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末基金资产净值	37,215,555.35	161,506,015.38
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

金额单位:人民币元

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(不含公允价值变动损益)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损益。

(2)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)本基金利润分配是按日结转份额。

3.2基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中科沃土货币A

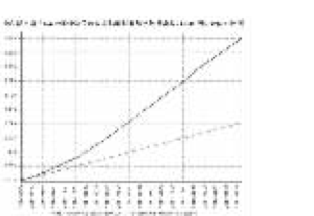
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.2847%	0.0013%	0.1125%	0.0000%	0.1722%	0.0013%
过去三个月	0.8751%	0.0011%	0.3413%	0.0000%	0.5338%	0.0011%
过去六个月	1.8096%	0.0028%	0.6788%	0.0000%	1.1308%	0.0028%
过去一年	3.7659%	0.0020%	1.3688%	0.0000%	2.3971%	0.0020%
自基金合同生效起至今	6.9798%	0.0024%	2.8313%	0.0000%	4.1485%	0.0024%

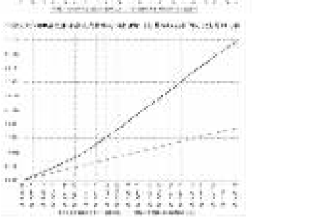
中科沃土货币B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.3045%	0.0013%	0.1125%	0.0000%	0.1920%	0.0013%
过去三个月	0.9356%	0.0011%	0.3413%	0.0000%	0.5943%	0.0011%
过去六个月	1.9309%	0.0028%	0.6788%	0.0000%	1.2521%	0.0028%
过去一年	4.0154%	0.0021%	1.3688%	0.0000%	2.6466%	0.0021%
自基金合同生效起至今	7.5132%	0.0024%	2.8313%	0.0000%	4.6819%	0.0024%

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累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:本基金合同于2016年6月6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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
马洪娟	固定收益部副总经理、基金经理	2016年6月6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。

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。

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,通过投资交易系统中的公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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

报告期内央行货币政策有一定的调整,于4月17日和6月24日两次宣布实施定向降准,流动性基调由"合理稳定"转换为"合理充裕",货币市场资金面持续改善,资金面呈整体宽松状态。3月份、6月份跨季因素影响资金利率有所冲高,3月份跨季三个月股份制行存单高点达到4.8%附近,而6月份同期限存单未达到一季度末的高点;除季末外,报告期内整体资金较为宽松。

报告期内,本基金在资产配置上以高等级的同业存单和回购为主,辅以一定的利率债,在保证良好的流动性的前提下,适度拉长久期,充分利用关键时点锁定高收益资产,提升组合收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期中科沃土货币A的基金份额净值收益率为1.8096%,本报告期中科沃土货币B的基金份额净值收益率为1.9309%,同期业绩比较基准收益率为0.6788%。

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务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。

本基金在 2018下半年仍将坚持做好流动性管理、期限匹配和时点选择,精选债券类资产,做好久期管理,为基金持有人赚取稳健的回报。

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"基金的收益与分配"之"(二)收益分配原则"的相关规定,本基金收益分配方式为红利再投资,每日分配,按日支付。本基金报告期内中科沃土货币A分配收益累计777,822.86元,中科沃土货币B分配收益累计3,646,167.51元。

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,本基金不存在连续二十个工作日以上基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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货币市场基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,依法安全保管了基金财产,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本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

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:中科沃土货币市场基金

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		310,356.82	116,772,932.52
结算备付金		–	41,856.16
存出保证金		360.15	–
交易性金融资产		138,933,888.23	227,613,055.67
其中:股票投资		–	–
基金投资		–	–
债券投资		138,933,888.23	227,613,055.67
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产		–	–
买入返售金融资产		57,665,121.73	229,565,271.61
应收证券清算款		–	–
应收利息		836,045.94	1,900,085.13
应收股利		–	–
应收申购款		1,360,130.91	–
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		199,105,903.78	575,893,201.09
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		–	–
卖出回购金融资产款		–	33,711,709.43
应付证券清算款		–	–
应付赎回款		–	–
应付管理人报酬		50,366.85	133,141.12
应付托管费		13,431.17	35,504.32
应付销售服务费		8,897.90	10,343.42
应付交易费用		11,043.59	10,875.94
应交税费		–	–
应付利息		–	60,916.23
应付利润		23,882.02	61,192.30
递延所得税负债		–	–
其他负债		276,711.52	349,000.00
负债合计		384,333.05	34,372,682.76
所有者权益:			
实收基金		198,721,570.73	541,520,518.33
未分配利润		–	–
所有者权益合计		198,721,570.73	541,520,518.33
负债和所有者权益总计		199,105,903.78	575,893,201.09

注: 报告截止日2018年6月30日,A类基金份额净值1.0000元,B类基金份额净值1.0000元;基金份额总额198,721,570.73份,下属分级基金的份额总额分别为:A类基金份额总额37,215,555.35份,B类基金份额总额161,506,015.38份。

6.2 利润表

会计主体:中科沃土货币市场基金

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1月1日至2017年6月30日
一、收入		5,166,894.02	14,953,400.21
1.利息收入		5,049,009.50	14,937,167.08
其中:存款利息收入		405,082.53	8,783,824.55
债券利息收入		2,261,548.58	2,949,911.46
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		2,382,378.39	3,203,431.07
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"–"填列)		116,643.08	16,233.13
其中:股票投资收益		–	–
基金投资收益		–	–
债券投资收益		116,643.08	16,233.13
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益		–	–
股利收益		–	–
3.公允价值变动收益(损失以"–"号填列)		–	–
4.汇兑收益(损失以"–"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"–"号填列)		1,241.44	–
减:二、费用		742,903.65	1,710,433.14
1. 管理人报酬		344,698.39	1,053,712.15
2. 托管费		91,919.58	280,989.90
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	63,666.70	76,645.28
4. 交易费用		9.70	–
5. 利息支出		66,272.76	110,285.06
其中:卖出回购金融资产支出		66,272.76	110,285.06
6. 税金及附加		–	–
7. 其他费用		176,336.52	188,800.75
三、利润总额 (亏损总额以"–"号填列)		4,423,990.37	13,242,967.07
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"–"号填列)		4,423,990.37	13,242,967.07

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中科沃土货币市场基金

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)	541,520,518.33	–	541,520,518.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	4,423,990.37	4,423,990.37
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)	–342,798,947.60	–	–342,798,947.60
其中:1.基金申购款	664,777,796.88	–	664,777,796.88
2.基金赎回款	–1,007,576,744.48	–	–1,007,576,744.48
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)	–	–4,423,990.37	–4,423,990.37
五、期末所有者权益(基金净值)	198,721,570.73	–	198,721,570.73
项目	上年度可比期间 2017年1月1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)	1,106,170,802.77	–	1,106,170,802.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	13,242,967.07	13,242,967.07
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)	–662,592,643.35	–	–662,592,643.35
其中:1.基金申购款	627,795,751.65	–	627,795,751.65
2.基金赎回款	–1,290,388,395.00	–	–1,290,388,395.00
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)	–	–13,242,967.07	–13,242,967.07
五、期末所有者权益(基金净值)	443,578,159.42	–	443,578,159.42

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:

______杨绍基______　　______傅军______　　____李茂____

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

中科沃土货币市场基金(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")《关于准予中科沃土货币市场基金注册的批复》(证监许可〔2016〕686号)进行募集。经向中国证监会备案,本基金基金合同于2016年6月6日正式生效。本基金类型为货币市场基金,本基金的运作方式为契约型开放式,存续期为不定期。设立时募集资金到位情况经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)审验,并由其出具《验证报告》(瑞华验字〔2016〕48090148号)。有关基金设立等文件已按规定报中国证监会备案。本基金的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。

根据《中科沃土货币市场基金基金合同》及证监许可(2016)686号批文的规定 ,本基金投资范围为:包括现金,期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单,剩余期限在397 天以内(含397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券,以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
广州农村商业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广东中科招商创业投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
广东中广投资管理有限公司	基金管理人的股东

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	344,698.39	1,053,712.15
其中:支付销售机构的客户维护费	33,811.37	28,784.25

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.30%÷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

基金管理费每日计提,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前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇到法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.8.2.2 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1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	91,919.58	280,989.90

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×0.08%÷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

基金托管费每日计提,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前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇到法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.8.2.3 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 2018年1月1日至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土货币A	中科沃土货币B	合计
中科沃土基金管理有限公司	30,293.42	8,112.08	38,405.50
广州农商银行股份有限公司	546.46	–	546.46
合计	30,839.88	8,112.08	38,951.96
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土货币A	中科沃土货币B	合计
中科沃土基金管理有限公司	36,804.31	31,937.81	68,742.12
广州农村商业银行股份有限公司	997.33	–	997.33
合计	37,801.64	31,937.81	69,739.45

注: 本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.25%,B类基金份额的年销售服务费率为0.01%。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同,具体如下:

H＝E基年销售服务费率÷当年天数

H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月首日5个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构,由注册登记机构代付给销售机构。若遇到法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日支付

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 中科沃土货币A	中科沃土货币B
基金合同生效日(2016年6月6日)持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	–	6,321,713.00
期间申购/买入总份额	2,477,851.86	9,153,457.47
期间因拆分变动份额	–	–
减:期间赎回/卖出总份额	–	15,475,170.47
期末持有的基金份额	2,477,851.86	–
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.25%	–

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 中科沃土货币A	中科沃土货币B
基金合同生效日(2016年6月6日)持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	–	31,649,523.63
期间申购/买入总份额	–	24,447,789.82
期间因拆分变动份额	–	–
减:期间赎回/卖出总份额	–	44,000,000.00
期末持有的基金份额	–	12,097,313.45
期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	2.73%

注:申购份额含红利转投资份额。基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及招募说明书的有关规定支付。

6.4.8.4.2 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

中科沃土货币B

份额单位:份

关联方名称	本期末 2018年6月30日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	上年度末 2017年12月31日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广东中科招商创业投资管理有限责任公司	5,745,058.87	2.89%	35,520,834.95	6.56%
广东中广投资管理有限公司	17,158,899.62	8.63%	14,890,685.65	2.75%

注:(1) 本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资中科沃土货币A的情况。

(2)关联方投资本基金相关的费用按基金合同及招募说明书的有关规定支付。

6.4.8.5 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 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
广州农村商业银行股份有限公司	310,356.82	5,591.42	1,221,576.28	5,473.27

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.9.2 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等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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见本基金最近一期年报。

(ii)各层级金融工具公允价值

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二层级的余额为138,933,888.23元,无属于第一层级和第三层级的余额(2017年12月31日:第二层级227,613,055.67元,无属于第一层级和第三层级的余额)。

(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	固定收益投资	138,933,888.23	69.78
	其中:债券	138,933,888.23	69.78
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	57,665,121.73	28.96
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	310,356.82	0.16
4	其他各项资产	2,196,537.00	1.10
5	合计	199,105,903.78	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.51	
	其中:买断式回购融资	–	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	–	–
	其中:买断式回购融资	–	–

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2018年3月8日	28.01	发生巨额赎回	两个工作日
2	2018年3月9日	21.26	调整期	一个工作日

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	45
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	56
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	7

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金合同约定"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过120天",本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	39.22	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	–
2	30天(含)—60天	0.00	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	–
3	60天(含)—90天	60.39	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	–
4	90天(含)—120天	0.00	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	–
5	120天(含)—397天(含)	0.00	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	–
	合计	99.61	0.00

7.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余期限超过240天的情况。

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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	19,954,651.58	10.04
	其中:政策性金融债	19,954,651.58	10.04
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	同业存单	118,979,236.65	59.87
8	其他	–	–
9	合计	138,933,888.23	69.91
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111808062	18中信银行CD062	300,000	29,759,180.75	14.98
2	170308	17进口08	200,000	19,954,651.58	10.04
3	111810275	18兴业银行CD275	200,000	19,836,271.91	9.98
4	111817124	18光大银行CD124	200,000	19,824,949.31	9.98
5	111809075	18浦发银行CD075	200,000	19,824,702.15	9.98
6	111815278	18民生银行CD278	200,000	19,820,175.02	9.97
7	111818166	18华夏银行CD166	100,000	9,913,957.51	4.99

7.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	–
报告期内偏离度的最高值	0.1137%
报告期内偏离度的最低值	0.0019%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0399%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

7.8 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

本基金采用"摊余成本法"计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。

7.9.2

18广发银行CD062(代码:111820062)为中科沃土货币市场基金的前十大持仓证券。2017年11月17日,中国银监会针对广发银行的如下事由对其给予警告及罚款,罚没合计72215.16万元:(一)出具与事实不符的金融票证;(二)未尽职审查保理业务贸易背景真实性;(三)内控管理严重违反审慎经营规则;(四)劳务派遣用工管理不到位;(五)对押品评估费用管理不到位;(六)未向监管部门报告风险信息;(七)未向监管部门报告重要信息系统突发事件;(八)会计核算管理薄弱;(九)信息系统与业务流程控制未按规定执行;(十)流动资金贷款用途监督不到位,未尽职审查银行承兑汇票贸易背景真实性;(十一) 以流动资金贷款科目向房地产开发企业发放贷款;(十二)报送监管数据不真实。

18兴业银行CD275(代码:111810275)为中科沃土货币市场基金的前十大持仓证券,2018年5月4日, 中国银行保险监督管理委员会针对兴业银行的如下事由对其给予警告及罚款,罚没合计5855.927万元。(一)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告;(二)非真实转让信贷资产;(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务;(四)内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规;(五)同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保;(六)债券卖出回购业务违规出表;(七)个人理财资金违规投资;(八)提供日期倒签的材料;(九)部分非现场监管统计数据与事实不符;(十) 个别董事未经任职资格核准即履职;(十一)变相批量转让个人贷款;(十二)向四证不全的房地产项目提供融资。

18浦发银行CD075(代码:111809075)为中科沃土货币市场基金的前十大持仓证券,2018年5月4日, 中国银行保险监督管理委员会针对浦发银行的如下事由对其给予警告及罚款,罚没合计5870万元。(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)通过资管计划投资分行协议存款,虚增一般存款;(三)通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节;(四) 理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求;(五)提供不实说明材料、不配合调查取证;(六)以贷转存,虚增存贷款;(七)票据承兑、贴现业务贸易背景审查不严;(八)国内信用证业务贸易背景审查不严;(九)贷款管理严重缺失, 导致大额不良贷款;(十) 违规通过同业投资转存款方式, 虚增存款;(十一)票据资管业务在总行审批驳回后仍继续办理;(十二)对代理收付资金的信托计划提供保本承诺;(十三) 以存放同业业务名义开办委托定向投资业务, 并少计风险资产;(十四)投资多款同业理财产品未尽职审查,涉及金额较大;(十五)修改总行理财合同标准文本,导致理财资金实际投向与合同约定不符;(十六)为非保本理财产品出具保本承诺函;(十七)向关系人发放信用贷款;(十八)向客户收取服务费,但未提供实质性服务,明显质价不符;(十九)收费超过服务价格目录,向客户转嫁成本。

本基金投资18广发银行CD062、18兴业银行CD275和18浦发银行CD075的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除18广发银行CD062、18兴业银行CD275和18浦发银行CD075外, 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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。

7.9.3 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	360.15
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	836,045.94
4	应收申购款	1,360,130.91
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	2,196,537.00

§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	机构投资者 持有份额	机构投资者 占总份额比例	个人投资者 持有份额	个人投资者 占总份额比例
中科沃土货币A	3,615	10,294.76	8,228,432.32	22.11%	28,987,123.03	77.89%
中科沃土货币B	14	11,536,143.96	156,418,987.00	96.85%	5,087,028.38	3.15%
合计	3,629	54,759.32	164,647,419.32	82.85%	34,074,151.41	17.15%

8.3期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例(%)
1	信托类机构	26,054,308.61	13.11
2	其他机构	21,677,068.17	10.91
3	其他机构	19,309,184.29	9.72
4	其他机构	17,158,899.62	8.63
5	其他机构	12,043,527.98	6.06
6	其他机构	10,017,235.47	5.04
7	其他机构	9,897,895.60	4.98
8	其他机构	8,999,574.47	4.53
9	信托类机构	8,066,286.68	4.06
10	其他机构	7,240,874.26	3.64

8.4 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	中科沃土货币A	3,427,006.13	9.2085%
	中科沃土货币B	0.00	0.0000%
	合计	3,427,006.13	1.7245%

8.5 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	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	中科沃土货币A	＞100
	中科沃土货币B	0
	合计	＞100
本基金基金经理持有本开放式基金	中科沃土货币A	10~50
	中科沃土货币B	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位:份

	中科沃土货币A	中科沃土货币B
基金合同生效日(2016年6月6日)基金份额总额	308,525,213.20	4,605,265,458.35
本报告期期初基金份额总额	31,976,925.00	509,543,593.33
本报告期基金总申购份额	247,198,646.91	417,579,149.97
减:本报告期基金总赎回份额	241,960,016.56	765,616,727.92
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	37,215,555.35	161,506,015.38

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§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 成交金额	股票交易 占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	应支付该券商的佣金 占当期佣金总量的比例	备注
国泰君安	1	–	–	–	–	–

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 成交金额	债券交易 占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	债券回购交易 占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	权证交易 占当期权证成交总额的比例
国泰君安	–	–	–	–	–	–

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过0.5%的情况。

§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	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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	2018年1月1日至2018年1月10日	150,331,155.79	374,085.39	150,705,241.18	0.00	0.00%
	2	2018年1月11日至2018年1月17日	68,719,112.35	213,154.92	68,932,267.27	0.00	0.00%
	3	2018年2月23日至2018年3月7日	0.00	50,935,292.05	43,694,417.79	7,240,874.26	3.64%
个人	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–

产品特有风险

本基金本报告期内有三名机构投资者出现持有份额比例超过20%的情况。其中机构投资者1由于本基金规模变动、红利转投增加基金份额的影响而被动出现持有份额比例超过20%的情况,其已经在本报告期内全部赎回基金份额,截止本报告期末,其持有份额比例为0;机构投资者2由于本基金规模变动、红利转投增加基金份额的影响而被动出现持有份额比例超过20%的情况,其已经在本报告期内全部赎回持有的基金份额,截至本报告期末,其持有的基金份额比例为0;机构投资者3由于在报告期内发生申购行为以及红利转投增加基金份额,导致其本报告期内出现持有份额比例超过20%的情况,其已经在本报告期内赎回部分基金份额,截止本报告期末,其持有份额比例为3.64%。本报告期,未发现本基金产品实质上存在特有风险。

中科沃土基金管理有限公司

2018年8月28日