中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金证券投资基金 2019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:2019年8月26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2019年8月16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。

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变更为中科沃土沃安中短期利率债证券投资基金,原中科沃土沃安债券型证券投资基金报告期自2019年1月1日至2019年3月17日止,中科沃土沃安中短期利率债证券投资基金报告期自2019年3月18日至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况(转型后)

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	696,948,532.23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	543,169,372.90份	153,779,159.33份

2.1 基金基本情况(转型前)

基金简称	中科沃土沃安债券
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	2018年8月22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	47,337,780.96份
基金合同存续期	2018年8月22日至2019年3月17日

2.2 基金产品说明(转型后)

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。
	中科沃土沃安中短利率债券A / 中科沃土沃安中短利率债券C

2.2 基金产品说明(转型前)

投资目标	在严格控制风险的前提下,采取稳健的投资策略,追求资产的长期平稳盈利,尽力满足投资者的稳健理财需求。
投资策略	本基金是以债券资产的投资为主的债券型投资基金,通过债券资产的投资获取平稳收益,并适度参与股票资产的投资以增强回报,投资策略主要包括大类资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股票投资策略等。
业绩比较基准	10%×沪深300指数收益率+90%×中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中科沃土基金管理有限公司	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@gr-cbank.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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.richlandasm.com.cn
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019年3月18日(基金合同生效日)至2019年6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	519,188.88	402,298.94
本期利润	591,921.85	253,827.26
加权平均基金份额本期利润	0.0063	0.0022
本期基金份额净值增长率	0.35%	0.18%
3.1.2 期末数据和指标	2019年6月30日	
期末可供分配基金份额利润	0.0756	0.0736
期末基金资产净值	587,389,474.49	166,004,463.68
期末基金份额净值	1.0814	1.0795
- 累计期末指标	2019年6月30日	

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。

转型前

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019年1月1日至2019年3月17日
本期已实现收益	2,835,681.64
本期利润	2,885,658.64
加权平均基金份额本期利润	0.0709
本期基金份额净值增长率	7.04%
3.1.2 期末数据和指标	2019年3月17日
期末可供分配基金份额利润	0.0730
期末基金资产净值	51,008,337.13
期末基金份额净值	1.0775
- 累计期末指标	2019年3月17日

注:1. 本基金合同生效日为2018年8月22日,截止2019年3月17日,本基金成立未满1年。

2. 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。

3. 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 。

4. 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(转型后)

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

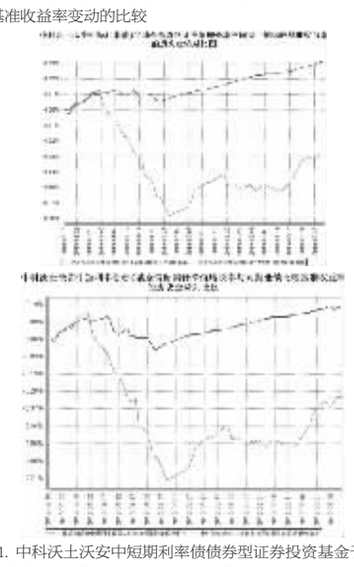
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.12%	0.01%	0.23%	0.03%	-0.11%	-0.02%
过去三个月	0.24%	0.01%	-0.43%	0.04%	0.67%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.35%	0.01%	-0.31%	0.04%	0.66%	-0.03%

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	0.08%	0.01%	0.23%	0.03%	-0.15%	-0.02%
过去三个月	0.06%	0.01%	-0.43%	0.04%	0.49%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.18%	0.01%	-0.31%	0.04%	0.49%	-0.03%

注:中科沃土沃安债券型证券投资基金自2019年3月18日起转型为中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金

3.2.2 自基金转型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



注:1. 中科沃土沃安债券型证券投资基金自2019年3月18日起转型为中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金

2.转型前,"过去三个月"计算期间为2019年3月17日前推3个月,即2018年12月18日至2019年3月17日,其他区间依此类推

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

注:1.本基金合同于2018年8月22日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.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1.42亿元,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2019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、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。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(转型后)

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	2019年3月18日	-	9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、中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金和中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金基金经理。中国国籍,具有基金从业资格。
乐瑞祺	总经理助理、基金经理	2019年3月29日	-	14年	数量经济学硕士,曾任衡泰软件定量分析师、产品经理,博时基金基金经理助理,民生加银基金基金经理、投资部总监、投委会委员,方圆360资产管理有限公司执行总经理、投资经理,第一创业证券资产管理部投资总监,现任中科沃土基金管理有限公司总经理助理、中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金、中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金、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和中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理。中国国籍,具有基金从业资格。

注:1.此处的"离任日期"为公告确定的解聘日期,马洪娟的"任职日期"为基金合同生效之日,乐瑞祺的"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。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介(转型前)

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	-	9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、中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金和中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金基金经理。中国国籍,具有基金从业资格。
李昱	副总经理兼任权益投资部总经理、基金经理	2018年8月22日	2019年5月8日	23年	管理学硕士。曾任广发证券股份有限公司环市东营业部业务经理、投资理财部投资经理、资产管理部投资经理,新华基金管理有限公司专户管理部副总监、专户管理部负责人、基金管理部基金经理、基金管理部副总监,中科沃土基金管理有限公司副总经理兼任权益投资部总经理、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金和中科沃土沃安债券型证券投资基金基金经理。中国国籍,具有基金从业资格。

注:1.此处的"离任日期"为公告确定的解聘日期,李昱、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。

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

报告期内债券市场收益率经历了先上后下的过程,整体收益率小幅上行。宏观经济方面,2019年上半年GDP增速6.3%,经济仍面临较大的下行压力,总体来看,基建投资反弹乏力,地产投资开始走弱,制造业投资持续低迷,进出口前景不明,消费成为稳增长的最重要支撑。通胀方面,猪肉和水果价格的大幅上涨推升了CPI,也对通胀预期产生了一定的影响,但全年通胀高点或已过。政策方面,积极财政政策仍在推进,但在严控地方债务的前提下后续空间受到了制约。宽信用不断加码,但包商银行事件后续的影响短期难以消除,宽信用效果不佳。资金方面,上半年货币市场利率继续下行,但波动有所加大,包商银行事件导致流动性分层显著加剧。海外方面,美联储降息预期快速形成,海外多国纷纷开启降息周期,全球流动性或将全面宽松。报告期内,利率债方面,十年国债收益率基本走平,十年国开债收益率小幅下行3bp,,从年初的3.64%下行至6月底的3.61%附近。

报告期内,本基金对利率市场整体保持谨慎,持仓以中短久期的利率债配置为主,未来将根据债券市场变化灵活调整久期,为投资者获取稳健的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2019年3月17日,中科沃土沃安债券型证券投资基金报告期内(2019年1月1日-2019年3月17日)份额净值为1.0755元,本报告期份额净值增长率为7.04%,同期业绩比较基准增长率为3.11%。

截至2019年6月30日,本基金(中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金)报告期内(2019年3月18日-2019年6月30日)A类基金份额净值为1.0814元,本报告期基金份额净值增长率为0.35%,C类基金份额净值为1.0795元,本报告期基金份额净值增长率为0.18%,同期业绩比较基准收益率为-0.31%。

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2019年下半年,基本面方面,我们认为在地产开始走弱同时基建投资难以大幅走高的情况下,3季度经济下行压力仍大,基本面仍然构成对债市的重要支撑。通胀的年内高点也于二季度展现,未来结构性通胀难以构成债市核心掣肘。海外,贸易战一波三折,未来前景仍难乐观,持久战或难以避免。资金面方面,随着各国央行纷纷降息,全球重回宽松时代,在全球共振式宽松的背景下,我国货币政策料将维持宽松状态,为债市营造良好的货币环境。

本基金在2019下半年将根据市场变化合理调整组合久期以及杠杆水平,力争为投资者获取稳健回报。

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"基金收益与分配"之"(三)基金收益分配原则"的相关规定,本基金本年度未进行利润分配,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,本基金自2019年4月29日至2019年6月6日出现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。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本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)(转型后)

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:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年6月30日
资 产:		
银行存款		2,448,125.53
结算备付金		300,100.52
存出保证金		42,882.24
交易性金融资产		379,852,700.00
其中:股票投资		-
基金投资		-
债券投资		379,852,700.00
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		225,982,149.97
应收证券清算款		-
应收利息		10,738,096.39
应收股利		-
应收申购款		134,486,140.77
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		753,850,195.42
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		135,340.42
应付管理人报酬		78,524.79
应付托管费		31,409.89
应付销售服务费		32,270.19
应付交易费用		50,101.78
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		128,610.18
负债合计		456,257.25
所有者权益:		
实收基金		696,948,532.23
未分配利润		56,445,405.94
所有者权益合计		753,393,938.17
负债和所有者权益总计		753,850,195.42

注:报告截止日2019年6月30日,A类基金份额净值1.0814元,C类基金份额净值1.0795元;基金份额总额696,948,532.23份,下属分级基金的份额总额分别为:A类基金份额总额543,169,372.90份,C类基金份额总额153,779,159.33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:2019年3月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2019年3月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日
一、收入		1,158,336.48
1.利息收入		1,715,113.75
其中:存款利息收入		147,310.15
债券利息收入		1,080,649.99
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		487,153.61
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-531,231.69
其中:股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益		-531,231.69
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)		-75,738.71
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		50,193.13
减:二、费用		312,587.37
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	138,825.95
2. 托管费	6.4.9.2.2	55,530.36
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	92,913.07
4. 交易费用		10,558.19
5. 利息支出		1,723.70
其中:卖出回购金融资产支出		1,723.70
6. 税金及附加		-
7. 其他费用		13,036.10
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		845,749.11
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		845,749.11

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债券型证券投资基金

本报告期:2019年3月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年3月18日(基金合同生效日)至2019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)	47,337,780.96	3,670,556.17	51,008,337.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	845,749.11	845,749.11
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)	649,610,751.27	51,929,100.66	701,539,851.93
其中:1.基金申购款	1,767,747,010.38	140,245,824.72	1,907,992,835.10
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-1,118,136,259.11	-88,316,724.06	-1,206,452,983.17
五、期末所有者权益(基金净值)	696,948,532.23	56,445,405.94	753,393,938.17

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:

_____程文卫_____ _____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

中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金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根据中国证券监督管理委员会(以下简称 "中国证监会")《关于准予中科沃土沃安债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可〔2017〕504号),由基金发起人中科沃土基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《中科沃土沃安债券型证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")发起募集。本基金募集资金经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)审验,并由其出具《验证报告》(瑞华验字【2018】48090014号)。经向中国证监会备案,本基金基金合同于2018年8月22日正式生效。本基金的基金管理人为中科沃土基金管理有限公司,基金托管人为广州农村商业银行股份有限公司。

自2019年2月13日至2019年3月14日,中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金基金份额持有人大会一通讯方式召开,大会审议并通过了《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》,内容包括审议修改基金名称、基金的申购和赎回、基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制及业绩比较基准、估值方法、基金费用等条款以及因基金转型及法律法规变更而对《基金合同》进行相应修改等事项。持有人大会决议生效并公告后的第一个工作日为本基金转型实施日。《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》自基金转型实施日起生效,《中科沃土沃安债券型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围为: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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,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2019年6月30日的财务状况以及2019年3月18日至2019年6月30日的经营成果和基金净值变动情况。

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、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《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》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85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[2015]101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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1. 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税或增值税。

2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

3. 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在收到税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳,个人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,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4. 对基金取得的债券利息收入,由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,暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事A股买卖,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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

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。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

注:本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.9.1.2 债券交易

注:本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.9.1.3 债券回购交易

注:本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.9.1.4 权证交易

注:本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年3月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	138,825.95
其中:支付销售机构的客户维护费	26,951.79

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 × 0.20% ÷ 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。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年3月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	55,530.36

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

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。

6.4.9.2.3 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 2019年3月18日(基金合同生效日)至2019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	-	55,137.49	55,137.49
合计	-	55,137.49	55,137.49

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 × 0.25% ÷ 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。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场(含回购)的交易。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 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 2019年3月18日(基金合同生效日)至2019年6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

注:本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.9.4.2 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

注:本基金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。

6.4.9.5 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 2019年3月18日(基金合同生效日)至2019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	2,448,125.53	96,347.49

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。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 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2019年6月30日止,本基金无因认购新发/增发证券而持有的证券。

6.4.12.17 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:截至本报告期末2019年6月30日止,本基金未持有暂时停牌流通受限股票。

6.4.12.18 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.18.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019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。

6.4.12.18