

中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 25 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 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 | 6 |
| 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 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| 3.3 其他指标..... | 错误! 未定义书签。 |
| §4 管理人报告 | 12 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 12 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 14 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| §5 托管人报告 | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 17 |
| 6.1 资产负债表..... | 17 |
| 6.2 利润表..... | 18 |

| | |
|--|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 19 |
| 6.4 报表附注..... | 20 |
| §7 投资组合报告..... | 42 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 42 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 42 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 43 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 44 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 45 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 45 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 45 |
| 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..... | 45 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 47 |
| §10 重大事件揭示..... | 48 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 48 |
| 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..... | 48 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 48 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 48 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 48 |
| 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..... | 49 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 49 |
| 10.8 其他重大事件..... | 50 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 51 |
| 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..... | 51 |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....**错误！未定义书签。**

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------|--------------|
| 基金名称 | 中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 中科沃土沃盛纯债债券 | |
| 场内简称 | - | |
| 基金主代码 | 006498 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2019 年 12 月 12 日 | |
| 基金管理人 | 中科沃土基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 337,484.42 份 | |
| 基金合同存续期 | - | |
| 基金份额上市的证券交易所 | - | |
| 上市日期 | - | |
| 下属分级基金的基金简称: | 中科沃土沃盛纯债 A | 中科沃土沃盛纯债 C |
| 下属分级基金场内简称: | - | - |
| 下属分级基金的交易代码: | 006498 | 006499 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 33,084.00 份 | 304,400.42 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金在保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的当期收益以及长期稳定的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将采取自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的投资策略，通过对宏观经济、国家政策、信用主体评级水平等各种影响债券投资的因素细致深入的分析，确定债券组合资产在国债、金融债、信用债等品种之间的类属配置比例。在此基础之上，综合运用久期策略、期限结构策略、息差策略、个券选择策略等积极主动地进行资产投资组合的构建。在风险可控的前提下，力求基金资产的长期稳定增值。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为中债综合指数(全价)收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期收益与风险低于股票型基金、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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 曹萍 | 郭明 |
| | 联系电话 | 020-37128608 | 010-66105799 |

| | | | |
|--------|------|--|---------------------|
| | 电子邮箱 | caoping@richlandasm.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-018-3610 | 95588 |
| 传真 | | 020-23388997 | 010-66105798 |
| 注册地址 | | 广东省珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-5668 | 北京市西城区复兴门内大街 55 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 单元自编 06-08 号 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | | 510620 | 100140 |
| 法定代表人 | | 程文卫 | 陈四清 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.richlandasm.com.cn |
| 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 | 中科沃土沃盛纯债 A | 中科沃土沃盛纯债 C |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日) | 报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 124.86 | 71,619.66 |
| 本期利润 | -974.28 | 71,983.72 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0725 | 0.0051 |
| 本期加权平均净值利润率 | -7.41% | 0.51% |
| 本期基金份额净值增长率 | -2.46% | -3.17% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020年6月30日) | |
| 期末可供分配利润 | -1,159.66 | -12,788.10 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0351 | -0.0420 |
| 期末基金资产净值 | 32,293.17 | 295,008.86 |
| 期末基金份额净值 | 0.9761 | 0.9691 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2020年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | -2.39% | -3.09% |

- 注：1. 本基金合同生效日为 2019 年 12 月 12 日，截止 2020 年 6 月 30 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

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

中科沃土沃盛纯债 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 | 0.30% | 0.22% | -0.94% | 0.12% | 1.24% | 0.10% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | -1.02% | 0.24% | -1.04% | 0.12% | 0.02% | 0.12% |
| 过去六个月 | -2.46% | 0.18% | 0.79% | 0.11% | -3.25% | 0.07% |
| 过去一年 | -2.39% | 0.17% | 1.19% | 0.11% | -3.58% | 0.06% |
| 过去三年 | -2.39% | 0.17% | 1.19% | 0.11% | -3.58% | 0.06% |
| 过去五年 | -2.39% | 0.17% | 1.19% | 0.11% | -3.58% | 0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.39% | 0.17% | 1.19% | 0.11% | -3.58% | 0.06% |

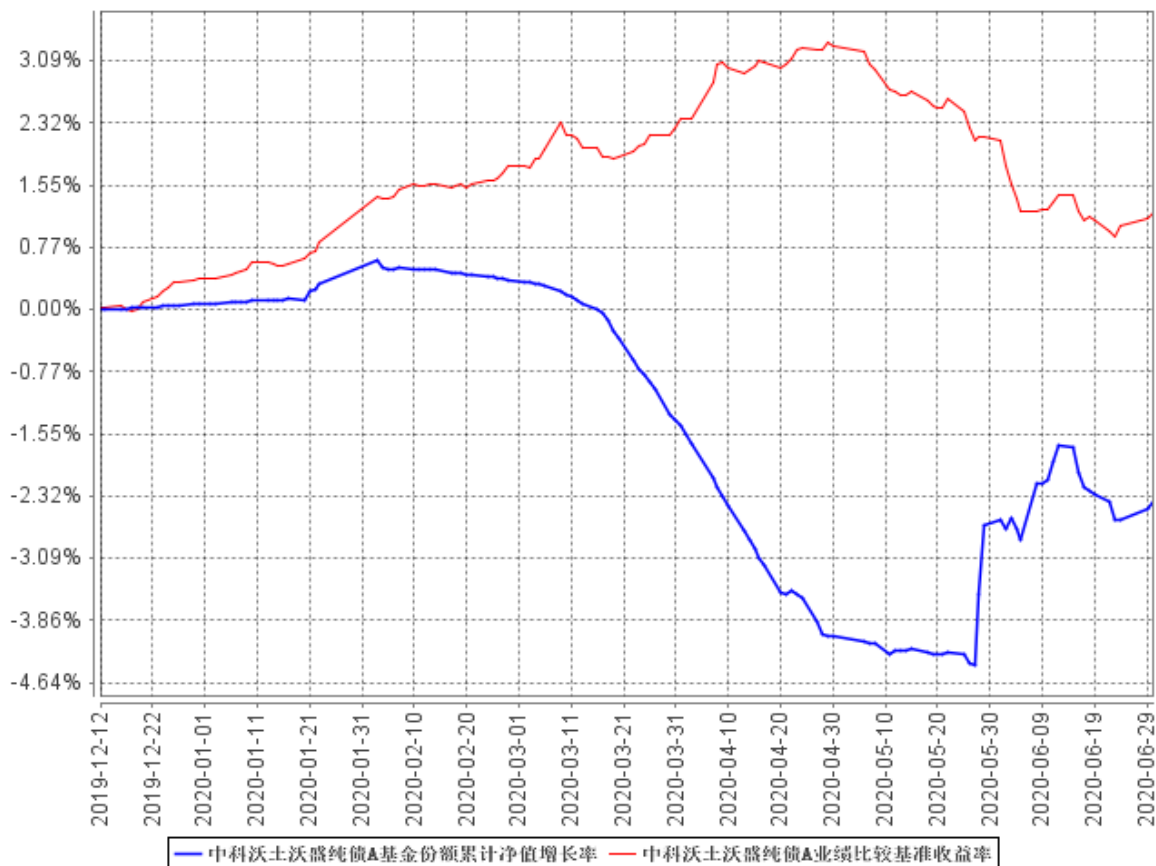
中科沃土沃盛纯债 C

| 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 | -0.32% | 0.17% | -0.94% | 0.12% | 0.62% | 0.05% |
| 过去三个月 | -1.67% | 0.22% | -1.04% | 0.12% | -0.63% | 0.10% |
| 过去六个月 | -3.17% | 0.17% | 0.79% | 0.11% | -3.96% | 0.06% |
| 过去一年 | -3.09% | 0.16% | 1.19% | 0.11% | -4.28% | 0.05% |
| 过去三年 | -3.09% | 0.16% | 1.19% | 0.11% | -4.28% | 0.05% |
| 过去五年 | -3.09% | 0.16% | 1.19% | 0.11% | -4.28% | 0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | -3.09% | 0.16% | 1.19% | 0.11% | -4.28% | 0.05% |

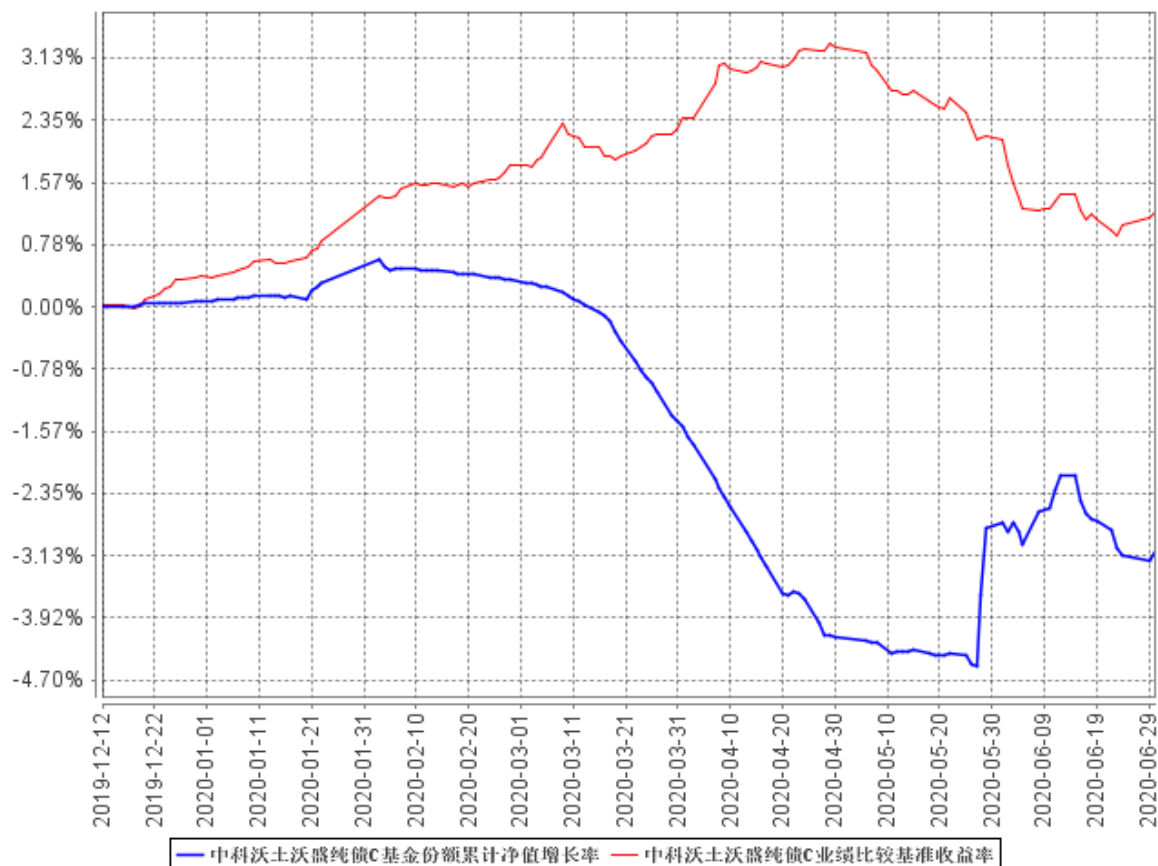
注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

中科沃土沃盛纯债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



中科沃土沃盛纯债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：1、本基金合同于 2019 年 12 月 12 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 2020 年 6 月 30 日，中科沃土旗下共管理 8 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、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 | | |
| 田钊 | 固定收益部投资副总监、基金经理 | 2019 年 12 月 13 日 | - | 7 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、中科沃土沃祥债券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的基金经理。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 12 月 13 日 | 2020 年 1 月 7 日 | 15 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，中科沃土基金管理有限公司总经理助理、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，乐瑞祺的“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

无相关情况。

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

报告期内受疫情冲击影响，市场波动较大，一季度疫情爆发后全球各主要央行纷纷实施宽松的货币政策。2019 年四季度经济整体温和扩张的态势被突发的新冠疫情打破，春节后经济陷入低

速运转状态，一季度增速被严重拖累，且随着海外疫情的恶化，全球经济的不确定性不断增加。这种情况下，央行进行了包括降准、定向降准，下调 OMO 和 MLF 利率等措施。春节后市场资金已十分充裕，资金利率中枢明显下移，债券市场收益率，特别是中短端利率下行幅度较大。

进入二季度，央行一度因经济受疫情冲击影响较大，实行了特殊情形下的宽松政策。4 月连续投放流动性并将超额存款准备金利率，由 0.72% 降至 0.35% 之后，资金利率更是明显下移，隔夜逆回购利率跌至 1% 以下。春债券市场收益率，特别是中短端利率快速下行。一季度新冠疫情的爆发确实对整个经济活动产生了切实的冲击，但 4 月以来，通过政府一系列的防控措施，以及对推动经济恢复所采取的一系列刺激政策，经济活动已经有了比较明显的改善迹象，央行也着手退出特殊时期的宽松手段，并向市场传递了比较强烈的指导信息。同时自 5 月起市场供给明显增加，流动性的边际收紧叠加拥挤的仓位导致市场在二季度出现了大幅调整，部分品种回调超过 100bp，已经回到春节前的收益率水平，资金中枢亦出现了明显抬升。

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盛纯债 A 基金份额净值为 0.9761 元，本报告期基金份额净值增长率为 -2.46%；截至本报告期末中科沃土沃盛纯债 C 基金份额净值为 0.9691 元，本报告期基金份额净值增长率为 -3.17%；同期业绩比较基准收益率为 0.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年的货币及债券市场，由于我国在疫情期间采取果断、有效的措施，目前基本保持着从疫情的停滞状态中逐步恢复的趋势，央行逐步撤出疫情期间极度宽松的货币政策，资金价格有望向政策利率震荡收敛。但鉴于海外疫情蔓延，外需不确定性较大，下半年经济增长的压力依然存在，我们预计央行依然将较为宽松和稳定的货币环境，配合今年稳增长、稳就业等政策目标的推进。

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，本基金本报告期未进行利润分配，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

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日以上基金份额持有人数量不满二百人和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盛纯债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的有关规定，不存在任何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，中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金的管理人——中科沃土基金管理有限公司在中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对中科沃土基金管理有限公司编制和披露的中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 84,405.10 | 104,683,054.39 |
| 结算备付金 | | 29,185.54 | - |
| 存出保证金 | | 984.91 | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 274,795.00 | 7,004,200.00 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 274,795.00 | 7,004,200.00 |
| 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 | - | 55,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 3,349.35 | 231,224.78 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 499.60 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 393,219.50 | 166,918,479.17 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | | |
| 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 | | - | 4,994,928.77 |
| 应付赎回款 | | 10,365.11 | 9.98 |
| 应付管理人报酬 | | 147.59 | 37,413.26 |
| 应付托管费 | | 36.89 | 9,353.32 |
| 应付销售服务费 | | 94.76 | 28,059.57 |
| 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 | 55,273.12 | - |
| 负债合计 | | 65,917.47 | 5,069,764.90 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 337,484.42 | 161,722,238.51 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -10,182.39 | 126,475.76 |
| 所有者权益合计 | | 327,302.03 | 161,848,714.27 |
| 负债和所有者权益总计 | | 393,219.50 | 166,918,479.17 |

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，中科沃土沃盛纯债 A 基金份额净值 0.9761 元，基金份额总额 33,084.00 份；中科沃土沃盛纯债 C 基金份额净值 0.9691 元，基金份额总额 304,400.42 份。中科沃土沃盛纯债债券份额总额合计为 337,484.42 份。

6.2 利润表

会计主体：中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|---|
| 一、收入 | | 182,253.51 | - |
| 1.利息收入 | | 129,413.89 | - |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 69,287.67 | - |
| 债券利息收入 | | 12,752.69 | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 47,373.53 | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 27,608.38 | - |
| 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 | 27,608.38 | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 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 | -735.08 | - |
| 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 | 25,966.32 | - |
| 减：二、费用 | | 111,244.07 | - |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 27,299.00 | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 6,824.76 | - |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 20,454.42 | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 38.68 | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | - | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 56,627.21 | - |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 71,009.44 | - |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 71,009.44 | - |

注：本基金的基金合同于 2019 年 12 月 12 日生效，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 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） | 161,722,238.51 | 126,475.76 | 161,848,714.27 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 71,009.44 | 71,009.44 |
| 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） | -161,384,754.09 | -207,667.59 | -161,592,421.68 |
| 其中：1.基金申购款 | 3,274,946.58 | -1,818.59 | 3,273,127.99 |
| 2.基金赎回款 | -164,659,700.67 | -205,849.00 | -164,865,549.67 |
| 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） | | | |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 337,484.42 | -10,182.39 | 327,302.03 |

注：本基金的基金合同于 2019 年 12 月 12 日生效，无上年度可比期间数据。

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：

| | | |
|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|
| <u> 于建伟 </u> | <u> 程文卫 </u> | <u> 李茂 </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

中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]第 1206 号关于准予《中科沃土沃盛创新驱动混合型证券投资基金注册》的批复》核准，由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》和《中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 200,729,388.25 元，业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字(2019)48420005 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金合同》于 2019 年 12 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,729,388.25 份基金份额，其中认购资金利息折合 225.22 份基金份额。本基金的基金管理人为中科沃土基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

根据《中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/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。在投资人认购/申购时收取认购/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、不收取认购/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《样本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和上市交易的债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分)、债券回购、同业存单、银行存款、现金、资产支持证券、国债期货。本基金的业

绩比较基准为：中债综合指数（全价）收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人中科沃土基金管理有限公司于 2020 年 8 月 28 日批准报出。

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(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》、《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表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 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.3.1 会计年度

会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.3.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.3.3 金融资产和金融负债的分类

(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。

6.4.3.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

6.4.3.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息

支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.3.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.3.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.3.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.3.9 收入/(损失)的确认和计量

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。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。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。

6.4.3.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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。

6.4.3.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，具体收益分配安排详见基金管理人届时公告

2、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%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

4、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

5、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

6.4.3.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.3.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.5 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[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》、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股票、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 2018 年 1 月 1 日起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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款 | 84,405.10 |
| 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： | 84,405.10 |

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020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 | 270,130.08 | 274,795.00 |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | 270,130.08 | 274,795.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 270,130.08 | 274,795.00 | 4,664.92 |

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 7.93 |
| 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 | 3.60 |
| 应收债券利息 | 3,330.46 |
| 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 | 7.36 |
| 合计 | 3,349.35 |

6.4.6.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.6.7 应付交易费用

本报告期末本基金无应付交易费用。

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020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 | 55,273.12 |

| | |
|----|-----------|
| 合计 | 55,273.12 |
|----|-----------|

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 中科沃土沃盛纯债 A | | |
|---------------|---------------------------------------|-------------|
| 项目 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 2,450.13 | 2,450.13 |
| 本期申购 | 160,314.96 | 160,314.96 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -129,681.09 | -129,681.09 |
| - 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 | 33,084.00 | 33,084.00 |

金额单位：人民币元

| 中科沃土沃盛纯债 C | | |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| 项目 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 161,719,788.38 | 161,719,788.38 |
| 本期申购 | 3,114,631.62 | 3,114,631.62 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -164,530,019.58 | -164,530,019.58 |
| - 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 | 304,400.42 | 304,400.42 |

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。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

| 中科沃土沃盛纯债 A | | | |
|------------|-----------|-----------|---------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 1.59 | 0.08 | 1.67 |
| 本期利润 | 124.86 | -1,099.14 | -974.28 |
| 本期基金份额交易 | -1,286.11 | 1,467.89 | 181.78 |

| | | | |
|----------|-----------|-----------|-----------|
| 产生的变动数 | | | |
| 其中：基金申购款 | -6,187.94 | 2,987.04 | -3,200.90 |
| 基金赎回款 | 4,901.83 | -1,519.15 | 3,382.68 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -1,159.66 | 368.83 | -790.83 |

单位：人民币元

| 中科沃土沃盛纯债 C | | | |
|----------------|-------------|-----------|-------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 121,185.27 | 5,288.82 | 126,474.09 |
| 本期利润 | 71,619.66 | 364.06 | 71,983.72 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -205,593.03 | -2,256.34 | -207,849.37 |
| 其中：基金申购款 | -921.59 | 2,303.90 | 1,382.31 |
| 基金赎回款 | -204,671.44 | -4,560.24 | -209,231.68 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -12,788.10 | 3,396.54 | -9,391.56 |

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 16,194.11 |
| 定期存款利息收入 | 26,899.94 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 4,554.78 |
| 其他 | 21,638.84 |
| 合计 | 129,413.89 |

6.4.6.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.6.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------|----------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 10,756,546.62 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 10,499,873.72 |
| 减：应收利息总额 | 229,064.52 |
| 买卖债券差价收入 | 27,608.38 |

6.4.6.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.6.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.6.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -735.08 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | -735.08 |
| ——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 | -735.08 |

6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----|----------------------------|
| | |

| | |
|---------|-----------|
| 基金赎回费收入 | 25,966.32 |
| 合计 | 25,966.32 |

6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 38.68 |
| 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 | 38.68 |

6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 16,256.59 |
| 信息披露费 | 39,016.53 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费 | 1,354.09 |
| 合计 | 56,627.21 |

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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

-

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

| 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 |

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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 |
|-----------------|----------------------|
| | 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 | 27,299.00 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 6,014.14 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.4% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------|---------------------------------|
| | 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 | 6,824.76 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.9.2.3 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 | | |
|----------------|---------------------------------|------------|-----------|
| | 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 | | |
| | 中科沃土沃盛纯债 A | 中科沃土沃盛纯债 C | 合计 |
| 中科沃土基金管理有限公司 | - | 11,407.47 | 11,407.47 |
| 合计 | - | 11,407.47 | 11,407.47 |

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 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场（含回购）的交易。

6.4.9.4 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

6.4.9.4.1 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

本基金本报告期内未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.9.4.2 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

本基金本报告期内未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.9.5.2 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。

6.4.9.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日 | |
|--------------|----------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 84,405.10 | 16,194.11 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.11 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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 2020 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。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌流通受限股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 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。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 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。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.12 金融工具风险及管理

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。

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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 2020 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。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.12.2.2 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。

6.4.12.2.3 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。

6.4.12.2.4 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 2020 年 6 月 30 日 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 274,795.00 | - |
| 合计 | 274,795.00 | - |

6.4.12.2.5 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。

6.4.12.2.6 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。

6.4.12.3 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。

6.4.12.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2020年6月30 日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1 年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------|------------|-----------|------------|------|------------|-----------|------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 84,405.10 | - | - | - | - | - | 84,405.10 |
| 结算备付金 | 29,185.54 | - | - | - | - | - | 29,185.54 |
| 存出保证金 | 984.91 | - | - | - | - | - | 984.91 |
| 交易性金融资产 | - | 30,045.00 | - | - | 244,750.00 | - | 274,795.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 3,349.35 | 3,349.35 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 499.60 | 499.60 |
| 资产总计 | 114,575.55 | 30,045.00 | - | - | 244,750.00 | 3,848.95 | 393,219.50 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 10,365.11 | 10,365.11 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 147.59 | 147.59 |

| | | | | | | | |
|---------------------|----------------|-----------|--------|------|------------|---------------|-----------------|
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 36.89 | 36.89 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 94.76 | 94.76 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 55,273.12 | 55,273.12 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 65,917.47 | 65,917.47 |
| 利率敏感度缺口 | 114,575.55 | 30,045.00 | - | - | 244,750.00 | -62,068.52 | 327,302.03 |
| 上年度末 2019年12月31日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 104,683,054.39 | - | - | - | - | - | -104,683,054.39 |
| 交易性金融资产 | 7,004,200.00 | - | - | - | - | - | 7,004,200.00 |
| 买入返售金融资产 | 55,000,000.00 | - | - | - | - | - | 55,000,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 231,224.78 | 231,224.78 |
| 资产总计 | 166,687,254.39 | - | - | - | - | 231,224.78 | 166,918,479.17 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 4,994,928.77 | 4,994,928.77 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 9.98 | 9.98 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 37,413.26 | 37,413.26 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 9,353.32 | 9,353.32 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 28,059.57 | 28,059.57 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 5,069,764.90 | 5,069,764.90 |
| 利率敏感度缺口 | 166,687,254.39 | - | - | - | - | -4,838,540.12 | 161,848,714.27 |

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。-

6.4.12.4.1.2 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 | | 上年度末 2019年12月31日 | |
|--------------|-------------------|---------------|---------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | - | - | - | - |

| | | | | |
|---------------|------------|-------|--------------|------|
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 274,795.00 | 83.96 | 7,004,200.00 | 4.33 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 274,795.00 | 83.96 | 7,004,200.00 | 4.33 |

6.4.12.4.1.3 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | - | | |
|----|-------------|-----------------------------|-------------------|
| 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（2020年6月30日） | 上年度末（2019年12月31日） |
| | 业绩比较基准上升 5% | 249.60 | 43,935.72 |
| | 业绩比较基准下降 5% | -249.60 | -43,935.72 |

6.4.13 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 2020 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 274,795.00 元，无属于第二或第三层次的余额(2019 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一层次的余额为 7,004,200.00 元，无属于第二或第三层次的余额)。

(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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易

不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会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股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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 2020 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(2019 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 | 274,795.00 | 69.88 |
| | 其中：债券 | 274,795.00 | 69.88 |
| | 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 | 113,590.64 | 28.89 |
| 8 | 其他各项资产 | 4,833.86 | 1.23 |
| 9 | 合计 | 393,219.50 | 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

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

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

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

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

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 | 244,750.00 | 74.78 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 30,045.00 | 9.18 |
| | 其中：政策性金融债 | 30,045.00 | 9.18 |
| 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 | 274,795.00 | 83.96 |

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 | 019218 | 12 国债 18 | 2,200 | 244,750.00 | 74.78 |
| 2 | 018007 | 国开 1801 | 300 | 30,045.00 | 9.18 |

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

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

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

本报告期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

(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。

7.11 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

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金未投资股票

7.11.3 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 | 984.91 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,349.35 |
| 5 | 应收申购款 | 499.60 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,833.86 |

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中未存在流通受限情况。

§ 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 |
| 中科沃土沃盛纯债 A | 40 | 827.10 | - | - | 33,084.00 | 100.00% |
| 中科沃土沃盛纯债 C | 148 | 2,056.76 | - | - | 304,400.42 | 100.00% |
| 合计 | 188 | 1,795.13 | - | - | 337,484.42 | 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 | 中科沃土沃盛纯债 A | 1,614.59 | 4.8800% |
| | 中科沃土沃盛纯债 C | 210,529.99 | 69.1600% |
| | 合计 | 212,144.58 | 74.0400% |

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

| 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 | 中科沃土沃盛纯债 A | 0~10 |
| | 中科沃土沃盛纯债 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 中科沃土沃盛纯债 A | 0 |
| | 中科沃土沃盛纯债 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 中科沃土沃盛纯 债 A | 中科沃土沃盛纯 债 C |
|-------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2019 年 12 月 12 日）基金 份额总额 | 2,450.13 | 200,726,938.12 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,450.13 | 161,719,788.38 |
| 本报告期基金总申购份额 | 160,314.96 | 3,114,631.62 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 129,681.09 | 164,530,019.58 |
| 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 | 33,084.00 | 304,400.42 |

§ 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，自 2020 年 1 月 7 日起，乐瑞祺离任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鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理，该事项已于同日通过《中国证券报》和公司官网披露；自同一日期起，乐瑞祺离任中科沃土沃嘉灵活配置型证券投资基金基金经理，该事项已于同日通过《证券日报》和公司官网披露；自同一日期起，乐瑞祺离任中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金基金经理，该事项已于同日通过《证券时报》和公司官网披露；自同一日期，乐瑞祺离任中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金基金经理，该事项已于同日通过《上海证券报》和公司官网披露。

本报告期内，自 2020 年 1 月 20 日起，谢子鹏担任公司非独立董事职务，同日起，朱为绎不再担任公司非独立董事职务，该事项已于同日向广东证监局报备。

自 2020 年 4 月 28 日起，傅军先生离任公司副总经理和首席信息官职务，李峰先生担任公司首席信息官职务。该事项经中科沃土基金管理有限公司第二届董事会第七次会议（2020 年 2 月 24 日）审议通过（有效票 9 票，同意 9 票，反对 0 票，弃权 0 票），公司在 2020 年 4 月 28 日向监管部门报告该项变更，并于 2020 年 4 月 30 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司官网进行信息披露。

自 2020 年 5 月 18 日起，程文卫先生离任公司总经理职务并转任公司常务副总经理职务，于建伟先生担任公司总经理职务。该事项经中科沃土基金管理有限公司第二届董事会第八次会议（2020 年 3 月 11 日）审议通过（有效票 9 票，同意 9 票，反对 0 票，弃权 0 票）。公司在 2020 年 5 月 18 日向监管部门报告该项变更，并于 2020 年 5 月 20 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司官网进行信息披露。

自 2020 年 6 月 22 日起，林峰先生担任公司副总经理职务。该事项经中科沃土基金管理有限公司第二届董事会第九次会议（2020 年 4 月 29 日）审议通过（有效票 9 票，同意 9 票，反对 0 票，弃权 0 票）。公司在 2020 年 6 月 22 日向监管部门报告该项变更，并于 2020 年 6 月 24 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司官网进行信息披露。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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 | | 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 | |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东莞证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国融证券 | 2 | - | - | - | - | - |

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 | | 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 |
| 国信证券 | 13,997,685.90 | 100.00% | 315,600,000.00 | 100.00% | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东莞证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国融证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 中科沃土基金管理有限公司关于新增盈米基金为旗下部分基金销售机构的公告 | 证券时报以及基金管理人网站 | 2020年3月30日 |
| 2 | 中科沃土基金管理有限公司关于新增麟龙投资为旗下部分基金销售机构的公告 | 证券时报以及基金管理人网站 | 2020年4月9日 |

影响投资者决策的其他重要信息

10.9 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 |
| 机构 | 1 | 20200106-20200113 | 32,000,000.00 | - | 32,000,000.00 | - | - |
| | 2 | 20200116-20200317 | - | 2,995,805.87 | 2,995,805.87 | - | - |
| | 3 | 20200114-20200115 | 20,000,000.00 | - | 20,000,000.00 | - | - |
| 个人 | 1 | 20200305-20200630 | 400,099.46 | - | 200,000.00 | 200,099.46 | 59.29% |
| 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> | | | | | | | |

中科沃土基金管理有限公司

2020 年 8 月 28 日