

中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券
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：交通银行股份有限公司

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、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。

基金托管人交通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、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 2020 年 1 月 1 日至 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 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| §5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 14 |
| 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 | 14 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 15 |
| 6.1 资产负债表 | 15 |
| 6.2 利润表 | 16 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 17 |
| 6.4 报表附注 | 18 |

| | |
|--|-----------|
| §7 投资组合报告 | 43 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 43 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 43 |
| 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..... | 44 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 45 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 61 |
| 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..... | 61 |
| 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..... | 61 |
| 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..... | 61 |
| 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..... | 61 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 61 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 62 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 62 |
| §8 基金份额持有人信息 | 63 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 63 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 63 |
| 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..... | 63 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况..... | 64 |
| §9 开放式基金份额变动 | 65 |
| §10 重大事件揭示 | 66 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 66 |
| 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..... | 66 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 66 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 66 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 66 |
| 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..... | 67 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 67 |
| 10.8 其他重大事件..... | 68 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|------------------------|-----------------|
| 基金名称 | 中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金 | |
| 基金简称 | 中科沃土沃瑞混合发起 | |
| 场内简称 | - | |
| 基金主代码 | 005855 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2019 年 1 月 14 日 | |
| 基金管理人 | 中科沃土基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 69,245,497.29 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: | 中科沃土沃瑞混合发起 A | 中科沃土沃瑞混合发起 C |
| 下属分级基金场内简称: | - | - |
| 下属分级基金的交易代码: | 005855 | 005856 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 26,189,365.55 份 | 43,056,131.74 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 通过系统化的方法精选环境、财务可持续的上市公司，通过精选个股和风险控制，力争为投资者创造超越业绩比较基准的回报。 |
| 投资策略 | 通过对经济周期及资产价格发展变化的理解，在把握经济周期性波动的基础上，动态评估不同资产类在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置及资产的稳健增长。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数(全价)收益率×40% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、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 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 曹萍 | 陆志俊 |
| | 联系电话 | 020-37128608 | 95559 |
| | 电子邮箱 | caoping@richlandasm.com.cn | luzj@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 400-018-3610 | 95559 |
| 传真 | | 020-23388997 | 021-62701216 |
| 注册地址 | | 广东省珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-5668 | 中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号 |
| 办公地址 | | 广东省广州市天河区珠江西路 | 中国(上海)长宁区仙霞路 18 |

| | | |
|-------|---------------------------------|--------|
| | 5号广州国际金融中心21楼01 单元自编 06-08 号 | 号 |
| 邮政编码 | 510620 | 200336 |
| 法定代表人 | 程文卫 | 任德奇 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 上海证券报 |
| 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 |

§ 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 | 中科沃土沃瑞混合发起 A | 中科沃土沃瑞混合发起 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 | 3,296,513.97 | 553,900.73 |
| 本期利润 | 6,740,182.53 | 5,801,389.64 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.4839 | 0.6244 |
| 本期加权平均净值利润率 | 32.57% | 41.01% |
| 本期基金份额净值增长率 | 36.17% | 36.64% |
| 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 | 12,100,841.25 | 19,652,483.30 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.4621 | 0.4564 |
| 期末基金资产净值 | 43,910,601.08 | 71,928,492.97 |
| 期末基金份额净值 | 1.6767 | 1.6706 |
| 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 | 67.67% | 67.06% |

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中科沃土沃瑞混合发起 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 | 11.30% | 1.09% | 4.23% | 0.53% | 7.07% | 0.56% |
| 过去三个月 | 19.16% | 1.02% | 7.36% | 0.54% | 11.80% | 0.48% |
| 过去六个月 | 36.17% | 1.46% | 1.30% | 0.90% | 34.87% | 0.56% |
| 过去一年 | 60.50% | 1.34% | 6.06% | 0.72% | 54.44% | 0.62% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 67.67% | 1.21% | 21.34% | 0.80% | 46.33% | 0.41% |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|

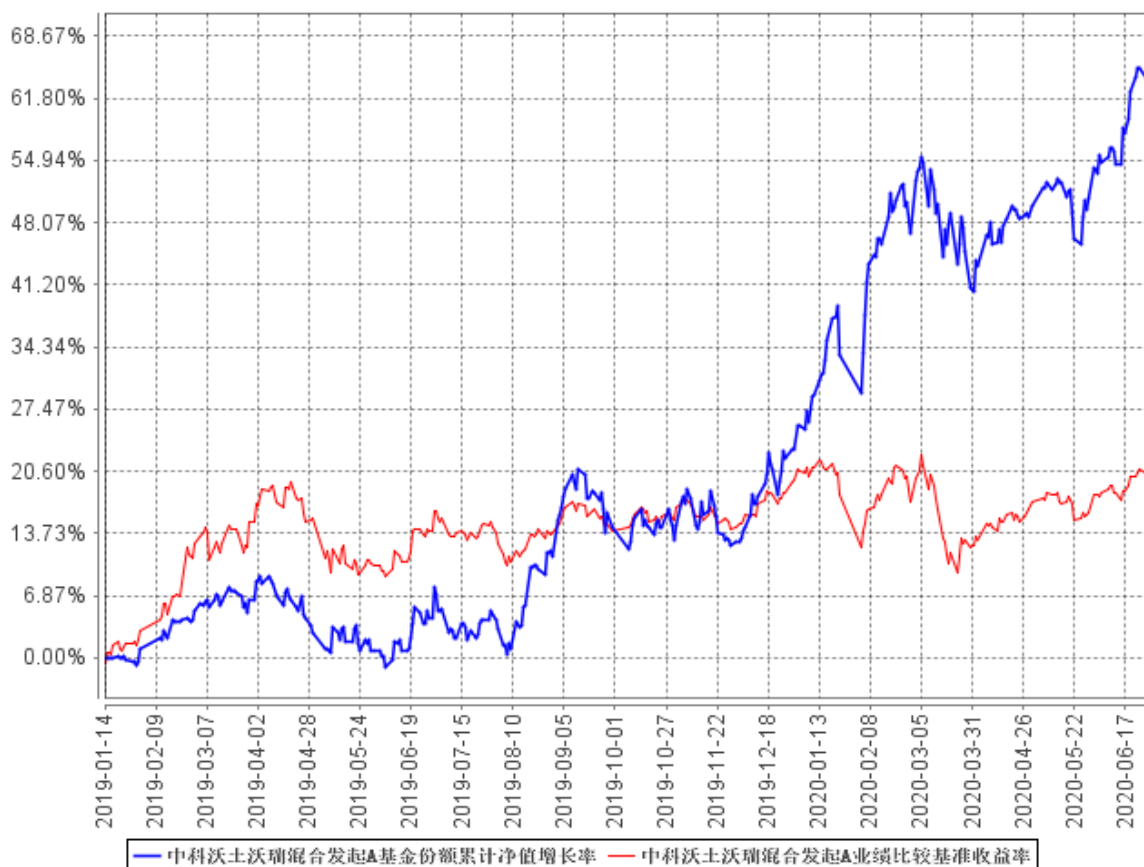
中科沃土沃瑞混合发起 C

| 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 | 11.23% | 1.09% | 4.23% | 0.53% | 7.00% | 0.56% |
| 过去三个月 | 19.17% | 1.02% | 7.36% | 0.54% | 11.81% | 0.48% |
| 过去六个月 | 36.64% | 1.46% | 1.30% | 0.90% | 35.34% | 0.56% |
| 过去一年 | 60.50% | 1.34% | 6.06% | 0.72% | 54.44% | 0.62% |
| 自基金合同生效起至今 | 67.06% | 1.21% | 21.34% | 0.80% | 45.72% | 0.41% |

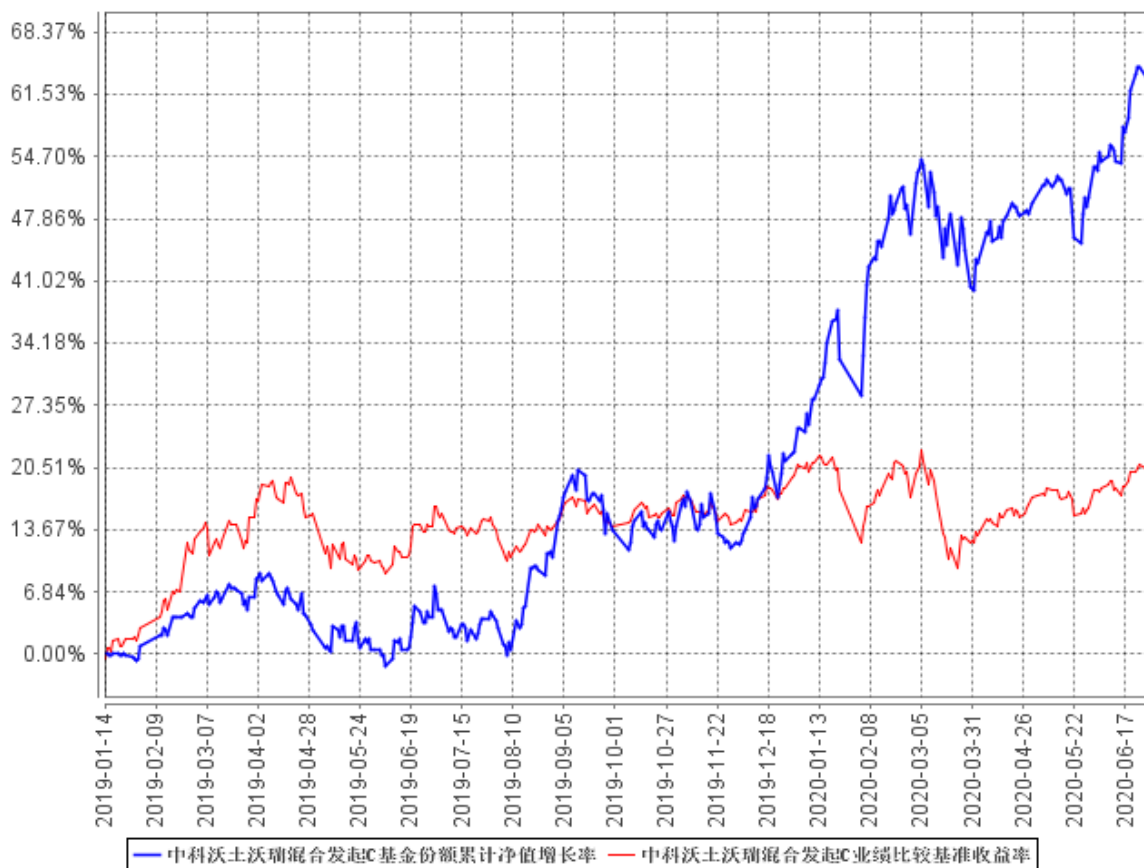
注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

中科沃土沃瑞混合发起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



中科沃土沃瑞混合发起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



§ 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 | | |
| 黄艺明 | 权益投资部副总经理、基金经理 | 2019 年 1 月 14 日 | - | 11 年 | 经济学硕士。曾任广东粤财信托有限公司研究员，金鹰基金管理有限公司基金经理助理、研究总监助理，七匹狼控股集团有限公司投资经理助理，广东富业盛德资产管理有限公司执行董事、投资总监，中科沃土基金管理有限公司专户投资部副总经理、投资经理，现任中科沃土基金管理有限公司权益投资部副总经理、中科沃土沃瑞灵活配置混合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。 |
| 林皓 | 基金经理 | 2019 年 11 月 8 日 | - | 4 年 | 工学硕士。曾任中科沃土基金管理有限公司研究部 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 研究员，现任中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：1. 此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，黄艺明的“任职日期”为基金合同生效之日，林皓的“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。

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

回顾 2020 年上半年，受新冠肺炎疫情影响，全球宏观经济阶段性下行。国内疫情防控取得成效，灵活适度的货币政策和积极有为财政政策有助于宏观经济和企业盈利的逐步回升，社会生活和企业生产逐步恢复。策略上沃瑞基金坚守多元策略，核心策略为精选业绩加速增长的行业与公司，辅助策略上把握事件驱动阶段性投资机会。

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瑞混合发起 A 基金份额净值为 1.6767 元，本报告期基金份额净值增长率为 36.17%；截至本报告期末中科沃土沃瑞混合发起 C 基金份额净值为 1.6706 元，本报告期基金份额净值增长率为 36.64%；同期业绩比较基准收益率为 1.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

小荷才露尖尖角，沃瑞基金对市场的看法仍然中性偏乐观，尽管仍然面临中美贸易摩擦、欧美疫情在复工后二次上行担忧、外围股市阶段涨幅较大可能呈现二次下行技术风险等不确定性，A 股市场波动性加大风险可能仍在，但整体伴随国内政策精准发力、企业复产复工，市场流动性整体宽裕的情况下，市场底部有望逐步抬高，结构性机会不断呈现。

网红经济，带货直播。地摊经济，人间烟火。中国生机，处处焕发。在消费占据经济增长主导作用的长期趋势下，我们将积极布局受益消费复苏的各类景气向上行业，包括但不限于新能源汽车、5G 手机、医药等产业链。

乘风破浪会有时，直挂云帆济沧海。在流动性充裕、新增资金进场背景下，老树发新芽，我们也将积极阶段性把握高股息、低估值蓝筹的估值修复性机会，这些机会可能集中在非银行金融、地产、建材和煤炭等行业。

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。

§ 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，基金托管人在中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，中科沃土基金管理有限公司在中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

本报告期内，由中科沃土基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

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 | 6,926,553.60 | 1,197,514.80 |
| 结算备付金 | | 2,165,587.88 | 226,843.28 |
| 存出保证金 | | 90,119.83 | 17,854.81 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 100,320,926.04 | 13,955,755.00 |
| 其中：股票投资 | | 100,320,926.04 | 13,955,755.00 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 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 | 6,000,000.00 | - |
| 应收证券清算款 | | 10,676,644.58 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 3,031.51 | 380.42 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 380,325.06 | 136,269.93 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 126,563,188.50 | 15,534,618.24 |
| 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 | | 9,698,893.75 | 146,974.62 |
| 应付赎回款 | | 415,146.33 | 72,821.91 |
| 应付管理人报酬 | | 95,085.83 | 18,109.93 |
| 应付托管费 | | 15,847.64 | 3,018.33 |
| 应付销售服务费 | | 29,222.72 | 1,222.93 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 454,903.99 | 93,438.29 |
| 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 | 14,994.19 | 30,001.20 |
| 负债合计 | | 10,724,094.45 | 365,587.21 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 69,245,497.29 | 12,331,524.85 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 46,593,596.76 | 2,837,506.18 |
| 所有者权益合计 | | 115,839,094.05 | 15,169,031.03 |
| 负债和所有者权益总计 | | 126,563,188.50 | 15,534,618.24 |

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额 69,245,497.29 份，其中中科沃土沃瑞混合发起 A 基金份额净值 1.6767 元，份额总额 26,189,365.55 份；中科沃土沃瑞混合发起 C 基金份额净值 1.6706 元，份额总额 43,056,131.74 份；

6.2 利润表

会计主体：中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

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 14 日(基金 合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 14,234,919.27 | 957,314.00 |
| 1.利息收入 | | 65,533.05 | 60,205.00 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 34,222.42 | 12,711.48 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 31,310.63 | 47,493.52 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 5,289,021.31 | 431,186.25 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 5,582,105.06 | 413,131.30 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | -449,580.00 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 156,496.25 | 18,054.95 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 8,691,157.47 | 465,673.92 |
| 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 | 189,207.44 | 248.83 |
| 减：二、费用 | | 1,693,347.10 | 474,211.88 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 263,689.43 | 78,879.57 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 43,948.20 | 13,146.60 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 57,815.12 | 5,051.90 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 1,311,680.07 | 362,225.17 |
| 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 | 16,214.28 | 14,908.64 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 12,541,572.17 | 483,102.12 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 12,541,572.17 | 483,102.12 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

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） | 12,331,524.85 | 2,837,506.18 | 15,169,031.03 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 12,541,572.17 | 12,541,572.17 |
| 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） | 56,913,972.44 | 31,214,518.41 | 88,128,490.85 |
| 其中：1.基金申购款 | 85,267,392.54 | 44,463,027.46 | 129,730,420.00 |
| 2. 基金赎回款 | -28,353,420.10 | -13,248,509.05 | -41,601,929.15 |
| 四、本期向基金份额持 | - | - | - |

科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式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审验,并由其出具《验证报告》(瑞华)验字第[2019]48090001号)。经向中国证监会备案,本基金基金合同于 2019 年 1 月 14 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

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:本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市交易的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、股指期货、国债期货、权证、债券(包括但不限于国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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 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。

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。

6.4.4.1 会计年度

会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

采用人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1. 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计

入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资(主要为权证投资和股指期货、国债期货)等,其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报,衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等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分类为贷款及应收款项。

2. 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 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,于交易日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;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债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。

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,公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益;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。

满足下列条件之一的金融资产,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;
- (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。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,才能终止确认该金融负债或其一部分。

1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(1) 股票投资

买入股票于交易日按股票的公允价值入账,相关交易费用直接计入当期损益。因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价,于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本;股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票,于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例,计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

(2) 债券投资

买入债券于交易日按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于债券部分的成本。

买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3) 权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认证权投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

(4) 股指期货

股指期货于相关合同签署日以公允价值进行初始计量，并以公允价值进行后续计量，公允价值变动计入当期损益。因股指期货交易每日无负债结算确认的相关金融资产和金融负债，与相关的股指期货暂收暂付款之间按抵销后的净额在资产负债表内列示。

2. 贷款及应收款项

买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始确认金额。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

3. 其他金融负债

卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始确认金额成本。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1. 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

2. 对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

3. 当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上或基金管理人估值委员会认为必要时，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

4. 对于交易所市场和银行间市场交易的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，采用第三方估值机构所提供的估值确定公允价值，另有规定的除外。

具体投资品种的估值方法如下：

(1) 股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

本基金对于长期停牌股票的期末估值参照中国证监会 2008 年 9 月 12 日发布的证监会公告[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》规定，若长期停牌股票的潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，经基金管理人估值委员会同意，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素(如指数收益法)，调整最近交易市价，确定公允价值。

由于上市公司送股、转增股、配股和公开增发新股等形成的流通暂时受限制的股票投资，按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

首次公开发行但未上市股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本计量。首次公开发行有明确锁定期的股票，于同一股票上市后按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

非公开发行有明确锁定期的股票，若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价低于非

公开发行股票的初始投资成本，以估值日证券交易所上市的同一种股票的市场交易收盘价为公允价值；若在证券交易所上市的同一种股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按中国证监会相关规定处理。

(2) 债券投资

银行间和交易所市场上市交易的债券(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，采用第三方估值机构(中央国债登记结算公司或中证指数有限公司)提供的估值净价确定公允价值。

交易所市场上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去收盘价中所含债券应收利息后的净价作为公允价值。

未上市或未挂牌转让的债券、以及在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券按成本估值。

(3) 权证投资

交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价为公允价值。

首次公开发行但尚未上市的权证在上市交易前，采用估值技术确定公允价值，如估值技术难以可靠计量，则以成本计量。

配售及认购分离交易可转换债券所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前，采用估值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量，则按成本计量。

因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值，基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后确定最能反映公允价值的价格。

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次的输入值确定公允价值计量层次。公允价值计量层次可分为：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是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。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1. 利息收入

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

(2) 除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

(3) 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

2. 投资收益

(1) 股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

(2) 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

(3) 衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

(4) 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

3. 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

1、本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按计划合同约定的费率和计算方法逐日确认。

2、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

3、卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 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，本基金同一类别的

每一基金份额享有同等分配权；

2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，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 10%，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、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质不

利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

6.4.4.12 分部报告

据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

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《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 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 2020年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款 | 6,926,553.60 |
| 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: | 6,926,553.60 |

6.4.7.2 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 | 90,836,600.53 | 100,320,926.04 | 9,484,325.51 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 90,836,600.53 | 100,320,926.04 | 9,484,325.51 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期内无投资衍生工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 | |
|-------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 6,000,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 6,000,000.00 | - |

6.4.7.5 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 | 2,496.61 |

| | |
|------------|----------|
| 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 | 494.40 |
| 应收债券利息 | - |
| 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 | 40.50 |
| 合计 | 3,031.51 |

6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 454,903.99 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 454,903.99 |

6.4.7.8 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 | 75.65 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 14,918.54 |
| 合计 | 14,994.19 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 中科沃土沃瑞混合发起 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 | 10,681,489.09 | 10,681,489.09 |
| 本期申购 | 22,910,965.88 | 22,910,965.88 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -7,403,089.42 | -7,403,089.42 |
| - 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 | 26,189,365.55 | 26,189,365.55 |

金额单位：人民币元

| 中科沃土沃瑞混合发起 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 | 1,650,035.76 | 1,650,035.76 |
| 本期申购 | 62,356,426.66 | 62,356,426.66 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -20,950,330.68 | -20,950,330.68 |
| - 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 | 43,056,131.74 | 43,056,131.74 |

注：本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 中科沃土沃瑞混合发起 A | | | |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 1,723,450.60 | 746,789.24 | 2,470,239.84 |
| 本期利润 | 3,296,513.97 | 3,443,668.56 | 6,740,182.53 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 7,080,876.68 | 1,429,936.48 | 8,510,813.16 |
| 其中：基金申购款 | 10,240,404.99 | 1,762,801.37 | 12,003,206.36 |
| 基金赎回款 | -3,159,528.31 | -332,864.89 | -3,492,393.20 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 12,100,841.25 | 5,620,394.28 | 17,721,235.53 |

单位：人民币元

| 中科沃土沃瑞混合发起 C | | | |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 252,381.41 | 114,884.93 | 367,266.34 |
| 本期利润 | 553,900.73 | 5,247,488.91 | 5,801,389.64 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 18,846,201.16 | 3,857,504.09 | 22,703,705.25 |
| 其中：基金申购款 | 27,968,172.12 | 4,491,648.98 | 32,459,821.10 |
| 基金赎回款 | -9,121,970.96 | -634,144.89 | -9,756,115.85 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 19,652,483.30 | 9,219,877.93 | 28,872,361.23 |

6.4.7.11 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 | 26,044.32 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 8,178.10 |
| 其他 | - |
| 合计 | 34,222.42 |

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 473,514,158.23 |
| 减：卖出股票成本总额 | 467,932,053.17 |
| 买卖股票差价收入 | 5,582,105.06 |

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

单位：人民币元

| 项目 | 本期收益金额 |
|-----------|---------------------------------|
| | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
| 国债期货投资收益 | - |
| 股指期货-投资收益 | -449,580.00 |

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|---------------------------------|
| | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 156,496.25 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 156,496.25 |

6.4.7.17 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 | 8,691,157.47 |
| ——股票投资 | 8,691,157.47 |
| ——债券投资 | - |
| ——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 | 8,691,157.47 |

6.4.7.18 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 | 188,484.54 |
| 转出基金补偿收入 | 722.90 |
| 合计 | 189,207.44 |

6.4.7.19 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 | 1,311,680.07 |
| 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 | 1,311,680.07 |

6.4.7.20 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 | 14,918.54 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费 | 1,295.74 |
| 其他 | - |
| 合计 | 16,214.28 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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 |
| 中科沃土基金管理有限公司 | 基金托管人、基金销售机构 |
| 珠海横琴西拓投资合伙企业（有限合伙） | 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

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期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 2020年1月1日至2020年6月30日 | 上年度可比期间 2019年1月14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 | 263,689.43 | 78,879.57 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 64,411.51 | 5,574.42 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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 |
|----------------|----------------------|--------------------------------|
| | 2020年1月1日至2020年6月30日 | 2019年1月14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 | 43,948.20 | 13,146.60 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计

算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.3 销售服务费

| 获得销售服务费的各关联方的名称 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|----------------------|--------------------------------|
| | 2020年1月1日至2020年6月30日 | 2019年1月14日(基金合同生效日)至2019年6月30日 |
| 中科沃土基金管理有限 | 29,222.72 | 4,663.51 |

| | | |
|----|--|--|
| 公司 | | |
|----|--|--|

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 0.80% 的年费率计提。C 类基金份额的销售

服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额 每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额基金资产净值

销售服务费每日计提，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核对一致后，由基金托管人自动于次月首日起三个工作日内从基金财产中一次性支付至登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。销售服务费主要用于本基金 C 类基金份额持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场（含回购）的交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| |
|--------------|
| 中科沃土沃瑞混合发起 A |
|--------------|

| 关联方名称 | 本期末 2020年6月30日 | | 上年度末 2019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 |
| 广东中科科创 创业投资管理 有限责任公司 | 1,000,410.96 | 1.4400% | 1,000,410.96 | 8.11% |
| 珠海横琴西拓 投资合伙企业 (有限合伙) | 8,003,602.74 | 11.5600% | 8,003,602.74 | 64.90% |

份额单位：份

| 中科沃土沃瑞混合发起 C | | | | |
|----------------------------|-------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
| 关联方名称 | 本期末 2020年6月30日 | | 上年度末 2019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 |
| 广东中科科创 创业投资管理 有限责任公司 | 1,000,410.96 | 1.4400% | 1,000,410.96 | 8.11% |
| 珠海横琴西拓 投资合伙企业 (有限合伙) | 8,003,602.74 | 11.5600% | 8,003,602.74 | 64.90% |

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方 名称 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 | | 上年度可比期间 2019年1月14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 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 交通银行股份有 限公司 | 6,926,553.60 | 26,044.32 | 1,197,514.80 | 12,728.79 |

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

6.4.10.7 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。

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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|-----------|--------|-------|--------|--------------|----------|----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 300845 | 捷安高科 | 2020年6月24日 | 2020年7月3日 | 新股未上市 | 17.63 | 17.63 | 470 | 8,286.10 | 8,286.10 | - |
| 300843 | 胜蓝股份 | 2020年6月23日 | 2020年7月2日 | 新股未上市 | 10.01 | 10.01 | 751 | 7,517.51 | 7,517.51 | - |
| 300846 | 首都在线 | 2020年6月22日 | 2020年7月1日 | 新股未上市 | 3.37 | 3.37 | 1,131 | 3,811.47 | 3,811.47 | - |

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，本基金未从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.12 金融工具风险及管理

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。

本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、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。

本基金本报告期末未持有债券。

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 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，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。

6.4.12.3.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2020 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 | 6,926,553.60 | - | - | - | 6,926,553.60 |
| 结算备付金 | 2,165,587.88 | - | - | - | 2,165,587.88 |
| 存出保证金 | 90,119.83 | - | - | - | 90,119.83 |
| 交易性金融 资产 | - | - | - | 100,320,926.04 | 100,320,926.04 |
| 买入返售金 融资产 | 6,000,000.00 | - | - | - | 6,000,000.00 |
| 应收证券清 算款 | - | - | - | 10,676,644.58 | 10,676,644.58 |
| 应收利息 | - | - | - | 3,031.51 | 3,031.51 |
| 应收申购款 | - | - | - | 380,325.06 | 380,325.06 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 15,182,261.31 | - | - | 111,380,927.19 | 126,563,188.50 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清 算款 | - | - | - | 9,698,893.75 | 9,698,893.75 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 415,146.33 | 415,146.33 |
| 应付管理人 报酬 | - | - | - | 95,085.83 | 95,085.83 |
| 应付托管费 | - | - | - | 15,847.64 | 15,847.64 |
| 应付销售服 务费 | - | - | - | 29,222.72 | 29,222.72 |
| 应付交易费 用 | - | - | - | 454,903.99 | 454,903.99 |
| 其他负债 | - | - | - | 14,994.19 | 14,994.19 |
| 负债总计 | - | - | - | 10,724,094.45 | 10,724,094.45 |
| 利率敏感度 缺口 | 15,182,261.31 | - | - | 100,656,832.74 | 115,839,094.05 |
| 上年度末 2019 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 | 1,197,514.80 | - | - | - | 1,197,514.80 |
| 结算备付金 | 226,843.28 | - | - | - | 226,843.28 |
| 存出保证金 | 17,854.81 | - | - | - | 17,854.81 |
| 交易性金融 资产 | - | - | - | 13,955,755.00 | 13,955,755.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 380.42 | 380.42 |

| | | | | | |
|---------|--------------|---|---|---------------|---------------|
| 应收申购款 | - | - | - | 136,269.93 | 136,269.93 |
| 资产总计 | 1,442,212.89 | - | - | 14,092,405.35 | 15,534,618.24 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 146,974.62 | 146,974.62 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 72,821.91 | 72,821.91 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 18,109.93 | 18,109.93 |
| 应付托管费 | - | - | - | 3,018.33 | 3,018.33 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,222.93 | 1,222.93 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 93,438.29 | 93,438.29 |
| 其他负债 | - | - | - | 30,001.20 | 30,001.20 |
| 负债总计 | - | - | - | 365,587.21 | 365,587.21 |
| 利率敏感度缺口 | 1,442,212.89 | - | - | 13,726,818.14 | 15,169,031.03 |

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.12.3.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.12.3.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的股票价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.12.3.3.1 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 | 100,320,926.04 | 86.60 | 13,955,755.00 | 92.00 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | - | - | - | - |

| | | | | |
|---------------|----------------|-------|---------------|-------|
| 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 | 100,320,926.04 | 86.60 | 13,955,755.00 | 92.00 |

6.4.12.3.3.2 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% | 4,329,407.21 | 832,366.56 |
| 业绩比较基准下降 5% | -4,329,407.21 | -832,366.56 | |

注：上年度末期间为 2019 年 1 月 14 日至 2019 年 12 月 31 日。

6.4.12.3.4 采用风险价值法管理风险

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

(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附注 6.4.4.5。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 100,301,310.96 元，属于第二层级 19,615.08 元，无属于第三层级的余额。（于 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 13,955,755.00 元，无属于第二或第三层级的余额。）

(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 | 权益投资 | 100,320,926.04 | 79.27 |
| | 其中：股票 | 100,320,926.04 | 79.27 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 6,000,000.00 | 4.74 |
| | 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 | 9,092,141.48 | 7.18 |
| 8 | 其他各项资产 | 11,150,120.98 | 8.81 |
| 9 | 合计 | 126,563,188.50 | 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

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 59,500.00 | 0.05 |
| C | 制造业 | 79,184,612.47 | 68.36 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,040.00 | 0.00 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 10,547,665.57 | 9.11 |
| J | 金融业 | 7,448,508.00 | 6.43 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 3,075,600.00 | 2.66 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 100,320,926.04 | 86.60 |

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：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 300686 | 智动力 | 233,300 | 5,613,198.00 | 4.85 |
| 2 | 300115 | 长盈精密 | 233,300 | 5,330,905.00 | 4.60 |
| 3 | 300253 | 卫宁健康 | 217,700 | 4,994,038.00 | 4.31 |
| 4 | 300451 | 创业慧康 | 237,700 | 4,395,073.00 | 3.79 |
| 5 | 600745 | 闻泰科技 | 33,300 | 4,194,135.00 | 3.62 |
| 6 | 300618 | 寒锐钴业 | 66,600 | 4,130,532.00 | 3.57 |
| 7 | 300003 | 乐普医疗 | 110,000 | 4,017,200.00 | 3.47 |
| 8 | 002675 | 东诚药业 | 177,700 | 3,722,815.00 | 3.21 |
| 9 | 300035 | 中科电气 | 400,000 | 3,672,000.00 | 3.17 |
| 10 | 002850 | 科达利 | 50,000 | 3,460,000.00 | 2.99 |
| 11 | 002709 | 天赐材料 | 101,700 | 3,436,443.00 | 2.97 |
| 12 | 300073 | 当升科技 | 100,000 | 3,307,000.00 | 2.85 |
| 13 | 603920 | 世运电路 | 133,300 | 3,304,507.00 | 2.85 |
| 14 | 300088 | 长信科技 | 277,700 | 3,110,240.00 | 2.68 |
| 15 | 002384 | 东山精密 | 103,700 | 3,105,815.00 | 2.68 |
| 16 | 002273 | 水晶光电 | 177,700 | 3,045,778.00 | 2.63 |
| 17 | 002600 | 领益智造 | 277,000 | 2,944,510.00 | 2.54 |
| 18 | 002138 | 顺络电子 | 117,700 | 2,936,615.00 | 2.54 |
| 19 | 688006 | 杭可科技 | 60,000 | 2,696,400.00 | 2.33 |
| 20 | 300476 | 胜宏科技 | 110,000 | 2,645,500.00 | 2.28 |
| 21 | 603799 | 华友钴业 | 63,000 | 2,448,180.00 | 2.11 |
| 22 | 601881 | 中国银河 | 200,000 | 2,294,000.00 | 1.98 |
| 23 | 300433 | 蓝思科技 | 74,000 | 2,074,960.00 | 1.79 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 24 | 300037 | 新宙邦 | 33,300 | 1,833,498.00 | 1.58 |
| 25 | 000725 | 京东方 A | 391,000 | 1,825,970.00 | 1.58 |
| 26 | 300815 | 玉禾田 | 14,700 | 1,802,808.00 | 1.56 |
| 27 | 603659 | 璞泰来 | 14,300 | 1,473,186.00 | 1.27 |
| 28 | 300059 | 东方财富 | 67,700 | 1,367,540.00 | 1.18 |
| 29 | 600109 | 国金证券 | 113,300 | 1,292,753.00 | 1.12 |
| 30 | 002973 | 侨银环保 | 54,300 | 1,272,792.00 | 1.10 |
| 31 | 000050 | 深天马 A | 77,700 | 1,193,472.00 | 1.03 |
| 32 | 002777 | 久远银海 | 37,700 | 1,146,457.00 | 0.99 |
| 33 | 600958 | 东方证券 | 100,000 | 949,000.00 | 0.82 |
| 34 | 002812 | 恩捷股份 | 13,000 | 855,400.00 | 0.74 |
| 35 | 603690 | 至纯科技 | 20,000 | 827,600.00 | 0.71 |
| 36 | 000166 | 申万宏源 | 134,300 | 678,215.00 | 0.59 |
| 37 | 300136 | 信维通信 | 12,500 | 662,750.00 | 0.57 |
| 38 | 002409 | 雅克科技 | 10,000 | 521,700.00 | 0.45 |
| 39 | 601788 | 光大证券 | 30,000 | 481,800.00 | 0.42 |
| 40 | 002859 | 洁美科技 | 16,000 | 479,680.00 | 0.41 |
| 41 | 600918 | 中泰证券 | 30,000 | 385,200.00 | 0.33 |
| 42 | 603160 | 汇顶科技 | 700 | 156,030.00 | 0.13 |
| 43 | 603686 | 龙马环卫 | 3,300 | 80,421.00 | 0.07 |
| 44 | 600988 | 赤峰黄金 | 5,000 | 59,500.00 | 0.05 |
| 45 | 300408 | 三环集团 | 1,700 | 47,090.00 | 0.04 |
| 46 | 000547 | 航天发展 | 1,000 | 13,670.00 | 0.01 |
| 47 | 300842 | 帝科股份 | 243 | 9,894.96 | 0.01 |
| 48 | 300845 | 捷安高科 | 470 | 8,286.10 | 0.01 |
| 49 | 300843 | 胜蓝股份 | 751 | 7,517.51 | 0.01 |
| 50 | 600956 | 新天绿能 | 1,000 | 5,040.00 | 0.00 |
| 51 | 300846 | 首都在线 | 1,131 | 3,811.47 | 0.00 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1 | 300451 | 创业慧康 | 9,805,784.26 | 64.64 |
| 2 | 300253 | 卫宁健康 | 9,762,296.92 | 64.36 |
| 3 | 300115 | 长盈精密 | 9,628,508.83 | 63.47 |
| 4 | 300686 | 智动力 | 9,058,299.00 | 59.72 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|-------|
| 5 | 002301 | 齐心集团 | 8,892,957.26 | 58.63 |
| 6 | 002675 | 东诚药业 | 8,847,778.21 | 58.33 |
| 7 | 000547 | 航天发展 | 7,732,379.74 | 50.97 |
| 8 | 300003 | 乐普医疗 | 7,552,196.43 | 49.79 |
| 9 | 300815 | 玉禾田 | 7,252,374.00 | 47.81 |
| 10 | 600745 | 闻泰科技 | 6,876,475.00 | 45.33 |
| 11 | 600030 | 中信证券 | 6,818,090.00 | 44.95 |
| 12 | 002384 | 东山精密 | 6,265,123.00 | 41.30 |
| 13 | 300618 | 寒锐钴业 | 6,061,617.00 | 39.96 |
| 14 | 300409 | 道氏技术 | 6,032,959.00 | 39.77 |
| 15 | 603686 | 龙马环卫 | 5,743,190.60 | 37.86 |
| 16 | 601933 | 永辉超市 | 5,710,148.00 | 37.64 |
| 17 | 300603 | 立昂技术 | 5,684,271.00 | 37.47 |
| 18 | 603043 | 广州酒家 | 5,682,070.24 | 37.46 |
| 19 | 300433 | 蓝思科技 | 5,452,443.28 | 35.94 |
| 20 | 002600 | 领益智造 | 5,216,652.00 | 34.39 |
| 21 | 002973 | 侨银环保 | 5,132,406.00 | 33.83 |
| 22 | 002273 | 水晶光电 | 5,017,889.00 | 33.08 |
| 23 | 603690 | 至纯科技 | 5,003,458.28 | 32.98 |
| 24 | 688015 | 交控科技 | 4,973,856.89 | 32.79 |
| 25 | 002409 | 雅克科技 | 4,868,210.00 | 32.09 |
| 26 | 603799 | 华友钴业 | 4,825,036.72 | 31.81 |
| 27 | 300037 | 新宙邦 | 4,808,786.00 | 31.70 |
| 28 | 688139 | 海尔生物 | 4,805,650.26 | 31.68 |
| 29 | 002777 | 久远银海 | 4,783,918.40 | 31.54 |
| 30 | 600802 | 福建水泥 | 4,765,441.43 | 31.42 |
| 31 | 300073 | 当升科技 | 4,473,846.00 | 29.49 |
| 32 | 600837 | 海通证券 | 4,448,990.12 | 29.33 |
| 33 | 300246 | 宝莱特 | 4,347,104.00 | 28.66 |
| 34 | 300373 | 扬杰科技 | 4,339,910.65 | 28.61 |
| 35 | 002524 | 光正集团 | 4,338,803.00 | 28.60 |
| 36 | 603456 | 九洲药业 | 4,194,943.00 | 27.65 |
| 37 | 603195 | 公牛集团 | 4,134,940.47 | 27.26 |
| 38 | 300602 | 飞荣达 | 4,038,628.78 | 26.62 |
| 39 | 002916 | 深南电路 | 3,985,287.00 | 26.27 |
| 40 | 601688 | 华泰证券 | 3,851,890.00 | 25.39 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|-------|
| 41 | 603019 | 中科曙光 | 3,698,352.20 | 24.38 |
| 42 | 600109 | 国金证券 | 3,645,325.00 | 24.03 |
| 43 | 002850 | 科达利 | 3,619,417.00 | 23.86 |
| 44 | 002063 | 远光软件 | 3,375,135.02 | 22.25 |
| 45 | 002335 | 科华恒盛 | 3,355,808.00 | 22.12 |
| 46 | 002497 | 雅化集团 | 3,303,523.00 | 21.78 |
| 47 | 002138 | 顺络电子 | 3,268,579.00 | 21.55 |
| 48 | 300035 | 中科电气 | 3,253,739.00 | 21.45 |
| 49 | 603920 | 世运电路 | 3,211,457.00 | 21.17 |
| 50 | 002223 | 鱼跃医疗 | 3,197,194.95 | 21.08 |
| 51 | 000401 | 冀东水泥 | 3,175,999.00 | 20.94 |
| 52 | 002036 | 联创电子 | 3,173,334.00 | 20.92 |
| 53 | 300119 | 瑞普生物 | 3,172,775.00 | 20.92 |
| 54 | 600489 | 中金黄金 | 3,123,738.00 | 20.59 |
| 55 | 300476 | 胜宏科技 | 3,053,019.00 | 20.13 |
| 56 | 002579 | 中京电子 | 3,025,016.31 | 19.94 |
| 57 | 600183 | 生益科技 | 3,013,061.00 | 19.86 |
| 58 | 300088 | 长信科技 | 2,986,808.00 | 19.69 |
| 59 | 002709 | 天赐材料 | 2,983,036.00 | 19.67 |
| 60 | 600958 | 东方证券 | 2,976,905.00 | 19.62 |
| 61 | 688006 | 杭可科技 | 2,968,657.34 | 19.57 |
| 62 | 002241 | 歌尔股份 | 2,959,624.54 | 19.51 |
| 63 | 300044 | 赛为智能 | 2,883,846.80 | 19.01 |
| 64 | 002939 | 长城证券 | 2,862,103.58 | 18.87 |
| 65 | 300496 | 中科创达 | 2,818,659.00 | 18.58 |
| 66 | 002959 | 小熊电器 | 2,794,502.94 | 18.42 |
| 67 | 603305 | 旭升股份 | 2,747,096.00 | 18.11 |
| 68 | 688358 | 祥生医疗 | 2,668,332.06 | 17.59 |
| 69 | 002626 | 金达威 | 2,568,998.00 | 16.94 |
| 70 | 002405 | 四维图新 | 2,419,848.50 | 15.95 |
| 71 | 688005 | 容百科技 | 2,352,307.38 | 15.51 |
| 72 | 300059 | 东方财富 | 2,321,100.00 | 15.30 |
| 73 | 002635 | 安洁科技 | 2,258,084.00 | 14.89 |
| 74 | 002123 | 梦网集团 | 2,255,339.00 | 14.87 |
| 75 | 688388 | 嘉元科技 | 2,253,555.75 | 14.86 |
| 76 | 601881 | 中国银河 | 2,219,060.00 | 14.63 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|-------|
| 77 | 002847 | 盐津铺子 | 2,146,390.00 | 14.15 |
| 78 | 002912 | 中新赛克 | 2,133,955.00 | 14.07 |
| 79 | 300457 | 赢合科技 | 2,116,372.00 | 13.95 |
| 80 | 002237 | 恒邦股份 | 2,047,361.60 | 13.50 |
| 81 | 002035 | 华帝股份 | 2,023,133.78 | 13.34 |
| 82 | 002508 | 老板电器 | 1,997,855.00 | 13.17 |
| 83 | 600114 | 东睦股份 | 1,992,960.00 | 13.14 |
| 84 | 002043 | 兔宝宝 | 1,986,109.00 | 13.09 |
| 85 | 002065 | 东华软件 | 1,973,642.00 | 13.01 |
| 86 | 002605 | 姚记科技 | 1,969,252.00 | 12.98 |
| 87 | 688399 | 硕世生物 | 1,941,022.73 | 12.80 |
| 88 | 002049 | 紫光国微 | 1,937,954.00 | 12.78 |
| 89 | 000810 | 创维数字 | 1,924,697.00 | 12.69 |
| 90 | 300438 | 鹏辉能源 | 1,904,510.00 | 12.56 |
| 91 | 002456 | 欧菲光 | 1,806,347.00 | 11.91 |
| 92 | 002511 | 中顺洁柔 | 1,796,391.00 | 11.84 |
| 93 | 000725 | 京东方A | 1,792,685.00 | 11.82 |
| 94 | 300607 | 拓斯达 | 1,786,148.00 | 11.77 |
| 95 | 002697 | 红旗连锁 | 1,775,657.00 | 11.71 |
| 96 | 600061 | 国投资本 | 1,705,203.70 | 11.24 |
| 97 | 000977 | 浪潮信息 | 1,702,651.52 | 11.22 |
| 98 | 300206 | 理邦仪器 | 1,696,686.00 | 11.19 |
| 99 | 600055 | 万东医疗 | 1,663,648.00 | 10.97 |
| 100 | 002251 | 步步高 | 1,655,037.00 | 10.91 |
| 101 | 300759 | 康龙化成 | 1,638,793.00 | 10.80 |
| 102 | 000333 | 美的集团 | 1,622,001.01 | 10.69 |
| 103 | 000975 | 银泰黄金 | 1,615,011.00 | 10.65 |
| 104 | 601116 | 三江购物 | 1,545,328.00 | 10.19 |
| 105 | 603187 | 海容冷链 | 1,527,703.00 | 10.07 |
| 106 | 600425 | 青松建化 | 1,474,591.00 | 9.72 |
| 107 | 000651 | 格力电器 | 1,473,720.00 | 9.72 |
| 108 | 601186 | 中国铁建 | 1,465,203.00 | 9.66 |
| 109 | 601198 | 东兴证券 | 1,444,111.00 | 9.52 |
| 110 | 000877 | 天山股份 | 1,442,215.66 | 9.51 |
| 111 | 002812 | 恩捷股份 | 1,429,262.61 | 9.42 |
| 112 | 002044 | 美年健康 | 1,424,793.00 | 9.39 |

| | | | | |
|-----|--------|-------|--------------|------|
| 113 | 603801 | 志邦家居 | 1,414,461.00 | 9.32 |
| 114 | 000050 | 深天马 A | 1,408,993.00 | 9.29 |
| 115 | 601878 | 浙商证券 | 1,402,922.05 | 9.25 |
| 116 | 002772 | 众兴菌业 | 1,401,112.00 | 9.24 |
| 117 | 600760 | 中航沈飞 | 1,394,178.00 | 9.19 |
| 118 | 300001 | 特锐德 | 1,393,316.00 | 9.19 |
| 119 | 300418 | 昆仑万维 | 1,387,813.00 | 9.15 |
| 120 | 600111 | 北方稀土 | 1,382,312.00 | 9.11 |
| 121 | 600862 | 中航高科 | 1,363,629.00 | 8.99 |
| 122 | 000002 | 万科 A | 1,353,543.00 | 8.92 |
| 123 | 603005 | 晶方科技 | 1,344,402.01 | 8.86 |
| 124 | 002028 | 思源电气 | 1,316,262.00 | 8.68 |
| 125 | 002475 | 立讯精密 | 1,315,335.00 | 8.67 |
| 126 | 300192 | 科斯伍德 | 1,309,549.00 | 8.63 |
| 127 | 603993 | 洛阳钼业 | 1,299,056.00 | 8.56 |
| 128 | 002460 | 赣锋锂业 | 1,296,457.00 | 8.55 |
| 129 | 603659 | 璞泰来 | 1,265,271.00 | 8.34 |
| 130 | 688369 | 致远互联 | 1,238,481.96 | 8.16 |
| 131 | 300562 | 乐心医疗 | 1,207,160.17 | 7.96 |
| 132 | 600406 | 国电南瑞 | 1,192,663.00 | 7.86 |
| 133 | 600872 | 中炬高新 | 1,188,241.00 | 7.83 |
| 134 | 300738 | 奥飞数据 | 1,178,776.00 | 7.77 |
| 135 | 600196 | 复星医药 | 1,151,965.00 | 7.59 |
| 136 | 300511 | 雪榕生物 | 1,149,971.00 | 7.58 |
| 137 | 002572 | 索菲亚 | 1,139,662.00 | 7.51 |
| 138 | 600988 | 赤峰黄金 | 1,126,088.00 | 7.42 |
| 139 | 002551 | 尚荣医疗 | 1,114,060.00 | 7.34 |
| 140 | 603833 | 欧派家居 | 1,112,060.00 | 7.33 |
| 141 | 600690 | 海尔智家 | 1,102,014.00 | 7.26 |
| 142 | 688039 | 当虹科技 | 1,088,012.97 | 7.17 |
| 143 | 603939 | 益丰药房 | 1,077,076.00 | 7.10 |
| 144 | 300550 | 和仁科技 | 1,059,369.00 | 6.98 |
| 145 | 300753 | 爱朋医疗 | 1,059,266.00 | 6.98 |
| 146 | 601788 | 光大证券 | 1,045,166.00 | 6.89 |
| 147 | 300260 | 新莱应材 | 1,037,092.88 | 6.84 |
| 148 | 601636 | 旗滨集团 | 1,034,228.00 | 6.82 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 149 | 002230 | 科大讯飞 | 1,020,473.00 | 6.73 |
| 150 | 002340 | 格林美 | 1,015,545.00 | 6.69 |
| 151 | 603506 | 南都物业 | 1,005,803.00 | 6.63 |
| 152 | 600528 | 中铁工业 | 1,002,472.00 | 6.61 |
| 153 | 603233 | 大参林 | 990,826.00 | 6.53 |
| 154 | 600259 | 广晟有色 | 989,184.00 | 6.52 |
| 155 | 300136 | 信维通信 | 973,733.00 | 6.42 |
| 156 | 002055 | 得润电子 | 937,102.00 | 6.18 |
| 157 | 000538 | 云南白药 | 917,000.00 | 6.05 |
| 158 | 600521 | 华海药业 | 912,320.00 | 6.01 |
| 159 | 600702 | 舍得酒业 | 906,804.00 | 5.98 |
| 160 | 000789 | 万年青 | 904,153.05 | 5.96 |
| 161 | 002918 | 蒙娜丽莎 | 897,004.00 | 5.91 |
| 162 | 600048 | 保利地产 | 896,550.00 | 5.91 |
| 163 | 000603 | 盛达资源 | 891,251.00 | 5.88 |
| 164 | 002233 | 塔牌集团 | 889,883.00 | 5.87 |
| 165 | 688051 | 佳华科技 | 887,328.26 | 5.85 |
| 166 | 600131 | 国网信通 | 885,511.00 | 5.84 |
| 167 | 688116 | 天奈科技 | 884,012.20 | 5.83 |
| 168 | 002034 | 旺能环境 | 869,342.12 | 5.73 |
| 169 | 688023 | 安恒信息 | 860,431.40 | 5.67 |
| 170 | 300559 | 佳发教育 | 839,001.00 | 5.53 |
| 171 | 600383 | 金地集团 | 833,935.00 | 5.50 |
| 172 | 300578 | 会畅通讯 | 820,609.00 | 5.41 |
| 173 | 603279 | 景津环保 | 812,441.00 | 5.36 |
| 174 | 000756 | 新华制药 | 796,933.00 | 5.25 |
| 175 | 601689 | 拓普集团 | 795,085.00 | 5.24 |
| 176 | 603986 | 兆易创新 | 794,128.00 | 5.24 |
| 177 | 300327 | 中颖电子 | 779,822.00 | 5.14 |
| 178 | 603180 | 金牌厨柜 | 760,639.00 | 5.01 |
| 179 | 600588 | 用友网络 | 757,808.00 | 5.00 |
| 180 | 002398 | 垒知集团 | 744,642.00 | 4.91 |
| 181 | 601231 | 环旭电子 | 741,580.00 | 4.89 |
| 182 | 688086 | 紫晶存储 | 741,287.74 | 4.89 |
| 183 | 002810 | 山东赫达 | 741,112.64 | 4.89 |
| 184 | 002264 | 新华都 | 740,341.00 | 4.88 |

| | | | | |
|-----|--------|--------|------------|------|
| 185 | 002859 | 洁美科技 | 737,388.40 | 4.86 |
| 186 | 002727 | 一心堂 | 736,155.00 | 4.85 |
| 187 | 600867 | 通化东宝 | 725,473.00 | 4.78 |
| 188 | 002332 | 仙琚制药 | 700,769.00 | 4.62 |
| 189 | 002128 | 露天煤业 | 699,323.00 | 4.61 |
| 190 | 002351 | 漫步者 | 697,105.00 | 4.60 |
| 191 | 300251 | 光线传媒 | 693,242.00 | 4.57 |
| 192 | 000063 | 中兴通讯 | 691,922.00 | 4.56 |
| 193 | 688030 | 山石网科 | 689,050.25 | 4.54 |
| 194 | 600060 | 海信视像 | 680,354.00 | 4.49 |
| 195 | 000001 | 平安银行 | 667,862.00 | 4.40 |
| 196 | 688016 | 心脉医疗 | 667,523.00 | 4.40 |
| 197 | 600699 | 均胜电子 | 667,140.00 | 4.40 |
| 198 | 000166 | 申万宏源 | 665,188.00 | 4.39 |
| 199 | 300127 | 银河磁体 | 661,141.00 | 4.36 |
| 200 | 600188 | 兖州煤业 | 652,128.00 | 4.30 |
| 201 | 600547 | 山东黄金 | 633,201.00 | 4.17 |
| 202 | 000400 | 许继电气 | 628,553.00 | 4.14 |
| 203 | 603883 | 老百姓 | 618,591.00 | 4.08 |
| 204 | 300408 | 三环集团 | 618,412.00 | 4.08 |
| 205 | 601088 | 中国神华 | 617,746.00 | 4.07 |
| 206 | 000915 | 山大华特 | 613,514.00 | 4.04 |
| 207 | 688168 | 安博通 | 613,123.60 | 4.04 |
| 208 | 002258 | 利尔化学 | 610,901.00 | 4.03 |
| 209 | 002677 | 浙江美大 | 606,703.00 | 4.00 |
| 210 | 300122 | 智飞生物 | 605,576.38 | 3.99 |
| 211 | 002371 | 北方华创 | 602,642.00 | 3.97 |
| 212 | 300306 | 远方信息 | 598,879.00 | 3.95 |
| 213 | 601390 | 中国中铁 | 588,687.00 | 3.88 |
| 214 | 688363 | 华熙生物 | 586,498.36 | 3.87 |
| 215 | 002739 | 万达电影 | 585,705.00 | 3.86 |
| 216 | 300182 | 捷成股份 | 568,800.00 | 3.75 |
| 217 | 002110 | 三钢闽光 | 563,770.00 | 3.72 |
| 218 | 601877 | 正泰电器 | 562,120.00 | 3.71 |
| 219 | 601336 | 新华保险 | 561,998.00 | 3.70 |
| 220 | 000100 | TCL 科技 | 535,537.00 | 3.53 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 221 | 000783 | 长江证券 | 529,701.00 | 3.49 |
| 222 | 000717 | 韶钢松山 | 524,979.00 | 3.46 |
| 223 | 600346 | 恒力石化 | 521,395.00 | 3.44 |
| 224 | 601808 | 中海油服 | 518,033.00 | 3.42 |
| 225 | 300661 | 圣邦股份 | 516,384.16 | 3.40 |
| 226 | 002570 | 贝因美 | 509,740.00 | 3.36 |
| 227 | 601800 | 中国交建 | 501,697.00 | 3.31 |
| 228 | 603068 | 博通集成 | 499,941.00 | 3.30 |
| 229 | 600584 | 长电科技 | 497,033.00 | 3.28 |
| 230 | 603890 | 春秋电子 | 492,337.00 | 3.25 |
| 231 | 601377 | 兴业证券 | 490,898.00 | 3.24 |
| 232 | 600549 | 厦门钨业 | 488,000.40 | 3.22 |
| 233 | 600831 | 广电网络 | 487,866.00 | 3.22 |
| 234 | 603387 | 基蛋生物 | 483,209.56 | 3.19 |
| 235 | 300396 | 迪瑞医疗 | 480,376.00 | 3.17 |
| 236 | 300770 | 新媒股份 | 478,834.00 | 3.16 |
| 237 | 002353 | 杰瑞股份 | 477,460.32 | 3.15 |
| 238 | 000768 | 中航飞机 | 474,752.00 | 3.13 |
| 239 | 000831 | 五矿稀土 | 469,217.49 | 3.09 |
| 240 | 688111 | 金山办公 | 462,895.68 | 3.05 |
| 241 | 002867 | 周大生 | 459,201.00 | 3.03 |
| 242 | 601601 | 中国太保 | 458,122.00 | 3.02 |
| 243 | 600566 | 济川药业 | 455,830.00 | 3.01 |
| 244 | 600887 | 伊利股份 | 443,777.00 | 2.93 |
| 245 | 300388 | 国祯环保 | 441,667.00 | 2.91 |
| 246 | 603825 | 华扬联众 | 440,072.00 | 2.90 |
| 247 | 601318 | 中国平安 | 438,614.00 | 2.89 |
| 248 | 688300 | 联瑞新材 | 435,474.53 | 2.87 |
| 249 | 601658 | 邮储银行 | 431,235.00 | 2.84 |
| 250 | 300474 | 景嘉微 | 430,987.00 | 2.84 |
| 251 | 300166 | 东方国信 | 421,959.00 | 2.78 |
| 252 | 603336 | 宏辉果蔬 | 414,976.00 | 2.74 |
| 253 | 002236 | 大华股份 | 414,400.22 | 2.73 |
| 254 | 300497 | 富祥药业 | 412,389.00 | 2.72 |
| 255 | 601699 | 潞安环能 | 396,077.00 | 2.61 |
| 256 | 002240 | 威华股份 | 394,247.00 | 2.60 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 257 | 600999 | 招商证券 | 389,605.00 | 2.57 |
| 258 | 600918 | 中泰证券 | 388,859.00 | 2.56 |
| 259 | 300793 | 佳禾智能 | 386,173.00 | 2.55 |
| 260 | 688118 | 普元信息 | 383,729.78 | 2.53 |
| 261 | 300175 | 朗源股份 | 380,051.00 | 2.51 |
| 262 | 300273 | 和佳医疗 | 379,560.00 | 2.50 |
| 263 | 300737 | 科顺股份 | 369,687.00 | 2.44 |
| 264 | 601319 | 中国人保 | 367,335.00 | 2.42 |
| 265 | 601003 | 柳钢股份 | 365,831.00 | 2.41 |
| 266 | 300525 | 博思软件 | 362,616.00 | 2.39 |
| 267 | 603103 | 横店影视 | 362,331.00 | 2.39 |
| 268 | 300463 | 迈克生物 | 356,281.00 | 2.35 |
| 269 | 603260 | 合盛硅业 | 352,506.00 | 2.32 |
| 270 | 688396 | 华润微 | 351,046.00 | 2.31 |
| 271 | 688008 | 澜起科技 | 342,149.00 | 2.26 |
| 272 | 000099 | 中信海直 | 340,719.00 | 2.25 |
| 273 | 002796 | 世嘉科技 | 338,998.00 | 2.23 |
| 274 | 601666 | 平煤股份 | 338,659.00 | 2.23 |
| 275 | 600996 | 贵广网络 | 336,565.00 | 2.22 |
| 276 | 002839 | 张家港行 | 329,869.00 | 2.17 |
| 277 | 002291 | 星期六 | 328,903.00 | 2.17 |
| 278 | 300450 | 先导智能 | 326,133.00 | 2.15 |
| 279 | 688012 | 中微公司 | 324,376.67 | 2.14 |
| 280 | 000932 | 华菱钢铁 | 324,124.00 | 2.14 |
| 281 | 002861 | 瀛通通讯 | 321,089.00 | 2.12 |
| 282 | 600392 | 盛和资源 | 315,403.00 | 2.08 |
| 283 | 002262 | 恩华药业 | 314,376.00 | 2.07 |

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|----------|----------------|
|----|------|------|----------|----------------|

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|-------|
| 1 | 002301 | 齐心集团 | 8,823,713.87 | 58.17 |
| 2 | 000547 | 航天发展 | 7,714,335.04 | 50.86 |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 7,369,385.00 | 48.58 |
| 4 | 300451 | 创业慧康 | 6,310,915.81 | 41.60 |
| 5 | 300253 | 卫宁健康 | 6,224,697.37 | 41.04 |
| 6 | 688015 | 交控科技 | 6,069,365.01 | 40.01 |
| 7 | 603686 | 龙马环卫 | 5,997,849.80 | 39.54 |
| 8 | 300409 | 道氏技术 | 5,974,187.69 | 39.38 |
| 9 | 300815 | 玉禾田 | 5,949,814.84 | 39.22 |
| 10 | 688139 | 海尔生物 | 5,811,091.13 | 38.31 |
| 11 | 601933 | 永辉超市 | 5,752,406.00 | 37.92 |
| 12 | 603043 | 广州酒家 | 5,675,650.71 | 37.42 |
| 13 | 002675 | 东诚药业 | 5,396,304.10 | 35.57 |
| 14 | 300603 | 立昂技术 | 5,362,971.00 | 35.35 |
| 15 | 300246 | 宝莱特 | 4,998,028.00 | 32.95 |
| 16 | 600837 | 海通证券 | 4,909,074.00 | 32.36 |
| 17 | 600802 | 福建水泥 | 4,862,060.00 | 32.05 |
| 18 | 300115 | 长盈精密 | 4,762,855.00 | 31.40 |
| 19 | 002409 | 雅克科技 | 4,532,356.00 | 29.88 |
| 20 | 603690 | 至纯科技 | 4,391,437.80 | 28.95 |
| 21 | 300373 | 扬杰科技 | 4,325,603.29 | 28.52 |
| 22 | 603456 | 九洲药业 | 4,279,803.17 | 28.21 |
| 23 | 002524 | 光正集团 | 4,146,972.00 | 27.34 |
| 24 | 002916 | 深南电路 | 4,103,913.10 | 27.05 |
| 25 | 300602 | 飞荣达 | 4,102,185.77 | 27.04 |
| 26 | 300433 | 蓝思科技 | 4,095,806.00 | 27.00 |
| 27 | 603195 | 公牛集团 | 3,918,251.00 | 25.83 |
| 28 | 002973 | 侨银环保 | 3,916,689.56 | 25.82 |
| 29 | 601688 | 华泰证券 | 3,829,407.00 | 25.24 |
| 30 | 300686 | 智动力 | 3,766,266.96 | 24.83 |
| 31 | 603019 | 中科曙光 | 3,716,983.40 | 24.50 |
| 32 | 300003 | 乐普医疗 | 3,691,458.19 | 24.34 |
| 33 | 300037 | 新宙邦 | 3,550,864.04 | 23.41 |
| 34 | 002777 | 久远银海 | 3,538,386.28 | 23.33 |
| 35 | 002497 | 雅化集团 | 3,473,308.00 | 22.90 |
| 36 | 002063 | 远光软件 | 3,440,933.00 | 22.68 |
| 37 | 002384 | 东山精密 | 3,423,016.00 | 22.57 |
| 38 | 688358 | 祥生医疗 | 3,419,627.55 | 22.54 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|-------|
| 39 | 600745 | 闻泰科技 | 3,387,844.50 | 22.33 |
| 40 | 002335 | 科华恒盛 | 3,355,117.00 | 22.12 |
| 41 | 002036 | 联创电子 | 3,245,288.33 | 21.39 |
| 42 | 002223 | 鱼跃医疗 | 3,223,544.86 | 21.25 |
| 43 | 000401 | 冀东水泥 | 3,214,685.94 | 21.19 |
| 44 | 300119 | 瑞普生物 | 3,141,608.00 | 20.71 |
| 45 | 600489 | 中金黄金 | 3,132,762.00 | 20.65 |
| 46 | 002241 | 歌尔股份 | 3,124,944.33 | 20.60 |
| 47 | 002579 | 中京电子 | 3,071,205.50 | 20.25 |
| 48 | 002959 | 小熊电器 | 3,044,921.00 | 20.07 |
| 49 | 600183 | 生益科技 | 3,023,544.45 | 19.93 |
| 50 | 688399 | 硕世生物 | 2,993,415.31 | 19.73 |
| 51 | 300496 | 中科创达 | 2,865,443.00 | 18.89 |
| 52 | 300044 | 赛为智能 | 2,799,005.20 | 18.45 |
| 53 | 002939 | 长城证券 | 2,732,189.03 | 18.01 |
| 54 | 603799 | 华友钴业 | 2,665,405.62 | 17.57 |
| 55 | 603305 | 旭升股份 | 2,616,232.41 | 17.25 |
| 56 | 300618 | 寒锐钴业 | 2,468,143.51 | 16.27 |
| 57 | 002626 | 金达威 | 2,431,803.00 | 16.03 |
| 58 | 002847 | 盐津铺子 | 2,403,074.00 | 15.84 |
| 59 | 002405 | 四维图新 | 2,331,404.00 | 15.37 |
| 60 | 002600 | 领益智造 | 2,325,231.00 | 15.33 |
| 61 | 002035 | 华帝股份 | 2,307,561.00 | 15.21 |
| 62 | 688005 | 容百科技 | 2,303,127.88 | 15.18 |
| 63 | 300457 | 赢合科技 | 2,277,947.50 | 15.02 |
| 64 | 600109 | 国金证券 | 2,253,934.00 | 14.86 |
| 65 | 688388 | 嘉元科技 | 2,235,719.69 | 14.74 |
| 66 | 002912 | 中新赛克 | 2,221,614.80 | 14.65 |
| 67 | 002273 | 水晶光电 | 2,146,842.00 | 14.15 |
| 68 | 002123 | 梦网集团 | 2,135,805.00 | 14.08 |
| 69 | 002508 | 老板电器 | 2,130,583.00 | 14.05 |
| 70 | 002635 | 安洁科技 | 2,103,800.00 | 13.87 |
| 71 | 002237 | 恒邦股份 | 2,054,397.00 | 13.54 |
| 72 | 002049 | 紫光国微 | 2,031,718.37 | 13.39 |
| 73 | 600114 | 东睦股份 | 2,020,803.00 | 13.32 |
| 74 | 002043 | 兔宝宝 | 1,978,894.00 | 13.05 |
| 75 | 600958 | 东方证券 | 1,937,429.00 | 12.77 |
| 76 | 002065 | 东华软件 | 1,925,495.00 | 12.69 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|-------|
| 77 | 000810 | 创维数字 | 1,908,351.20 | 12.58 |
| 78 | 002605 | 姚记科技 | 1,906,426.00 | 12.57 |
| 79 | 300438 | 鹏辉能源 | 1,867,765.00 | 12.31 |
| 80 | 300607 | 拓斯达 | 1,848,119.00 | 12.18 |
| 81 | 002511 | 中顺洁柔 | 1,808,688.38 | 11.92 |
| 82 | 002697 | 红旗连锁 | 1,793,235.00 | 11.82 |
| 83 | 002456 | 欧菲光 | 1,783,096.00 | 11.75 |
| 84 | 300073 | 当升科技 | 1,769,704.00 | 11.67 |
| 85 | 300206 | 理邦仪器 | 1,757,982.00 | 11.59 |
| 86 | 000975 | 银泰黄金 | 1,754,256.16 | 11.56 |
| 87 | 000002 | 万科A | 1,748,959.00 | 11.53 |
| 88 | 603801 | 志邦家居 | 1,743,086.60 | 11.49 |
| 89 | 300759 | 康龙化成 | 1,735,699.00 | 11.44 |
| 90 | 000977 | 浪潮信息 | 1,685,709.00 | 11.11 |
| 91 | 600055 | 万东医疗 | 1,661,102.00 | 10.95 |
| 92 | 688039 | 当虹科技 | 1,658,289.80 | 10.93 |
| 93 | 002251 | 步步高 | 1,658,119.00 | 10.93 |
| 94 | 600061 | 国投资本 | 1,641,205.37 | 10.82 |
| 95 | 002572 | 索菲亚 | 1,632,395.00 | 10.76 |
| 96 | 000333 | 美的集团 | 1,616,310.00 | 10.66 |
| 97 | 603187 | 海容冷链 | 1,534,271.00 | 10.11 |
| 98 | 300418 | 昆仑万维 | 1,525,770.00 | 10.06 |
| 99 | 601116 | 三江购物 | 1,519,992.00 | 10.02 |
| 100 | 688016 | 心脉医疗 | 1,505,622.41 | 9.93 |
| 101 | 000651 | 格力电器 | 1,479,600.00 | 9.75 |
| 102 | 600425 | 青松建化 | 1,478,863.00 | 9.75 |
| 103 | 600383 | 金地集团 | 1,446,460.00 | 9.54 |
| 104 | 601186 | 中国铁建 | 1,444,210.00 | 9.52 |
| 105 | 601198 | 东兴证券 | 1,428,700.00 | 9.42 |
| 106 | 300562 | 乐心医疗 | 1,425,731.41 | 9.40 |
| 107 | 000877 | 天山股份 | 1,420,539.00 | 9.36 |
| 108 | 300001 | 特锐德 | 1,418,914.94 | 9.35 |
| 109 | 002475 | 立讯精密 | 1,408,671.17 | 9.29 |
| 110 | 002772 | 众兴菌业 | 1,385,931.00 | 9.14 |
| 111 | 002044 | 美年健康 | 1,384,187.00 | 9.13 |
| 112 | 600760 | 中航沈飞 | 1,373,420.00 | 9.05 |
| 113 | 600111 | 北方稀土 | 1,370,611.99 | 9.04 |
| 114 | 601878 | 浙商证券 | 1,351,280.00 | 8.91 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 115 | 603833 | 欧派家居 | 1,350,081.00 | 8.90 |
| 116 | 600862 | 中航高科 | 1,349,666.00 | 8.90 |
| 117 | 603005 | 晶方科技 | 1,325,835.00 | 8.74 |
| 118 | 300738 | 奥飞数据 | 1,312,388.50 | 8.65 |
| 119 | 002028 | 思源电气 | 1,311,776.00 | 8.65 |
| 120 | 300511 | 雪榕生物 | 1,311,268.00 | 8.64 |
| 121 | 603993 | 洛阳钼业 | 1,293,959.00 | 8.53 |
| 122 | 601231 | 环旭电子 | 1,278,073.00 | 8.43 |
| 123 | 300192 | 科斯伍德 | 1,277,731.85 | 8.42 |
| 124 | 002460 | 赣锋锂业 | 1,264,301.00 | 8.33 |
| 125 | 603180 | 金牌厨柜 | 1,241,959.00 | 8.19 |
| 126 | 688369 | 致远互联 | 1,215,796.28 | 8.01 |
| 127 | 002551 | 尚荣医疗 | 1,192,135.00 | 7.86 |
| 128 | 600406 | 国电南瑞 | 1,175,521.00 | 7.75 |
| 129 | 600872 | 中炬高新 | 1,169,736.00 | 7.71 |
| 130 | 600196 | 复星医药 | 1,124,344.00 | 7.41 |
| 131 | 300059 | 东方财富 | 1,105,375.00 | 7.29 |
| 132 | 600690 | 海尔智家 | 1,093,680.00 | 7.21 |
| 133 | 603939 | 益丰药房 | 1,081,102.00 | 7.13 |
| 134 | 300550 | 和仁科技 | 1,069,350.00 | 7.05 |
| 135 | 300753 | 爱朋医疗 | 1,068,973.00 | 7.05 |
| 136 | 688018 | 乐鑫科技 | 1,058,639.33 | 6.98 |
| 137 | 300578 | 会畅通讯 | 1,045,270.20 | 6.89 |
| 138 | 601636 | 旗滨集团 | 1,042,498.00 | 6.87 |
| 139 | 601788 | 光大证券 | 1,024,566.00 | 6.75 |
| 140 | 603506 | 南都物业 | 1,019,542.00 | 6.72 |
| 141 | 002340 | 格林美 | 1,008,957.00 | 6.65 |
| 142 | 600988 | 赤峰黄金 | 1,004,855.00 | 6.62 |
| 143 | 002230 | 科大讯飞 | 999,010.00 | 6.59 |
| 144 | 603233 | 大参林 | 989,946.00 | 6.53 |
| 145 | 600528 | 中铁工业 | 988,988.00 | 6.52 |
| 146 | 600259 | 广晟有色 | 987,068.00 | 6.51 |
| 147 | 688363 | 华熙生物 | 968,233.55 | 6.38 |
| 148 | 300260 | 新莱应材 | 966,347.00 | 6.37 |
| 149 | 002055 | 得润电子 | 931,870.00 | 6.14 |
| 150 | 600521 | 华海药业 | 920,000.00 | 6.06 |
| 151 | 600131 | 国网信通 | 918,308.00 | 6.05 |
| 152 | 002233 | 塔牌集团 | 917,138.66 | 6.05 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 153 | 000603 | 盛达资源 | 911,663.00 | 6.01 |
| 154 | 688051 | 佳华科技 | 910,640.52 | 6.00 |
| 155 | 002034 | 旺能环境 | 905,227.00 | 5.97 |
| 156 | 000538 | 云南白药 | 905,105.94 | 5.97 |
| 157 | 000789 | 万年青 | 894,050.00 | 5.89 |
| 158 | 688023 | 安恒信息 | 892,079.00 | 5.88 |
| 159 | 600048 | 保利地产 | 891,724.00 | 5.88 |
| 160 | 002810 | 山东赫达 | 875,230.30 | 5.77 |
| 161 | 002918 | 蒙娜丽莎 | 875,186.00 | 5.77 |
| 162 | 688116 | 天奈科技 | 870,540.61 | 5.74 |
| 163 | 600702 | 舍得酒业 | 863,286.00 | 5.69 |
| 164 | 300559 | 佳发教育 | 860,006.00 | 5.67 |
| 165 | 300793 | 佳禾智能 | 834,907.00 | 5.50 |
| 166 | 002398 | 垒知集团 | 834,235.00 | 5.50 |
| 167 | 603279 | 景津环保 | 812,959.00 | 5.36 |
| 168 | 688118 | 普元信息 | 811,931.09 | 5.35 |
| 169 | 300327 | 中颖电子 | 790,909.00 | 5.21 |
| 170 | 000756 | 新华制药 | 781,633.00 | 5.15 |
| 171 | 002850 | 科达利 | 781,007.00 | 5.15 |
| 172 | 688058 | 宝兰德 | 774,316.44 | 5.10 |
| 173 | 603986 | 兆易创新 | 773,554.00 | 5.10 |
| 174 | 601689 | 拓普集团 | 768,212.00 | 5.06 |
| 175 | 600588 | 用友网络 | 766,169.00 | 5.05 |
| 176 | 688008 | 澜起科技 | 762,668.18 | 5.03 |
| 177 | 688030 | 山石网科 | 757,862.32 | 5.00 |
| 178 | 688003 | 天准科技 | 752,570.36 | 4.96 |
| 179 | 002264 | 新华都 | 748,949.00 | 4.94 |
| 180 | 002727 | 一心堂 | 746,206.00 | 4.92 |
| 181 | 688086 | 紫晶存储 | 733,060.00 | 4.83 |
| 182 | 600060 | 海信视像 | 731,582.85 | 4.82 |
| 183 | 600867 | 通化东宝 | 730,539.00 | 4.82 |
| 184 | 002128 | 露天煤业 | 700,844.00 | 4.62 |
| 185 | 002812 | 恩捷股份 | 700,559.00 | 4.62 |
| 186 | 300251 | 光线传媒 | 699,816.00 | 4.61 |
| 187 | 002332 | 仙琚制药 | 696,570.00 | 4.59 |
| 188 | 002351 | 漫步者 | 689,170.00 | 4.54 |
| 189 | 000063 | 中兴通讯 | 676,430.00 | 4.46 |
| 190 | 300127 | 银河磁体 | 660,878.00 | 4.36 |

| | | | | |
|-----|--------|--------|------------|------|
| 191 | 000001 | 平安银行 | 658,138.00 | 4.34 |
| 192 | 600547 | 山东黄金 | 655,152.00 | 4.32 |
| 193 | 600188 | 兖州煤业 | 651,289.00 | 4.29 |
| 194 | 600699 | 均胜电子 | 644,457.00 | 4.25 |
| 195 | 688168 | 安博通 | 638,593.68 | 4.21 |
| 196 | 603883 | 老百姓 | 624,819.16 | 4.12 |
| 197 | 002258 | 利尔化学 | 622,442.03 | 4.10 |
| 198 | 002371 | 北方华创 | 621,065.00 | 4.09 |
| 199 | 601088 | 中国神华 | 620,217.00 | 4.09 |
| 200 | 688012 | 中微公司 | 619,846.99 | 4.09 |
| 201 | 000400 | 许继电气 | 617,872.00 | 4.07 |
| 202 | 300306 | 远方信息 | 616,307.00 | 4.06 |
| 203 | 300122 | 智飞生物 | 614,212.00 | 4.05 |
| 204 | 000915 | 山大华特 | 596,195.00 | 3.93 |
| 205 | 601390 | 中国中铁 | 587,596.00 | 3.87 |
| 206 | 000100 | TCL 科技 | 579,198.00 | 3.82 |
| 207 | 002739 | 万达电影 | 578,784.00 | 3.82 |
| 208 | 300476 | 胜宏科技 | 576,470.00 | 3.80 |
| 209 | 601336 | 新华保险 | 566,740.00 | 3.74 |
| 210 | 300182 | 捷成股份 | 564,140.00 | 3.72 |
| 211 | 002677 | 浙江美大 | 564,080.00 | 3.72 |
| 212 | 601877 | 正泰电器 | 558,299.00 | 3.68 |
| 213 | 002110 | 三钢闽光 | 557,329.00 | 3.67 |
| 214 | 300408 | 三环集团 | 555,700.00 | 3.66 |
| 215 | 300661 | 圣邦股份 | 534,287.00 | 3.52 |
| 216 | 000783 | 长江证券 | 528,158.00 | 3.48 |
| 217 | 000717 | 韶钢松山 | 521,543.00 | 3.44 |
| 218 | 600584 | 长电科技 | 516,618.00 | 3.41 |
| 219 | 600346 | 恒力石化 | 514,442.00 | 3.39 |
| 220 | 603387 | 基蛋生物 | 512,157.70 | 3.38 |
| 221 | 002570 | 贝因美 | 510,140.00 | 3.36 |
| 222 | 603068 | 博通集成 | 507,574.00 | 3.35 |
| 223 | 601808 | 中海油服 | 497,718.00 | 3.28 |
| 224 | 601800 | 中国交建 | 494,470.00 | 3.26 |
| 225 | 688111 | 金山办公 | 490,189.78 | 3.23 |
| 226 | 600549 | 厦门钨业 | 485,182.00 | 3.20 |
| 227 | 601377 | 兴业证券 | 484,940.00 | 3.20 |
| 228 | 002353 | 杰瑞股份 | 484,431.00 | 3.19 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 229 | 000768 | 中航飞机 | 477,624.00 | 3.15 |
| 230 | 603890 | 春秋电子 | 473,589.00 | 3.12 |
| 231 | 300396 | 迪瑞医疗 | 471,481.00 | 3.11 |
| 232 | 002867 | 周大生 | 468,181.00 | 3.09 |
| 233 | 601601 | 中国太保 | 462,241.00 | 3.05 |
| 234 | 300136 | 信维通信 | 461,985.00 | 3.05 |
| 235 | 300770 | 新媒股份 | 459,150.00 | 3.03 |
| 236 | 000831 | 五矿稀土 | 457,866.00 | 3.02 |
| 237 | 300388 | 国祯环保 | 453,551.00 | 2.99 |
| 238 | 300737 | 科顺股份 | 450,706.00 | 2.97 |
| 239 | 600566 | 济川药业 | 447,115.00 | 2.95 |
| 240 | 603825 | 华扬联众 | 445,623.00 | 2.94 |
| 241 | 600887 | 伊利股份 | 438,150.00 | 2.89 |
| 242 | 601318 | 中国平安 | 437,303.00 | 2.88 |
| 243 | 601658 | 邮储银行 | 430,458.00 | 2.84 |
| 244 | 300474 | 景嘉微 | 428,974.00 | 2.83 |
| 245 | 002240 | 威华股份 | 423,948.00 | 2.79 |
| 246 | 688300 | 联瑞新材 | 423,032.00 | 2.79 |
| 247 | 600831 | 广电网络 | 412,706.00 | 2.72 |
| 248 | 002236 | 大华股份 | 410,210.00 | 2.70 |
| 249 | 300273 | 和佳医疗 | 405,176.00 | 2.67 |
| 250 | 300497 | 富祥药业 | 402,873.00 | 2.66 |
| 251 | 603336 | 宏辉果蔬 | 397,731.00 | 2.62 |
| 252 | 300166 | 东方国信 | 395,483.98 | 2.61 |
| 253 | 002138 | 顺络电子 | 394,060.00 | 2.60 |
| 254 | 601699 | 潞安环能 | 393,400.00 | 2.59 |
| 255 | 688001 | 华兴源创 | 383,610.86 | 2.53 |
| 256 | 600999 | 招商证券 | 375,568.40 | 2.48 |
| 257 | 601319 | 中国人保 | 373,000.00 | 2.46 |
| 258 | 300525 | 博思软件 | 370,758.00 | 2.44 |
| 259 | 601003 | 柳钢股份 | 361,204.60 | 2.38 |
| 260 | 300175 | 朗源股份 | 356,752.00 | 2.35 |
| 261 | 688396 | 华润微 | 353,664.93 | 2.33 |
| 262 | 300463 | 迈克生物 | 352,530.00 | 2.32 |
| 263 | 603103 | 横店影视 | 350,184.00 | 2.31 |
| 264 | 603260 | 合盛硅业 | 348,940.00 | 2.30 |
| 265 | 601666 | 平煤股份 | 337,150.00 | 2.22 |
| 266 | 000099 | 中信海直 | 336,055.99 | 2.22 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 267 | 002291 | 星期六 | 335,933.00 | 2.21 |
| 268 | 002796 | 世嘉科技 | 334,404.00 | 2.20 |
| 269 | 300450 | 先导智能 | 330,330.00 | 2.18 |
| 270 | 000932 | 华菱钢铁 | 324,170.00 | 2.14 |
| 271 | 002839 | 张家港行 | 318,000.00 | 2.10 |
| 272 | 002262 | 恩华药业 | 317,812.00 | 2.10 |
| 273 | 600096 | 云天化 | 316,244.00 | 2.08 |
| 274 | 002861 | 瀛通通讯 | 315,000.00 | 2.08 |
| 275 | 000703 | 恒逸石化 | 312,639.00 | 2.06 |
| 276 | 600392 | 盛和资源 | 307,670.00 | 2.03 |

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 545,606,066.74 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 473,514,158.23 |

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有债券。

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股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|-------------|
| - | - | - | - | - | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | - |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | -449,580.00 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | - |

注：（1）本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金本报告期内未进行股指期货交易。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

7.12.2 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

本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 90,119.83 |
| 2 | 应收证券清算款 | 10,676,644.58 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,031.51 |
| 5 | 应收申购款 | 380,325.06 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 11,150,120.98 |

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金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 |
| 中科沃土沃瑞混合发起 A | 1,116 | 23,467.17 | 8,003,602.74 | 30.56% | 18,185,762.81 | 69.44% |
| 中科沃土沃瑞混合发起 C | 2,874 | 14,981.26 | 1,129,464.22 | 2.62% | 41,926,667.52 | 97.38% |
| 合计 | 3,990 | 17,354.76 | 9,133,066.96 | 13.19% | 60,112,430.33 | 86.81% |

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 | 中科沃土沃瑞混合发起 A | 1,136,574.97 | 4.34% |
| | 中科沃土沃瑞混合发起 C | 12,217.36 | 0.03% |
| | 合计 | 1,148,792.33 | 1.66% |

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 | 中科沃土沃瑞混合发起 A | 0 |
| | 中科沃土沃瑞混合发起 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开 | 中科沃土沃瑞混合发 | 50~100 |

| | | |
|------|------------------|--------|
| 放式基金 | 起 A | |
| | 中科沃土沃瑞混合发 起 C | 0~10 |
| | 合计 | 50~100 |

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占 基金总份额 比例 (%) | 发起份额总数 | 发起份额占 基金总份额 比例 (%) | 发起份额承 诺持有期限 |
|-----------------|---------------|--------------------------|---------------|--------------------------|----------------|
| 基金管理人固有 资金 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人高级 管理人员 | 98,861.48 | 0.14 | 108,749.48 | 0.16 | 3 年 |
| 基金经理等人员 | 906,847.75 | 1.31 | 804,089.32 | 1.16 | 3 年 |
| 基金管理人股东 | 9,004,013.70 | 13.00 | 9,004,013.70 | 13.00 | 3 年 |
| 其他 | 29,658.07 | 0.04 | 89,834.36 | 0.13 | 3 年 |
| 合计 | 10,039,382.00 | 14.50 | 10,006,686.86 | 14.45 | |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 中科沃土沃瑞混 合发起 A | 中科沃土沃瑞混 合发起 C |
|------------------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2019 年 1 月 14 日）基金份 额总额 | 8,992,376.24 | 1,486,436.45 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 10,681,489.09 | 1,650,035.76 |
| 本报告期基金总申购份额 | 22,910,965.88 | 62,356,426.66 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 7,403,089.42 | 20,950,330.68 |
| 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 | 26,189,365.55 | 43,056,131.74 |

§ 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 | |
| 东方财富证券 | 2 | 262,258,871.71 | 25.74% | 191,790.99 | 25.74% | - |
| 中信建投 | 2 | 234,506,437.02 | 23.01% | 171,495.17 | 23.01% | - |
| 东兴证券 | 1 | 210,841,191.93 | 20.69% | 154,186.96 | 20.69% | - |
| 国融证券 | 1 | 176,961,299.38 | 17.37% | 129,412.17 | 17.37% | - |
| 长城证券 | 1 | 134,445,058.92 | 13.19% | 98,308.00 | 13.19% | - |
| 银河证券 | 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 |
|--------|------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
| 东方财富证券 | - | - | 35,000,000.00 | 9.60% | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | 171,800,000.00 | 47.13% | - | - |
| 国融证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | 157,700,000.00 | 43.26% | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 上证报及管理人网站 | 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 | 上证报及管理人网站 | 2020年4月9日 |
| 3 | 中科沃土基金管理有限公司关于新增中信证券华南股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 上证报及管理人网站 | 2020年5月7日 |

中科沃土基金管理有限公司

2020年8月28日