

中科沃土货币市场基金 2017 年半年度报告

2017 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：广州农村商业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 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 2017 年 8 月 18 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 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.....	7
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
§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.....	12
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.....	13
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.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 债券回购融资情况.....	40
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	41
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.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	43
7.8 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
7.9 投资组合报告附注.....	43
§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.....	46
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
10.5 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.6 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.7 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
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.....	52
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53

12.3 查阅方式.....53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中科沃土货币市场基金	
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	443, 578, 159. 42 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	32, 808, 031. 03 份	410, 770, 128. 39 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。
--	--------

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	袁静
	联系电话	020-23388979	020-28019512
	电子邮箱	yangmin@richlandasm.com.cn	Yuanjing1@grcbank.com
客户服务电话		400-018-3610	95313
传真		020-23388997	020-22389031
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路 6号105室-5668	广州市天河区珠江新城华夏路1 号信合大厦
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	广州市天河区珠江新城华夏路1 号信合大厦
邮政编码		510620	510623
法定代表人		朱为绎	王继康

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、上海证券报、证券时报
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

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	中科沃土货币 A	中科沃土货币 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	623,679.65	12,619,287.42
本期利润	623,679.65	12,619,287.42
本期净值收益率	1.7956%	1.9169%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	32,808,031.03	410,770,128.39
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	3.0973%	3.3628%

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	0.3148%	0.0013%	0.1125%	0.0000%	0.2023%	0.0013%
过去三个月	0.9402%	0.0011%	0.3413%	0.0000%	0.5989%	0.0011%
过去六个月	1.7956%	0.0010%	0.6788%	0.0000%	1.1168%	0.0010%

过去一年	2.9806%	0.0020%	1.3688%	0.0000%	1.6118%	0.0020%
自基金合同 生效起至今	3.0973%	0.0021%	1.4625%	0.0000%	1.6348%	0.0021%

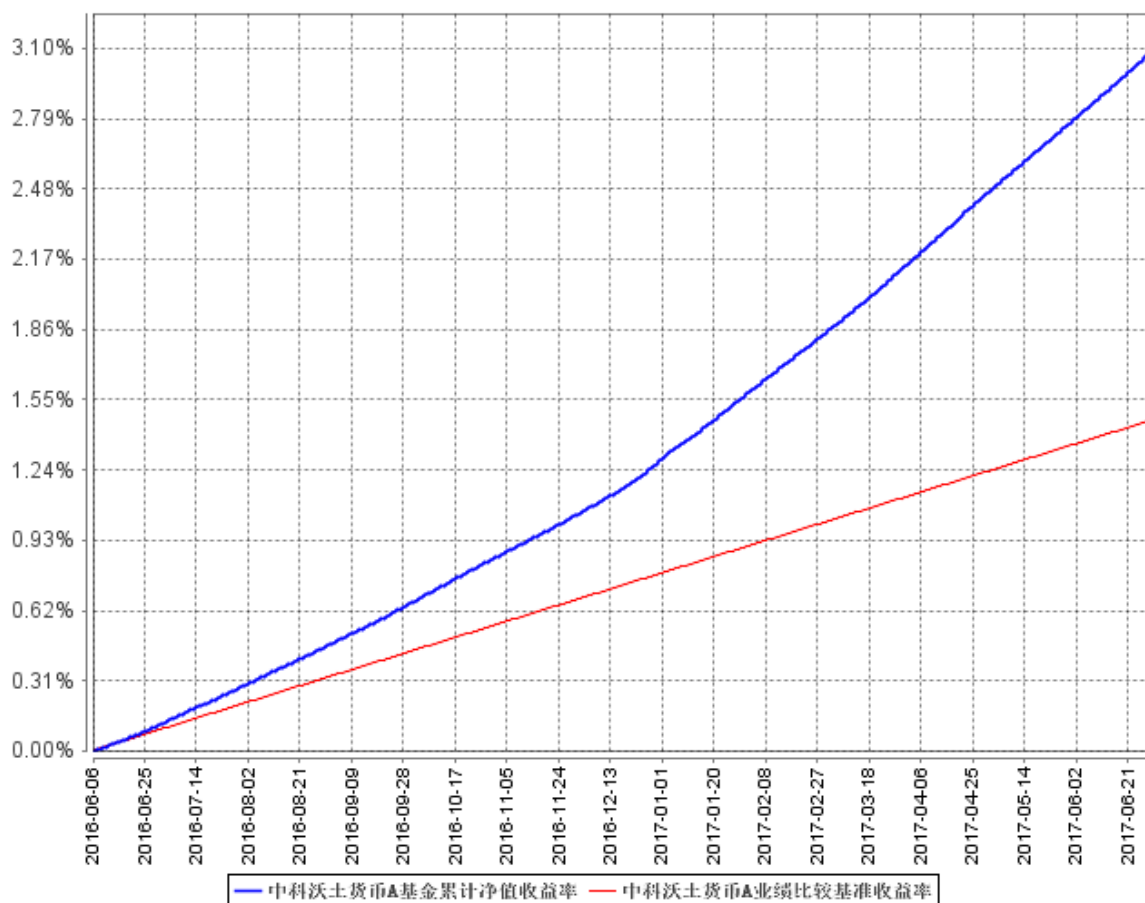
中科沃土货币 B

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	0.3349%	0.0013%	0.1125%	0.0000%	0.2224%	0.0013%
过去三个月	1.0005%	0.0011%	0.3413%	0.0000%	0.6592%	0.0011%
过去六个月	1.9169%	0.0010%	0.6788%	0.0000%	1.2381%	0.0010%
过去一年	3.2284%	0.0020%	1.3688%	0.0000%	1.8596%	0.0020%
自基金合同 生效起至今	3.3628%	0.0021%	1.4625%	0.0000%	1.9003%	0.0021%

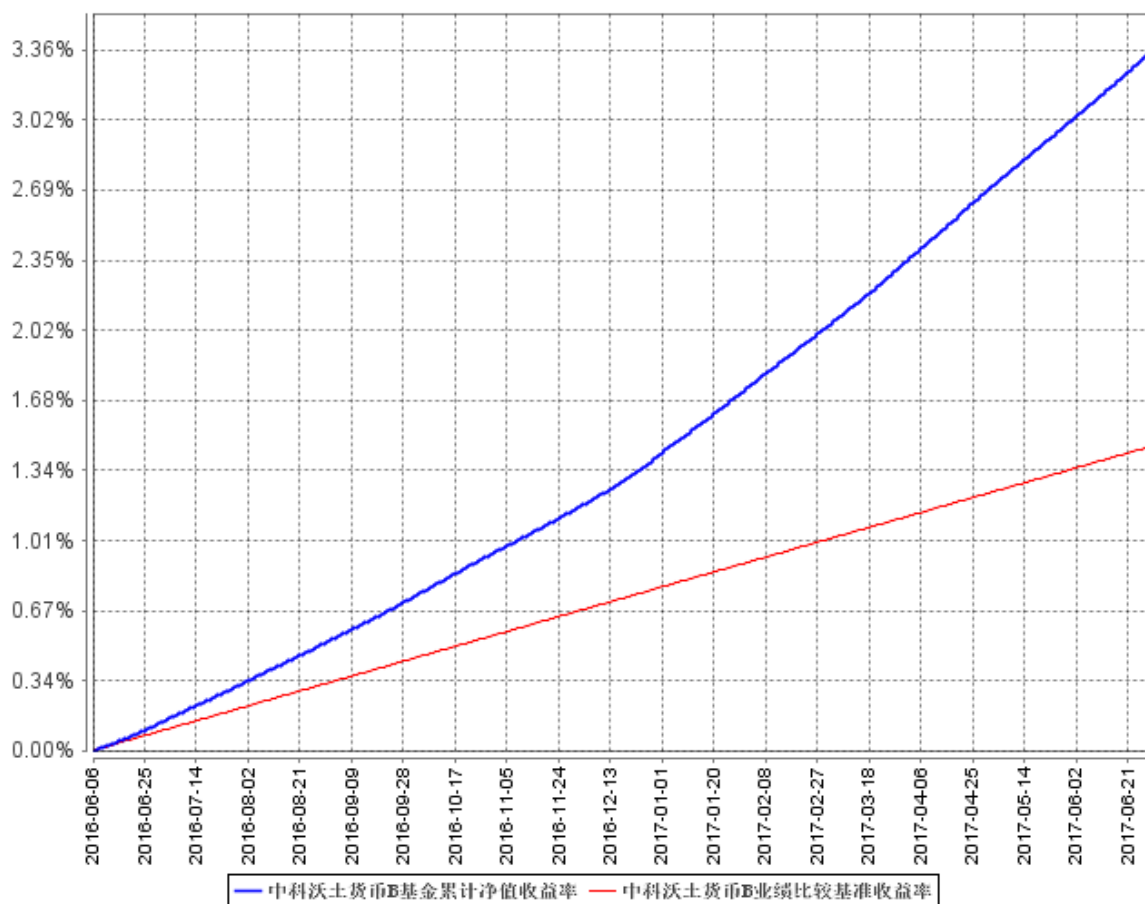
注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

中科沃土货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中科沃土货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 2017 年 6 月 30 日，中科沃土旗下共管理 3 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。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		
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

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

报告期内货币政策维持稳健偏紧状态，央行在一月底、2月初提高了 TLF、MLF 及逆回购利率，三月美联储加息后，央行再次采取提高公开市场操作利率进行应对，资金价格抬升明显。银行间隔夜和 7 天质押式回购利率中枢分别从年初的 2.3%和 2.6%逐步上升到半年末的 2.7%和 3.2%，6月央行呵护资金面，在中上旬创出高点后月底资金面呈现较为宽松状态。现券方面，报告期内收益率整体呈现震荡走高趋势，AAA 级短期融资券的收益率从年初的 3.9%下跌到 1 月中旬的 3.6%，然后震荡上行，收益率在 5 月中上旬达到高点 4.6%，其后缓慢下跌，截至 6 月末，收益率维持 4.4%附近。

报告期内，本基金在资产配置上以高等级的同业存单、存款和回购为主，在保证良好的流动性的同时，择机拉长组合剩余期限，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

本报告期内科沃土货币 A 的基金份额净值收益率为 1.7956%，本报告期内科沃土货币 B 的基金份额净值收益率为 1.9169%，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 2017 年下半年，基本面方面，我们认为 3 季度经济增长将维持整体平稳，但后续随着房地产投资的回落，经济面临一定的下行压力。通胀水平维持低位运行，通胀担忧基本消除。政策

面方面，金融去杠杆仍在进行中，相应的监管政策细则仍在酝酿当中，同时货币政策料将维持稳健中性基调，预计 2017 年下半年资金面波动将会有所下降，但由于去杠杆仍未结束，监管细则尚未出台，海外市场仍然存在较大的不确定性，下半年资金面整体仍将呈现紧平衡的局面。

本基金在 2017 年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 623,679.65 元，中科沃土货币 B 分配收益累计 12,619,287.42 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，本基金托管人广州农村商业银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全托管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运 作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

广州农村商业银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——中科沃土基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求；各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

广州农村商业银行股份有限公司依法对基金管理人——中科沃土基金管理有限公司编制的“中科沃土货币市场基金 2017 年半年度报告”进行了复核，报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的。

§ 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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	238,221,576.28	633,710,323.02
结算备付金		-	-
存出保证金		-	21,190.23
交易性金融资产	6.4.7.2	188,452,994.62	119,947,978.82
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		188,452,994.62	119,947,978.82
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	39,800,299.70	349,923,804.88
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,022,126.36	3,129,168.07
应收股利		-	-
应收申购款		19,260.00	95,336.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	880.75	-
资产总计		468,517,137.71	1,106,827,801.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		24,499,867.75	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		136,346.76	237,089.44
应付托管费		36,359.14	63,223.84
应付销售服务费		12,241.00	14,961.14
应付交易费用	6.4.7.7	13,930.26	10,925.36
应交税费		-	-
应付利息		3,400.25	-
应付利润		49,231.63	121,798.65
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	187,601.50	209,000.00
负债合计		24,938,978.29	656,998.43
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	443,578,159.42	1,106,170,802.77
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		443,578,159.42	1,106,170,802.77
负债和所有者权益总计		468,517,137.71	1,106,827,801.20

注：报告截止日 2017 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 443,578,159.42 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 32,808,031.03 份，B 类基金份额总额 410,770,128.39 份。

6.2 利润表

会计主体：中科沃土货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至2017 年6月30日	上年度可比期间 2016年6月6日(基金 合同生效日)至2016年 6月30日
一、收入		14,953,400.21	6,908,900.75
1.利息收入		14,937,167.08	6,908,900.75
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,783,824.55	6,889,865.84
债券利息收入		2,949,911.46	1,738.48
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,203,431.07	17,296.43
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		16,233.13	-
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	16,233.13	-
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		-	-
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）	6.4.7.16	-	-
减：二、费用		1,710,433.14	1,218,838.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,053,712.15	889,450.02
2. 托管费	6.4.10.2.2	280,989.90	237,186.66

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	76,645.28	68,078.68
4. 交易费用	6.4.7.17	-	-
5. 利息支出		110,285.06	-
其中：卖出回购金融资产支出		110,285.06	-
6. 其他费用	6.4.7.18	188,800.75	24,123.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,242,967.07	5,690,061.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,242,967.07	5,690,061.89

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	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	-	-13,242,967.07	-13,242,967.07

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)	443,578,159.42	-	443,578,159.42
项目	上年度可比期间 2016年6月6日(基金合同生效日)至2016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)	4,913,790,671.55	-	4,913,790,671.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,690,061.89	5,690,061.89
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)	-1,616,769,613.57	-	-1,616,769,613.57
其中: 1. 基金申购款	56,695,282.79	-	56,695,282.79
2. 基金赎回款	-1,673,464,896.36	-	-1,673,464,896.36
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)	-	-5,690,061.89	-5,690,061.89
五、期末所有者权益(基金净值)	3,297,021,057.98	-	3,297,021,057.98

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〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中科沃土货币市场基金基金合同》和中国证监会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，同时参照中国证券业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了计划的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

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重大会计政策变更。

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重大会计估计变更。

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重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《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[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. 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
2. 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债券免征营业税和增值税。
3. 对证券投资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，暂不缴纳企业所得税。
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。

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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	1, 221, 576. 28
定期存款	237, 000, 000. 00
其中：存款期限 1-3 个月	125, 000, 000. 00
存款期限 3 个月-1 年	112, 000, 000. 00

其他存款	-
合计:	238,221,576.28

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目		本期末 2017年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	188,452,994.62	188,580,640.00	127,645.38	0.0288%
	合计	188,452,994.62	188,580,640.00	127,645.38	0.0288%

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期内无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位: 人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中: 买断式逆回购
买入返售证券_银行间	39,800,299.70	-
合计	39,800,299.70	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	344.90
应收定期存款利息	1,124,811.48
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	858,180.82
应收买入返售证券利息	38,675.17
应收申购款利息	113.99
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	2,022,126.36

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	880.75
合计	880.75

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	13,930.26

合计	13,930.26
----	-----------

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	187,601.50
合计	187,601.50

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中科沃土货币 A		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,549,588.24	34,549,588.24
本期申购	67,521,212.87	67,521,212.87
本期赎回(以“-”号填列)	-69,262,770.08	-69,262,770.08
- 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	32,808,031.03	32,808,031.03

金额单位：人民币元

中科沃土货币 B

项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,071,621,214.53	1,071,621,214.53
本期申购	560,274,538.78	560,274,538.78
本期赎回(以“-”号填列)	-1,221,125,624.92	-1,221,125,624.92
- 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	410,770,128.39	410,770,128.39

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额，赎回含转换出、级别调整出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中科沃土货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	623,679.65	-	623,679.65
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-623,679.65	-	-623,679.65
本期末	-	-	-

单位：人民币元

中科沃土货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-

本期利润	12,619,287.42	-	12,619,287.42
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-12,619,287.42	-	-12,619,287.42
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	5,473.27
定期存款利息收入	8,777,783.42
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	107.26
其他	460.60
合计	8,783,824.55

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	480,597,832.13
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	479,391,231.87

减：应收利息总额	1,190,367.13
买卖债券差价收入	16,233.13

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未投资衍生工具。

6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.17 交易费用

本基金本报告期内无交易费用。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	148,765.71
其他	2,199.25
账户维护费	18,000.00
合计	188,800.75

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，本基金无需要作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无需要作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	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。

6.4.10 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发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 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 2017年1月1日至2017	上年度可比期间 2016年6月6日(基金合同生效日)

	年 6 月 30 日	至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,053,712.15	889,450.02
其中:支付销售机构的客户维护费	28,784.25	23,673.43

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:

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

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 6 月 6 日(基金合同生效日) 至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	280,989.90	237,186.66

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:

$$H=E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

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

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。

6.4.10.2.3 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
	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
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 6 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 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	3,304.86	27,089.59	30,394.45
广州农村商业银行股份有限公司	1,543.25	-	1,543.25
合计	4,848.11	27,089.59	31,937.70

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：

$H = E \times \text{基金销售服务费率} \div \text{当年天数}$

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。

6.4.10.3 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（含回购）的交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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
	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	-	36,002,921.31
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%
项目	上年度可比期间 2016 年 6 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 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	-	36,002,921.31
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	10,045,204.38
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	46,048,125.69
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	1.40%

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。

6.4.10.4.2 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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例
广东中广投资管理 有限公司	20,524,577.34	4.63%	17,236,260.58	1.56%

注：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。

除基金管理人之外的其他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。

6.4.10.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 6 月 6 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 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	1,221,576.28	5,473.27	166,837,781.67	236,202.04

注：本基金的部分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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

中科沃土货币A

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
623,829.07	-	-149.42	623,679.65	-

中科沃土货币B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
12,691,705.02	-	-72,417.60	12,619,287.42	-

6.4.12 期末（2017年6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

截至本报告期末2017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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2017年6月30日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 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

截至本报告期末2017年6月30日止，本基金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24,499,867.75元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
111717129	17光大银行CD129	2017年7月3日	98.97	250,000	24,742,500.00
合计				250,000	24,742,500.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017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。

6.4.13 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、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。

本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

截至 2017 年 6 月 30 日，除国债、央行票据和政策性金融债以外，本基金未持有其他债券。

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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	188,580,640.00	119,503,580.00
合计	188,580,640.00	119,503,580.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年（含）以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券、同业存单。

6.4.13.2.2 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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括现金、一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券（不包括可转换债券）、期限在一年以内（含一年）的债券回购、剩余期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、以及经中国证监会、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。无重大流动性风险。

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

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 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	238,221,576.28	-	-	-	238,221,576.28
交易性金融资产	188,452,994.62	-	-	-	188,452,994.62
买入返售金融资产	39,800,299.70	-	-	-	39,800,299.70
应收利息	-	-	-	-2,022,126.36	2,022,126.36
应收申购款	-	-	-	19,260.00	19,260.00
其他资产	-	-	-	880.75	880.75
资产总计	466,474,870.60	-	-	-2,042,267.11	468,517,137.71
负债					
卖出回购金融资产款	24,499,867.75	-	-	-	24,499,867.75
应付管理人报酬	-	-	-	136,346.76	136,346.76
应付托管费	-	-	-	36,359.14	36,359.14
应付销售服务费	-	-	-	12,241.00	12,241.00
应付交易费用	-	-	-	13,930.26	13,930.26
应付利息	-	-	-	3,400.25	3,400.25
应付利润	-	-	-	49,231.63	49,231.63
其他负债	-	-	-	187,601.50	187,601.50
负债总计	24,499,867.75	-	-	439,110.54	24,938,978.29
利率敏感度缺口	441,975,002.85	-	-	-1,603,156.57	443,578,159.42
上年度末 2016 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	633,710,323.02	-	-	-	633,710,323.02
存出保证金	21,190.23	-	-	-	21,190.23
交易性金融资产	119,947,978.82	-	-	-	119,947,978.82
买入返售金融资产	349,923,804.88	-	-	-	349,923,804.88
应收利息	-	-	-	-3,129,168.07	3,129,168.07

应收申购款	-	-	-	95,336.18	95,336.18
资产总计	1,103,603,296.95	-	-	-3,224,504.25	1,106,827,801.20
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	237,089.44	237,089.44
应付托管费	-	-	-	63,223.84	63,223.84
应付销售服务费	-	-	-	14,961.14	14,961.14
应付交易费用	-	-	-	10,925.36	10,925.36
应付利润	-	-	-	121,798.65	121,798.65
其他负债	-	-	-	209,000.00	209,000.00
负债总计	-	-	-	656,998.43	656,998.43
利率敏感度缺口	1,103,603,296.95	-	-	-2,567,505.82	1,106,170,802.77

注：表中按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	利率上升 25 个基点	-88,620.44	-14,688.21
	利率下降 25 个基点	88,620.44	14,688.21

6.4.13.4.2 外汇风险

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。本基金主要投资于本基金主要投资于具有良好流动性的货币市场工具，不投资股票、权证等其他交易性金融资产，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 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 2017 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 188,452,994.62 元，无属于第一层级和第三层级的余额（2016 年 12 月 31 日：第二层级 119,947,978.82 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	188,452,994.62	40.22
	其中:债券	188,452,994.62	40.22
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	39,800,299.70	8.49
	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	238,221,576.28	50.85
4	其他各项资产	2,042,267.11	0.44
5	合计	468,517,137.71	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	1.27	
	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	24,499,867.75	5.52
	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

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

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	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	66
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

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	63.82	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	16.27	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	10.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	1.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	7.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮	-	-

	动利率债		
合计		99.62	-

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	39,997,406.93	9.02
	其中：政策性金融债	39,997,406.93	9.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	148,455,587.69	33.47
8	其他	-	-
9	合计	188,452,994.62	42.48
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	111711240	17 平安银行 CD240	500,000	49,494,105.87	11.16
2	111717129	17 光大银行	500,000	49,482,673.03	11.16

		CD129			
3	111709254	17 浦发银行 CD254	500,000	49,478,808.79	11.15
4	160419	16 农发 19	400,000	39,997,406.93	9.02

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	0.0288%
报告期内偏离度的最低值	-0.0542%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0191%

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

本基金本报告期内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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期内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

本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,022,126.36
4	应收申购款	19,260.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	880.75
7	其他	-
8	合计	2,042,267.11

§ 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
中科沃土货币 A	2,014	16,289.99	17,871,628.77	54.47%	14,936,402.26	45.53%
中科沃土货币 B	17	24,162,948.73	410,770,128.39	100.00%	-	-
合计	2,031	218,403.82	428,641,757.16	96.63%	14,936,402.26	3.37%

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	中科沃土货币 A	4,460,732.55	13.60%
	中科沃土货币 B	-	-
	合计	4,460,732.55	1.01%

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	中科沃土货币 A	>100
	中科沃土货币 B	-
	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	-
	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	34,549,588.24	1,071,621,214.53
本报告期基金总申购份额	67,521,212.87	560,274,538.78
减：本报告期基金总赎回份额	69,262,770.08	1,221,125,624.92
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	32,808,031.03	410,770,128.39

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 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。

10.5 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。

10.6 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.6.1 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。

10.6.2 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
国泰君安	-	-	13,100,000.00	100.00%	-	-

10.7 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。

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旗下基金 2016 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017 年 1 月 3 日
2	中科沃土货币市场基金更新的招募说明书及其摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017 年 1 月 4 日
3	中科沃土基金管理有限公司关于新增国信证券为中科沃土货币市场基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017 年 1 月 17 日
4	中科沃土货币市场基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017 年 1 月 20 日

5	关于中科沃土货币市场基金 2017 年春节假期前两个工作日暂停申购及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 1 月 21 日
6	关于新增苏宁基金为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 2 月 15 日
7	中科沃土基金管理有限公司关于旗下基金之间开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 2 月 17 日
8	中科沃土基金管理有限公司关于开展旗下基金申购、定期定额投资、转换业务的费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 2 月 17 日
9	中科沃土基金管理有限公司关于新增同花顺基金为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 3 月 7 日
10	中沃土基金管理有限公司关于网上直销开通货币基金快速赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 3 月 14 日
11	中科沃土基金管理有限公司关于网上直销开通预约赎回和定期定额赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 3 月 16 日
12	中科沃土基金管理有限公司关于新增深圳新兰德为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 3 月 17 日
13	中科沃土基金管理有限公司关于新增珠海华润银行、兴业证券为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 3 月 23 日
14	关于中科沃土货币市场基金 2017 年清明节前两个工作日暂停申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 3 月 28 日
15	中科沃土基金管理有限公司关于新增肯特瑞财富为旗下部分基金销售机构	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 3 月 28 日

	的公告		
16	中科沃土货币市场基金 2016 年年度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 3 月 31 日
17	中科沃土基金管理有限公司关于新增 广州证券为旗下部分基金销售机构的 公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 4 月 11 日
18	中科沃土货币市场基金 2017 年第 1 季 度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 4 月 21 日
19	中科沃土基金管理有限公司关于新增 英大证券为旗下部分基金销售机构的 公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 5 月 6 日
20	中科沃土基金管理有限公司关于新增 新浪仓石、云湾投资为旗下部分基金销 售机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 5 月 16 日
21	中科沃土基金管理有限公司关于新增 中泰证券为旗下部分基金销售机构的 公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 5 月 19 日
22	关于中科沃土货币市场基金 2017 年端 午节前两个工作日暂停申购、定期定额 投资及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 5 月 24 日
23	中科沃土基金管理有限公司关于新增 伯嘉基金为旗下部分基金销售机构的 公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 6 月 2 日
24	中科沃土货币市场基金更新的招募说 明书及摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 7 月 1 日
25	中科沃土基金管理有限公司关于旗下 基金 2017 年 6 月 30 日基金资产净值和 基金份额净值公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及基金管理人网站	2017 年 7 月 1 日
26	中科沃土货币市场基金 2017 年第 2 季	中国证券报、上海证券报、	2017 年 7 月 21 日

	度报告	证券时报及基金管理人网站	
--	-----	--------------	--

§ 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
机构	1	2017 年 1 月 10 日至 2017 年 6 月 30 日	189,518,473.94	3,165,749.66	60,000,000.00	132,684,223.60	29.91%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
由于报告期内中科沃土货币市场基金的总规模下降，导致该名机构投资者持有份额比例被动超过 20%，实质上无特有风险。							

注：上述申购份额为红利再投资份额。

§ 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货币市场基金注册的文件；
- 2、《中科沃土货币市场基金基金合同》；
- 3、《中科沃土货币市场基金托管协议》；
- 4、《中科沃土基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

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

2017年8月29日