

# 中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人: 中科沃土基金管理有限公司

基金托管人: 浙商银行股份有限公司

送出日期: 2022 年 03 月 31 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月30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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为基金财务出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2021年1月1日起至12月31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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	63
8.1 期末基金资产组合情况	63
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	63
8.3 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	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	88
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	112
8.6 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	113
8.7 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	113
8.8 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	113
8.9 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	113
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	114
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	114

8.12 投资组合报告附注.....	114
§9 基金份额持有人信息.....	115
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	115
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	115
9.3 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情况.....	116
§10 开放式基金份额变动.....	116
§11 重大事件揭示.....	116
11.1 基金份额持有人大会决议.....	116
11.2 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.....	117
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	117
11.4 基金投资策略的改变.....	117
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	117
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	117
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	117
11.8 其他重大事件.....	118
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	120
12.1 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.....	120
§13 备查文件目录.....	121
13.1 备查文件目录.....	121
13.2 存放地点.....	121
13.3 查阅方式.....	121

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中科沃土沃嘉混合	
基金主代码	004763	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年12月06日	
基金管理人	中科沃土基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	823,056,036.37份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中科沃土沃嘉A级	中科沃土沃嘉C级
下属分级基金的交易代码	004763	004764
报告期末下属分级基金的份额总额	570,439,264.52份	252,616,771.85份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活运用资产配置策略及多种股票市场、债券市场投资策略，充分挖掘潜在的投资机会，追求基金资产长期稳定增值。
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。基于稳健投资的理念，投资于优选行业中的绩优股票；对于债券投资，采用期限结构策略、信用策略、可转换债券投资策略等；适当参与股指期货、权证、国债期货等金融衍生品的投资，进行分散投资，力求实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数（全价）收益率×50%
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，高于债券型基金和货币市场

	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	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曹萍	朱巍
	联系电话	0757-86208608	0571-87659806
	电子邮箱	caoping@richlandasm.com.cn	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		400-018-3610	95527
传真		020-23388997	0571-88268688
注册地址		佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号千灯湖创投小镇核心区（自编号）十三座（B4）	杭州市萧山区鸿宁路1788号
办公地址		佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号千灯湖创投小镇核心区（自编号）十三座（B4）	杭州市拱墅区延安路368号
邮政编码		510620	310006
法定代表人		智会杰	张荣森（代为履行法定代表人职责）

注：因原法定代表人辞任，浙商银行股份有限公司于2022年1月14日以书面传签方式召开第六届董事会2022年第一次临时会议，审议通过了《关于推举董事代为履行董事长职责的议案》。经全体董事一致表决同意，由执行董事、行长张荣森先生代为履行董事长、董事会战略委员会主任委员、董事会普惠金融发展委员会主任委员及法定代表人职责，直至选举产生新任董事长且其任职资格获银保监会核准之日止。

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网	<a href="http://www.richlandasm.com.cn">http://www.richlandasm.com.cn</a>

址	
基金年度报告备置地点	佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号千灯湖创投小镇核心区（自编号）十三座（B4）

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼
注册登记机构	中科沃土基金管理有限公司	佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号千灯湖创投小镇核心区（自编号）十三座（B4）

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指 标	2021年		2020年		2019年	
	中科沃土 沃嘉混合A	中科沃土 沃嘉混合C	中科沃土 沃嘉混合A	中科沃土 沃嘉混合C	中科沃土 沃嘉混合A	中科沃土 沃嘉混合C
本期已 实现收 益	61,286,54 9.37	2,275,79 7.48	1,298,04 5.05	1,047,83 8.65	560,121.4 5	134,271.1 8
本期利 润	55,790,59 9.96	2,627,11 3.32	1,445,06 6.72	949,248.6 9	652,228.3 8	157,847.7 2
加权平 均基金 份额本 期利润	0.0734	0.1194	0.3354	0.1885	0.0296	0.0383
本期加 权平均 净值利 润率	6.16%	9.95%	31.51%	18.27%	3.47%	4.51%

本期基金份额净值增长率	6.22%	6.08%	30.14%	29.76%	8.98%	7.28%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2021年末		2020年末		2019年末	
期末可供分配利润	132,538,782.34	51,612,422.93	354,972.35	187,157.30	-876,928.08	-329,963.65
期末可供分配基金份额利润	0.2323	0.2043	0.1168	0.0927	-0.1554	-0.1713
期末基金资产净值	704,320,364.25	304,967,648.01	3,533,858.79	2,298,110.61	5,039,878.77	1,689,513.47
期末基金份额净值	1.2347	1.2072	1.1624	1.1380	0.8932	0.8770
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2021年末		2020年末		2019年末	
基金份额累计净值增长率	23.47%	20.72%	16.24%	13.80%	-10.68%	-12.30%

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

中科沃土沃嘉混合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
过去三个月	1.91%	0.13%	1.06%	0.39%	0.85%	-0.26%
过去六个月	3.28%	0.17%	-2.00%	0.51%	5.28%	-0.34%
过去一年	6.22%	0.27%	-1.55%	0.59%	7.77%	-0.32%
过去三年	50.65%	0.93%	33.73%	0.64%	16.92%	0.29%
自基金合同生效起至今	23.47%	0.86%	15.26%	0.64%	8.21%	0.22%

中科沃土沃嘉混合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
过去三个月	1.82%	0.13%	1.06%	0.39%	0.76%	-0.26%
过去六个月	3.15%	0.17%	-2.00%	0.51%	5.15%	-0.34%
过去一年	6.08%	0.27%	-1.55%	0.59%	7.63%	-0.32%
过去三年	47.67%	0.93%	33.73%	0.64%	13.94%	0.29%
自基金合同生效起至今	20.72%	0.86%	15.26%	0.64%	5.46%	0.22%

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

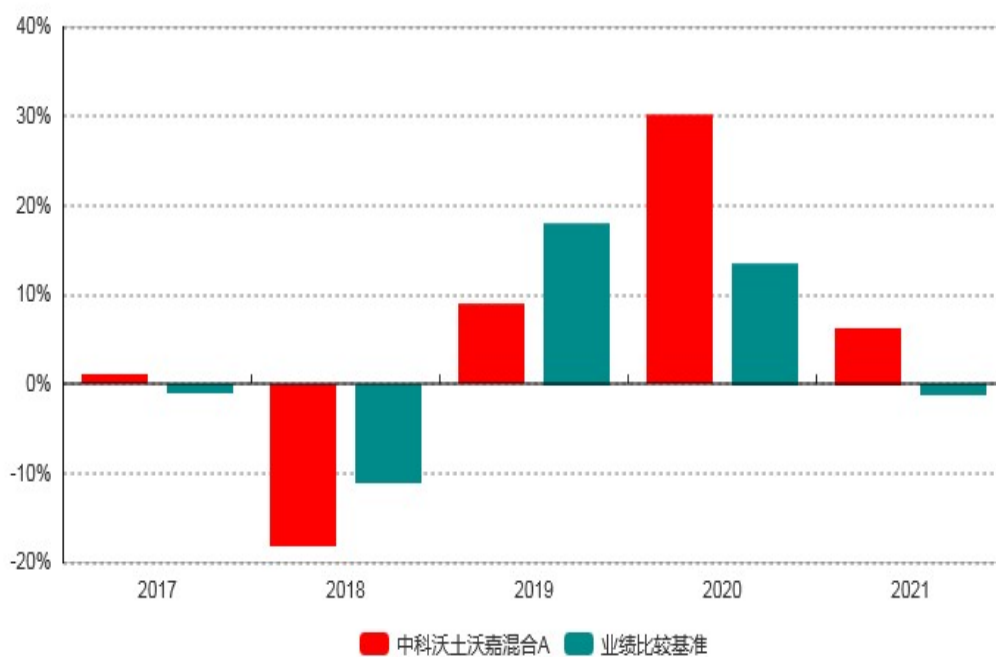
中科沃土沃嘉混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017年12月06日-2021年12月31日)



中科沃土沃嘉混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017年12月06日-2021年12月31日)



### 3.2.3 自基金合同生效以来每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：基金合同生效当年（2017 年）按实际存续期计算，未按自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2017 年 12 月 6 日）至本期报告期末未进行利润分配。

## § 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2.42亿元。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2021年12月31日，中科沃土旗下共管理7只开放式基金：中科沃土货币市场基金、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、中科沃土沃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		
孟禄程	基金经理、研究部总经理助理	2019-11-08	-	6年	理学硕士，曾任广东东阳光药业研究院研发工程师，广东中科招商创业投资管理有限公司公募筹备组组员，中科沃土基金管理有限公司研究部研究员、研究部总经理助理，现任中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金和中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、研究部总经理

					助理。中国国籍，具有基金从业资格。
李欣桐	固定收益部副总经理（主持工作）、基金经理	2021-04-09	-	8年	国际经济法硕士。曾任粤开证券（原联讯证券）固定收益部交易员、资产管理部投资经理，北京康思资本管理有限公司投资交易部投资总监，现任中科沃土基金管理有限公司固定收益部副总经理（主持工作）、中科沃土货币市场基金、中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金和中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。

此处的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中科沃土基金管理有限公司公平交易管理办法》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、交易执行的内部控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各投资组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统的公平交易功能将自动启用，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序 and 分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年市场主要指数收红，但行业分化明显，创业板指上涨12.20%，上证指数上涨4.80%，深圳成指上涨2.67%，而沪深300下跌5.20%。行业层面，电力设备、有色、煤炭、化工、钢铁等表现较好，而家电、非银、房地产、社服、食品饮料表现落后。

本基金2021年采用股债均衡配置策略，持续优化结构与评估估值收益比，增配经营质量较好的细分行业龙头。展望2022年，国内经济增速面临放缓，降准降息落地，实体

经济融资成本有望降低环节压力，市场依然保持较高流动性；国外加息与地区冲突成为最大变量，全球通胀与资金回流压力对国内市场进行传导，权益市场以结构性机会为主。权益市场配置方面，方向上看好消费复苏、新型电力系统、专精特新细分行业龙头、新一代信息技术（提升效率与拓展应用，如5G、元宇宙）。债券配置方面，以利率债为主，保持组合良好流动性，积极通过各类交易策略，增强组合收益率。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中科沃土沃嘉A级基金份额净值为1.2347元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为6.22%，同期业绩比较基准收益率为-1.55%；截至报告期末中科沃土沃嘉C级基金份额净值为1.2072元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为6.08%，同期业绩比较基准收益率为-1.55%。

#### 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2022年，国内经济增速面临放缓，降准降息落地，实体经济融资成本有望降低环节压力，市场依然保持较高流动性；国外加息与地区冲突成为最大变量，全球通胀与资金回流压力对国内市场进行传导，权益市场以结构性机会为主。权益市场配置方面，方向上看好消费复苏、新型电力系统、专精特新细分行业龙头、新一代信息技术（提升效率与拓展应用，如5G、元宇宙）。债券配置方面，以利率债为主，保持组合良好流动性，积极通过各类交易策略，增强组合收益率。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规、监管要求的变化和业务发展的实际需要，围绕严守“三条底线”、防控内幕交易等进一步完善公司内部风险控制，强化制度的完善及对制度执行情况的监督检查，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，有效保证了旗下基金运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。主要监察稽核工作及措施如下：

（1）结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际，不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，适应公司产品与业务发展的需要，保持公司良好的内控环境。

（2）严守合规底线、开展合规风险管理是监察稽核工作的重中之重。围绕重点开展对全体员工的合规培训教育及考试，建立了基金经理、投资经理上岗前的合规谈话机制，促进公司合规文化建设；不断完善相关机制流程，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易和市场操纵等违法违规行为，完善利益冲突管理相关制度机制。

(3) 坚持规范运作、稳健经营的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统，积极配合各类新产品、新业务、新投资工具的推出和应用，重点加强对高风险业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，加强对投资、交易等业务运作的日常合规检查和反馈提示，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规和基金合同的要求稳健、规范运作。

(4) 对投资交易、销售宣传、人员规范及个人投资申报、运营维稳、反洗钱、IT 治理等方面开展了定期或专项监察检查，推动公司合规、内控体系的健全完善。

(5) 积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关的合规、风控问题提供意见和建议。

(6) 切实把好法律风险和业务风险关；根据公司业务发展的需要，紧贴业务需求，不断提高合同审核效率，有效控制法律风险和业务风险；

(7) 深入贯彻风险为本的监管精神，加强公司洗钱风险管理体系建设，建立优化客户、产品、业务的洗钱风险识别和洗钱风险自评估工作机制，探索实施符合基金业务特征的可疑交易监控模型和方法，开展反洗钱宣传培训、内部审计、信息报送、意见反馈等各项工作。

(8) 紧跟法规变化和业务发展，认真做好公司及旗下各基金的各项信息披露工作，力求信息披露真实、完整、准确、及时、简明易懂。

(9) 不断促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，充分法规合规监控与监察稽核的独立性、规范性、针对性与有效性。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根

据法律法规的要求履行估值和净值计算的复核责任。本基金管理人已制定基金估值和份额计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；设有估值委员会，负责指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运营等方面的专业胜任能力。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。基金管理人改变估值技术，导致基金净值变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与



估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“（三）基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期未进行利润分配，符合合同规定。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——中科沃土基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中科沃土基金管理有限公司编制和披露的中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金2021年年度报告财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第22942号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人

<p>审计意见</p>	<p>(一) 我们审计的内容 我们审计了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(以下简称“中科沃土沃鑫成长混合基金”)的财务报表,包括2021年12月31日的资产负债表,2021年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二) 我们的意见我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了中科沃土沃嘉混合基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中科沃土沃嘉混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>—</p>
<p>其他事项</p>	<p>—</p>
<p>其他信息</p>	<p>—</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>中科沃土沃嘉混合基金的基金管理人中科沃土基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估中科沃土沃嘉混合基金的持续经营能力,披露与持</p>

	<p>续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中科沃土沃嘉混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中科沃土沃嘉混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中科沃土沃嘉混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可</p>

	获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中科沃土沃嘉混合基金不能持续经营。（五）评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	薛竞	姜爱悦
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼	
审计报告日期	2022-03-29	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	73,846,772.13	911,521.01
结算备付金		2,652,271.83	90,721.53
存出保证金		27,703.63	23,407.64
交易性金融资产	7.4.7.2	585,536,314.12	4,937,290.00
其中：股票投资		174,101,132.72	4,935,590.00
基金投资		-	-
债券投资		411,435,181.40	1,700.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	373,750,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	11,724,833.66	301.69
应收股利		-	-
应收申购款		809.10	4,485.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,047,538,704.47	5,967,727.77
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		37,179,798.15	-
应付赎回款		3,656.12	67,605.03
应付管理人报酬		652,862.61	3,995.09
应付托管费		122,411.74	749.08
应付销售服务费		42,856.51	403.04
应付交易费用	7.4.7.7	47,694.10	20,999.05
应交税费		12,412.98	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	189,000.00	42,007.08
负债合计		38,250,692.21	135,758.37
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	823,056,036.37	5,059,726.10
未分配利润	7.4.7.10	186,231,975.89	772,243.30

所有者权益合计		1,009,288,012.26	5,831,969.40
负债和所有者权益总计		1,047,538,704.47	5,967,727.77

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额总额823,056,036.37份，其中A类基金份额净值1.2347元，A类基金份额570,439,264.52份；C类基金份额净值1.2072元，C类基金份额252,616,771.85份。

## 7.2 利润表

会计主体：中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年12月31日
<b>一、收入</b>		68,368,090.23	2,778,480.39
1. 利息收入		37,483,330.48	42,081.92
其中：存款利息收入	7.4.7.11	425,113.28	23,638.59
债券利息收入		14,223,753.60	7.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		22,834,463.60	18,435.64
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		35,661,596.00	2,559,444.86
其中：股票投资收益	7.4.7.12	30,042,028.98	2,517,921.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,721,026.26	6,325.74
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-

衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,898,540.76	35,198.09
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-5,144,633.57	48,431.71
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	367,797.32	128,521.90
<b>减：二、费用</b>		9,950,376.95	384,164.98
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,440,580.99	79,980.05
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,395,109.03	14,996.20
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	48,914.23	10,618.67
4. 交易费用	7.4.7.19	534,623.58	258,070.06
5. 利息支出		303,623.32	-
其中：卖出回购金融资产支出		303,623.32	-
6. 税金及附加		13,475.52	-
7. 其他费用	7.4.7.20	214,050.28	20,500.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		58,417,713.28	2,394,315.41
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		58,417,713.28	2,394,315.41

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年01月01日至2021年12月31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)	5,059,726.10	772,243.30	5,831,969.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	58,417,713.28	58,417,713.28
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)	817,996,310.27	127,042,019.31	945,038,329.58
其中：1. 基金申购款	1,720,388,532.42	327,522,618.06	2,047,911,150.48
2. 基金赎回款	-902,392,222.15	-200,480,598.75	-1,102,872,820.90
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	823,056,036.37	186,231,975.89	1,009,288,012.26
项目	上年度可比期间		
	2020年01月01日至2020年12月31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)	7,569,011.13	-839,618.89	6,729,392.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,394,315.41	2,394,315.41



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）	-2,509,285.03	-782,453.22	-3,291,738.25
其中：1. 基金申购款	34,073,837.17	1,199,182.55	35,273,019.72
2. 基金赎回款	-36,583,122.20	-1,981,635.77	-38,564,757.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	5,059,726.10	772,243.30	5,831,969.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

智会杰

智会杰

李峰

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]第625号关于准予《中科沃土沃嘉灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由中科沃土基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币205,055,950.09元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2017)验字第61247680\_G05号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年12月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为205,162,272.11份基金份额,其中认购资金利

息折合106,322.02份基金份额。本基金的基金管理人为中科沃土基金管理有限公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司(以下简称“浙商银行”)。

根据《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，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、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票)、权证、股指期货、国债期货、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、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。本基金投资组合中股票占基金资产的比例为0%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%+中债综合指数(全价)收益率×50%。

本财务报表由本基金的基金管理人中科沃土基金管理有限公司于2022年3月29日批准报出。

#### 7.4.2 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<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2021年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

##### 7.4.4.4 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，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认

列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 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，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；

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20%，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、同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不违反法律法规、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。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日

在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号-收入》,本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则,该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	73,846,772.13	911,521.01
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	73,846,772.13	911,521.01

##### 7.4.7.2 交易性金融资产



单位：人民币元

项目		本期末 2021年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		182,111,031.18	174,101,132.72	-8,009,898.46
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	77,734,662.69	77,552,181.40	-182,481.29
	银行间市场	330,671,138.64	333,883,000.00	3,211,861.36
	合计	408,405,801.33	411,435,181.40	3,029,380.07
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		590,516,832.51	585,536,314.12	-4,980,518.39
项目		上年度末 2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		4,771,474.82	4,935,590.00	164,115.18
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,700.00	1,700.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,700.00	1,700.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,773,174.82	4,937,290.00	164,115.18

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	373,750,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	373,750,000.00	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

注：于2021年12月31日，交易所买入返售证券余额中包含的交易所固收平台质押式协议回购的余额为人民币331,750,000.00元(2020年12月31日：无)。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	6,074.36	234.04
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	1,053.90	44.44
应收债券利息	11,528,311.75	0.16
应收资产支持证券利息	-	-

应收买入返售证券利息	189,380.01	-
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	13.64	23.05
合计	11,724,833.66	301.69

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	44,295.74	20,999.05
银行间市场应付交易费用	3,398.36	-
合计	47,694.10	20,999.05

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	7.08
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	189,000.00	42,000.00
合计	189,000.00	42,007.08

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 7.4.7.9.1 中科沃土沃嘉混合A

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,040,214.66	3,040,214.66
本期申购	1,467,491,270.49	1,467,491,270.49
本期赎回（以“-”号填列）	-900,092,220.63	-900,092,220.63
本期末	570,439,264.52	570,439,264.52

#### 7.4.7.9.2 中科沃土沃嘉混合C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,019,511.44	2,019,511.44
本期申购	252,897,261.93	252,897,261.93
本期赎回（以“-”号填列）	-2,300,001.52	-2,300,001.52
本期末	252,616,771.85	252,616,771.85

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 7.4.7.10.1 中科沃土沃嘉混合A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	354,972.35	138,671.78	493,644.13
本期利润	61,286,549.37	-5,495,949.41	55,790,599.96
本期基金份额交易产生的变动数	70,897,260.62	6,699,595.02	77,596,855.64
其中：基金申购款	270,030,726.39	7,695,410.99	277,726,137.38
基金赎回款	-199,133,465.77	-995,815.97	-200,129,281.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	132,538,782.34	1,342,317.39	133,881,099.73

7.4.7.10.2 中科沃土沃嘉混合C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	187,157.30	91,441.87	278,599.17
本期利润	2,275,797.48	351,315.84	2,627,113.32
本期基金份额交易产生的变动数	49,149,468.15	295,695.52	49,445,163.67
其中：基金申购款	49,474,722.35	321,758.33	49,796,480.68
基金赎回款	-325,254.20	-26,062.81	-351,317.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	51,612,422.93	738,453.23	52,350,876.16

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	298,837.25	20,566.70
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	125,297.44	2,625.56
其他	978.59	446.33
合计	425,113.28	23,638.59

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	133,681,815.45	98,860,011.27
减：卖出股票成本总额	103,639,786.47	96,342,090.24

买卖股票差价收入	30,042,028.98	2,517,921.03
----------	---------------	--------------

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	2,721,026.26	6,325.74
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	2,721,026.26	6,325.74

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月 31日
卖出债券(、债转 股及债券到期兑 付)成交总额	1,763,503,650.19	253,249.80
减：卖出债券(、 债转股及债券到期 兑付)成本总额	1,731,757,202.54	246,748.58
减：应收利息总额	29,025,421.39	175.48
买卖债券差价收入	2,721,026.26	6,325.74

##### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,898,540.76	35,198.09
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	2,898,540.76	35,198.09

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12 月31日
1. 交易性金融资产	-5,144,633.57	48,431.71
——股票投资	-8,174,013.64	48,431.71
——债券投资	3,029,380.07	-
——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	-5,144,633.57	48,431.71

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	367,797.29	128,489.28
转换费收入	0.03	32.62
合计	367,797.32	128,521.90

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。  
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	513,148.58	258,070.06
银行间市场交易费用	21,475.00	-
合计	534,623.58	258,070.06

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日



审计费用	60,000.00	40,500.00
信息披露费	120,000.00	-20,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	726.76	-
账户维护费	23,000.00	-
其他	10,323.52	-
合计	214,050.28	20,500.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中科沃土基金管理有限公司（“中科沃土基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
浙商银行股份有限公司（“浙商银行”）	基金托管人、基金销售机构
广东中科科创创业投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
广东省粤科金融集团有限公司	基金管理人的股东
广东中广投资管理有限公司	基金管理人的股东
广东普瑞投资发展合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
珠海横琴沃海投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
珠海横琴沃土创业投资有限公司	基金管理人的股东
珠海横琴沃智投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
珠海横琴沃富投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
珠海横琴沃泽投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
广州西拓投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
珠海横琴沃信投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 7.4.10.1.5 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未有应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至202 1年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,440,580.99	79,980.05
其中：支付销售机构的客户维护费	9,266.55	34,054.50

注：支付基金管理人中科沃土基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,395,109.03	14,996.20

注：支付基金托管人浙商银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 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 2021年01月01日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃嘉混合A	中科沃土沃嘉混合C	合计
中科沃土 基金	0.00	46,570.91	46,570.91
浙商银行	0.00	109.28	109.28
合计	0.00	46,680.19	46,680.19
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃嘉混合A	中科沃土沃嘉混合C	合计
中科沃土 基金	0.00	15.29	15.29
浙商银行	0.00	706.86	706.86
合计	0.00	722.15	722.15

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中科沃土基金，再由中科沃土基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类的基金资产净值 X 0.20%/ 当年天数。

#### 7.4.10.3 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的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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发生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。

##### 7.4.10.4.2 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发生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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未出现除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 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 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行	73,846,772.13	298,837.25	911,521.01	20,566.70

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
601728	中国电信	2021-08-11	2022-02-21	主板锁定	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688798	艾为电子	2021-08-06	2022-02-16	科创板锁定	76.58	210.33	3,592	275,075.36	755,505.36	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2022-01-05	科创板锁定	11.48	67.46	4,926	56,550.48	332,307.96	-
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-01-06	新股未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688733	壹石通	2021-08-10	2022-02-17	科创板锁定	15.49	75.36	3,409	52,805.41	256,902.24	-
688257	新锐股份	2021-10-19	2022-04-27	科创板锁定	62.30	61.10	2,899	180,607.70	177,128.90	-
688049	炬芯科技	2021-11-22	2022-05-30	科创板锁定	42.98	51.71	3,260	140,114.80	168,574.60	-

688793	倍轻松	2021-07-07	2022-01-17	科创板锁定	27.40	101.73	1,454	39,839.60	147,915.42	-
688121	卓然股份	2021-08-30	2022-03-07	科创板锁定	18.16	36.42	3,681	66,846.96	134,062.02	-
688737	中自科技	2021-10-14	2022-04-22	科创板锁定	70.90	55.06	2,186	154,987.40	120,361.16	-
688509	正元地信	2021-07-22	2022-02-07	科创板锁定	1.97	6.17	15,433	30,403.01	95,221.61	-
688718	唯赛勃	2021-07-20	2022-01-28	科创板锁定	5.85	27.71	3,145	18,398.25	87,147.95	-
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	创业板锁定	60.66	96.75	884	53,623.44	85,527.00	-
301136	招标股份	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	创业板锁定	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301087	可孚医疗	2021-10-15	2022-04-25	创业板锁定	93.09	75.34	613	57,064.17	46,183.42	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	创业板锁定	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
688038	中科通达	2021-07-05	2022-01-13	科创板锁定	8.60	18.72	2,132	18,335.20	39,911.04	-

301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	创业板锁定	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	创业板锁定	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	创业板锁定	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301127	天源环保	2021-12-23	2022-06-30	创业板锁定	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	创业板锁定	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301058	中粮工科	2021-09-01	2022-03-09	创业板锁定	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301221	光庭信息	2021-12-15	2022-06-22	创业板锁定	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	创业板锁定	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-
301166	优宁维	2021-12-21	2022-06-28	创业板锁定	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	创业板锁定	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	创业板锁定	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-

301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	创业板锁定	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	创业板锁定	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301149	隆华新材	2021-11-03	2022-05-10	创业板锁定	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301082	久盛电气	2021-10-14	2022-04-27	创业板锁定	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	创业板锁定	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301100	风光股份	2021-12-10	2022-06-17	创业板锁定	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	创业板锁定	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	创业板锁定	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	创业板锁定	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	创业板锁定	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-
301101	明月镜片	2021-12-09	2022-06-16	创业板锁定	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-



3011 90	善水 科技	2021 -12- 17	2022 -06- 24	创业 板锁 定	27.8 5	27.4 6	575	16,0 13.7 5	15,7 89.5 0	-
3011 18	恒光 股份	2021 -11- 09	2022 -05- 18	创业 板锁 定	22.7 0	49.0 2	315	7,15 0.50	15,4 41.3 0	-
3011 08	洁雅 股份	2021 -11- 25	2022 -06- 06	创业 板锁 定	57.2 7	53.7 1	280	16,0 35.6 0	15,0 38.8 0	-
3011 79	泽宇 智能	2021 -12- 01	2022 -06- 08	创业 板锁 定	43.9 9	50.7 7	295	12,9 77.0 5	14,9 77.1 5	-
3010 89	拓新 药业	2021 -10- 20	2022 -04- 27	创业 板锁 定	19.1 1	67.9 3	220	4,20 4.20	14,9 44.6 0	-
3010 46	能辉 科技	2021 -08- 10	2022 -02- 17	创业 板锁 定	8.34	48.9 9	290	2,41 8.60	14,2 07.1 0	-
3011 11	粤万 年青	2021 -11- 30	2022 -06- 07	创业 板锁 定	10.4 8	36.6 8	379	3,97 1.92	13,9 01.7 2	-
3011 99	迈赫 股份	2021 -11- 30	2022 -06- 07	创业 板锁 定	29.2 8	32.0 0	402	11,7 70.5 6	12,8 64.0 0	-
3010 20	密封 科技	2021 -06- 28	2022 -01- 06	创业 板锁 定	10.6 4	30.4 4	421	4,47 9.44	12,8 15.2 4	-
3011 38	华研 精机	2021 -12- 08	2022 -06- 15	创业 板锁 定	26.1 7	44.8 6	285	7,45 8.45	12,7 85.1 0	-
3010 26	浩通 科技	2021 -07- 08	2022 -01- 17	创业 板锁 定	18.0 3	62.7 3	203	3,66 0.09	12,7 34.1 9	-

3011 26	达嘉 维康	2021 -11- 30	2022 -06- 07	创业 板锁 定	12.3 7	19.2 3	662	8,18 8.94	12,7 30.2 6	-
3011 85	鸥玛 软件	2021 -11- 11	2022 -05- 19	创业 板锁 定	11.8 8	21.1 6	578	6,86 6.64	12,2 30.4 8	-
3010 21	英诺 激光	2021 -06- 28	2022 -01- 06	创业 板锁 定	9.46	41.4 3	290	2,74 3.40	12,0 14.7 0	-
3010 92	争光 股份	2021 -10- 21	2022 -05- 05	创业 板锁 定	36.3 1	35.5 2	323	11,7 28.1 3	11,4 72.9 6	-
3010 48	金鹰 重工	2021 -08- 11	2022 -02- 28	创业 板锁 定	4.13	12.9 6	843	3,48 1.59	10,9 25.2 8	-
3010 28	东亚 机械	2021 -07- 12	2022 -01- 20	创业 板锁 定	5.31	13.5 0	733	3,89 2.23	9,89 5.50	-
3007 74	倍杰 特	2021 -07- 26	2022 -02- 16	创业 板锁 定	4.57	21.0 8	444	2,02 9.08	9,35 9.52	-
3010 78	孩子 王	2021 -09- 30	2022 -04- 14	创业 板锁 定	5.77	12.1 4	756	4,36 2.12	9,17 7.84	-
3011 82	凯旺 科技	2021 -12- 16	2022 -06- 23	创业 板锁 定	27.1 2	30.5 8	294	7,97 3.28	8,99 0.52	-
3010 62	上海 艾录	2021 -09- 07	2022 -03- 14	创业 板锁 定	3.31	17.0 1	523	1,73 1.13	8,89 6.23	-
3011 93	家联 科技	2021 -12- 02	2022 -06- 09	创业 板锁 定	30.7 3	29.1 4	297	9,12 6.81	8,65 4.58	-

301052	果麦文化	2021-08-23	2022-02-28	创业板锁定	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	创业板锁定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	创业板锁定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	创业板锁定	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	创业板锁定	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	创业板锁定	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	创业板锁定	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	创业板锁定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	创业板锁定	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	创业板锁定	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	创业板锁定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-

301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	创业板锁定	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	创业板锁定	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	创业板锁定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301083	百胜智能	2021-10-13	2022-04-21	创业板锁定	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	创业板锁定	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	创业板锁定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	创业板锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	创业板锁定	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	创业板锁定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	创业板锁定	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-

301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	创业板锁定	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	创业板锁定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	创业板锁定	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	创业板锁定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021-12-28	2022-01-14	新债未上市	100.00	100.00	2,560	256,000.00	256,000.00	-
113052	兴业转债	2021-12-29	2022-01-14	新债未上市	100.00	100.00	4,930	493,000.00	493,000.00	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

本基金为混合型基金，理论上其风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

##### 7.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人浙商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	40,028,000.00	-
合计	40,028,000.00	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为政策性金融债。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	39,316,000.00	-
合计	39,316,000.00	-

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	749,000.00	-

AAA以下	76,803,181.40	1,700.00
未评级	254,539,000.00	-
合计	332,091,181.40	1,700.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为政策性金融债。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2021年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理



人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年1 2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	73,846,772.13	-	-	-	73,846,772.13
结算备付金	2,652,271.83	-	-	-	2,652,271.83
存出保证金	27,703.63	-	-	-	27,703.63
交易性金融资产	156,597,500.00	171,764,681.40	83,073,000.00	174,101,132.72	585,536,314.12
买入返售金融资产	373,750,000.00	-	-	-	373,750,000.00
应收利息	-	-	-	11,724,833.66	11,724,833.66
应收申购款	-	-	-	809.10	809.10
资产总计	606,874,247.59	171,764,681.40	83,073,000.00	185,826,775.48	1,047,538,704.47
负债					
应付证券清算款	-	-	-	37,179,798.15	37,179,798.15
应付赎回款	-	-	-	3,656.12	3,656.12
应付管理人报酬	-	-	-	652,862.61	652,862.61
应付托管费	-	-	-	122,411.74	122,411.74
应付销售服务费	-	-	-	42,856.51	42,856.51
应付交易费用	-	-	-	47,694.10	47,694.10
应交税费	-	-	-	12,412.98	12,412.98
其他负债	-	-	-	189,000.00	189,000.00
负债总计	-	-	-	38,250,692.21	38,250,692.21
利率敏感度缺	606,874,247.59	171,764,681.40	83,073,000.00	147,576,083.27	1,009,288,012.26

口					
上年度末 2020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	911,521.01	-	-	-	911,521.01
结算备付金	90,721.53	-	-	-	90,721.53
存出保证金	23,407.64	-	-	-	23,407.64
交易性金融资产	1,700.00	-	-	4,935,590.00	4,937,290.00
应收利息	-	-	-	301.69	301.69
应收申购款	-	-	-	4,485.90	4,485.90
资产总计	1,027,350.18	-	-	4,940,377.59	5,967,727.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	67,605.03	67,605.03
应付管理人报酬	-	-	-	3,995.09	3,995.09
应付托管费	-	-	-	749.08	749.08
应付销售服务费	-	-	-	403.04	403.04
应付交易费用	-	-	-	20,999.05	20,999.05
其他负债	-	-	-	42,007.08	42,007.08
负债总计	-	-	-	135,758.37	135,758.37
利率敏感度缺口	1,027,350.18	-	-	4,804,619.22	5,831,969.40

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	1. 市场利率下降25个基点	2,860,660.07	无重大影响
	2. 市场利率上升25个基点	-2,811,979.29	无重大影响

于2020年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.03%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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。

#### 7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的0-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020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	174,101,132.72	17.25	4,935,590.00	84.63
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	174,101,132.72	17.25	4,935,590.00	84.63

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	8,179,302.30	229,411.59
	业绩比较基准下降5%	-8,179,302.30	-229,411.59

#### 7.4.14 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

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021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169,024,395.83元，属于第二层次的余额为411,362,729.35元，属于第三层次的余额为5,149,188.94元(2020年12月31日：第一层次4,935,590.00元，第二层次1,700.00元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于2021年12月31日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具5,149,188.94元(2020年12月31日：无)。本基金本年度购买第三层次的金融工具3,513,176.00元(2020年度：无)，计入损益的第三层次的金融工具公允价值变动1,636,012.94元(2020年度：无)。

于2021年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产(均为股票投资)公允价值为5,149,188.94元，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系(2020年12月31日：无)。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准

则第37号-金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日,本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质,新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初所有者权益,2021年的比较数据将不作重述。

(3)除公允价值和执行新金融工具准则外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	174,101,132.72	16.62
	其中:股票	174,101,132.72	16.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	411,435,181.40	39.28
	其中:债券	411,435,181.40	39.28
	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	373,750,000.00	35.68
	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	76,499,043.96	7.30
8	其他各项资产	11,753,346.39	1.12
9	合计	1,047,538,704.47	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,237,942.00	0.12
B	采矿业	3,675,702.00	0.36
C	制造业	97,671,891.24	9.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,344,952.13	0.53
E	建筑业	2,701,114.42	0.27
F	批发和零售业	1,322,911.50	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	7,308,705.00	0.72
H	住宿和餐饮业	7,628.16	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,042,452.65	0.90
J	金融业	35,705,302.78	3.54
K	房地产业	2,622,036.00	0.26
L	租赁和商务服务业	1,911,570.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	3,196,369.97	0.32
N	水利、环境和公共设施管理业	52,039.91	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	114,756.00	0.01
Q	卫生和社会工作	1,633,253.04	0.16
R	文化、体育和娱乐业	552,505.92	0.05
S	综合	-	-
	合计	174,101,132.72	17.25

### 8.2.2 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。

### 8.3 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	4,900	10,045,000.0	1.00



				0	
2	600036	招商银行	97,300	4,739,483.00	0.47
3	601318	中国平安	86,054	4,337,982.14	0.43
4	000858	五粮液	17,100	3,807,486.00	0.38
5	002930	宏川智慧	120,000	3,102,000.00	0.31
6	000333	美的集团	38,700	2,856,447.00	0.28
7	300059	东方财富	66,200	2,456,682.00	0.24
8	600900	长江电力	89,400	2,029,380.00	0.20
9	601166	兴业银行	106,200	2,022,048.00	0.20
10	600887	伊利股份	47,800	1,981,788.00	0.20
11	002594	比亚迪	7,300	1,957,276.00	0.19
12	002415	海康威视	36,700	1,920,144.00	0.19
13	002475	立讯精密	38,400	1,889,280.00	0.19
14	601728	中国电信	422,873	1,807,399.43	0.18
15	600276	恒瑞医药	35,240	1,787,020.40	0.18
16	600030	中信证券	67,000	1,769,470.00	0.18
17	600905	三峡能源	227,763	1,710,500.13	0.17
18	601012	隆基股份	18,960	1,634,352.00	0.16
19	603259	药明康德	13,700	1,624,546.00	0.16
20	000568	泸州老窖	5,800	1,472,446.00	0.15
21	000651	格力电器	37,800	1,399,734.00	0.14
22	000725	京东方A	266,000	1,343,300.00	0.13
23	600031	三一重工	56,700	1,292,760.00	0.13
24	601398	工商银行	275,600	1,276,028.00	0.13
25	603501	韦尔股份	4,100	1,274,157.00	0.13
26	000001	平安银行	76,300	1,257,424.00	0.12
27	601888	中国中免	5,700	1,250,637.00	0.12
28	600309	万华化学	12,300	1,242,300.00	0.12
29	300274	阳光电源	8,000	1,166,400.00	0.12
30	600809	山西汾酒	3,580	1,130,492.40	0.11
31	300633	开立医疗	34,900	1,114,357.00	0.11

32	002142	宁波银行	28,530	1,092,128.40	0.11
33	600406	国电南瑞	26,800	1,072,804.00	0.11
34	000002	万科A	53,500	1,057,160.00	0.10
35	601899	紫金矿业	108,500	1,052,450.00	0.10
36	300014	亿纬锂能	8,900	1,051,802.00	0.10
37	002812	恩捷股份	4,200	1,051,680.00	0.10
38	600436	片仔癀	2,400	1,049,160.00	0.10
39	600111	北方稀土	22,100	1,012,180.00	0.10
40	601328	交通银行	216,000	995,760.00	0.10
41	002352	顺丰控股	14,300	985,556.00	0.10
42	600837	海通证券	75,800	929,308.00	0.09
43	002460	赣锋锂业	6,300	899,955.00	0.09
44	600690	海尔智家	29,800	890,722.00	0.09
45	002987	京北方	28,200	886,044.00	0.09
46	600048	保利地产	56,400	881,532.00	0.09
47	300124	汇川技术	12,250	840,350.00	0.08
48	300015	爱尔眼科	19,855	839,469.40	0.08
49	601668	中国建筑	164,700	823,500.00	0.08
50	000063	中兴通讯	24,300	814,050.00	0.08
51	600000	浦发银行	92,200	786,466.00	0.08
52	300122	智飞生物	6,300	784,980.00	0.08
53	002304	洋河股份	4,700	774,231.00	0.08
54	600585	海螺水泥	18,900	761,670.00	0.08
55	688798	艾为电子	3,592	755,505.36	0.07
56	601816	京沪高铁	154,300	745,269.00	0.07
57	002049	紫光国微	3,300	742,500.00	0.07
58	603799	华友钴业	6,700	739,077.00	0.07
59	603986	兆易创新	4,200	738,570.00	0.07
60	002230	科大讯飞	14,000	735,140.00	0.07
61	002271	东方雨虹	13,900	732,252.00	0.07
62	002714	牧原股份	13,700	731,032.00	0.07

63	601601	中国太保	26,900	729,528.00	0.07
64	601688	华泰证券	40,500	719,280.00	0.07
65	300750	宁德时代	1,200	705,600.00	0.07
66	002129	中环股份	16,700	697,225.00	0.07
67	002371	北方华创	2,000	694,040.00	0.07
68	002241	歌尔股份	12,800	692,480.00	0.07
69	300142	沃森生物	12,300	691,260.00	0.07
70	000100	TCL科技	110,200	679,934.00	0.07
71	000338	潍柴动力	37,300	667,297.00	0.07
72	601288	农业银行	225,700	663,558.00	0.07
73	002027	分众传媒	80,700	660,933.00	0.07
74	600016	民生银行	167,200	652,080.00	0.06
75	601211	国泰君安	35,500	635,095.00	0.06
76	600745	闻泰科技	4,900	633,570.00	0.06
77	603288	海天味业	6,000	630,660.00	0.06
78	000661	长春高新	2,200	597,080.00	0.06
79	300294	博雅生物	15,500	594,425.00	0.06
80	601088	中国神华	25,900	583,268.00	0.06
81	601766	中国中车	95,600	582,204.00	0.06
82	600050	中国联通	146,200	574,566.00	0.06
83	600570	恒生电子	9,240	574,266.00	0.06
84	600104	上汽集团	27,500	567,325.00	0.06
85	601919	中远海控	30,000	560,700.00	0.06
86	600085	同仁堂	12,400	557,752.00	0.06
87	601229	上海银行	78,100	556,853.00	0.06
88	300450	先导智能	7,400	550,338.00	0.05
89	600919	江苏银行	92,800	541,024.00	0.05
90	600893	航发动力	8,400	533,064.00	0.05
91	300347	泰格医药	4,100	523,980.00	0.05
92	600660	福耀玻璃	11,000	518,540.00	0.05
93	601169	北京银行	116,300	516,372.00	0.05

94	600999	招商证券	29,100	513,615.00	0.05
95	601988	中国银行	165,800	505,690.00	0.05
96	600019	宝钢股份	69,900	500,484.00	0.05
97	600010	包钢股份	178,800	498,852.00	0.05
98	601669	中国电建	59,900	483,992.00	0.05
99	600958	东方证券	32,800	483,472.00	0.05
10 0	000513	丽珠集团	12,000	482,520.00	0.05
10 1	002410	广联达	7,500	479,850.00	0.05
10 2	002311	海大集团	6,500	476,450.00	0.05
10 3	601633	长城汽车	9,600	465,984.00	0.05
10 4	600196	复星医药	9,500	464,930.00	0.05
10 5	601390	中国中铁	80,200	464,358.00	0.05
10 6	300685	艾德生物	6,100	460,611.00	0.05
10 7	600588	用友网络	12,800	459,264.00	0.05
10 8	601877	正泰电器	8,500	458,065.00	0.05
10 9	300760	迈瑞医疗	1,200	456,960.00	0.05
11 0	600028	中国石化	105,200	444,996.00	0.04
11 1	601658	邮储银行	85,300	435,030.00	0.04
11 2	002179	中航光电	4,300	432,408.00	0.04

11 3	002493	荣盛石化	23,800	432,208.00	0.04
11 4	601818	光大银行	129,800	430,936.00	0.04
11 5	002001	新 和 成	13,700	426,344.00	0.04
11 6	000538	云南白药	4,000	418,600.00	0.04
11 7	601377	兴业证券	42,100	415,948.00	0.04
11 8	000768	中航西飞	10,900	397,850.00	0.04
11 9	601628	中国人寿	13,100	394,179.00	0.04
12 0	300558	贝达药业	4,900	391,167.00	0.04
12 1	300498	温氏股份	20,100	387,126.00	0.04
12 2	601225	陕西煤业	31,500	384,300.00	0.04
12 3	300408	三环集团	8,600	383,560.00	0.04
12 4	600346	恒力石化	16,600	381,302.00	0.04
12 5	603806	福斯特	2,900	378,595.00	0.04
12 6	002236	大华股份	16,100	378,028.00	0.04
12 7	000776	广发证券	15,300	376,227.00	0.04
12 8	601857	中国石油	76,200	374,142.00	0.04
12	688111	金山办公	1,400	371,000.00	0.04

9					
130	688248	南网科技	15,763	364,125.30	0.04
131	600426	华鲁恒升	11,600	363,080.00	0.04
132	000166	申万宏源	70,700	361,984.00	0.04
133	002008	大族激光	6,700	361,800.00	0.04
134	600763	通策医疗	1,800	358,200.00	0.04
135	002202	金风科技	21,700	357,399.00	0.04
136	002050	三花智控	14,100	356,730.00	0.04
137	600009	上海机场	7,600	354,844.00	0.04
138	601009	南京银行	39,300	352,128.00	0.03
139	600741	华域汽车	12,400	350,920.00	0.03
140	600150	中国船舶	14,000	347,060.00	0.03
141	000895	双汇发展	10,900	343,895.00	0.03
142	600176	中国巨石	18,800	342,160.00	0.03
143	601985	中国核电	41,200	341,960.00	0.03
144	600029	南方航空	49,700	338,457.00	0.03
145	601100	恒立液压	4,100	335,380.00	0.03

14 6	600011	华能国际	34,600	335,274.00	0.03
14 7	688239	航宇科技	4,926	332,307.96	0.03
14 8	001979	招商蛇口	24,900	332,166.00	0.03
14 9	688169	石头科技	400	325,200.00	0.03
15 0	300896	爱美客	600	321,666.00	0.03
15 1	300413	芒果超媒	5,600	320,432.00	0.03
15 2	300601	康泰生物	3,200	315,328.00	0.03
15 3	601600	中国铝业	51,400	313,026.00	0.03
15 4	600760	中航沈飞	4,600	312,984.00	0.03
15 5	603993	洛阳钼业	55,700	310,806.00	0.03
15 6	601939	建设银行	52,800	309,408.00	0.03
15 7	002597	金禾实业	6,000	308,100.00	0.03
15 8	600584	长电科技	9,800	303,996.00	0.03
15 9	601989	中国重工	71,800	302,996.00	0.03
16 0	688008	澜起科技	3,600	301,932.00	0.03
16 1	600989	宝丰能源	17,300	300,328.00	0.03
16	002601	龙佰集团	10,500	300,195.00	0.03

2					
16 3	002291	星期六	15,000	299,400.00	0.03
16 4	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.03
16 5	601006	大秦铁路	46,700	298,880.00	0.03
16 6	600926	杭州银行	23,300	298,706.00	0.03
16 7	688036	传音控股	1,900	298,110.00	0.03
16 8	002212	天融信	15,500	297,135.00	0.03
16 9	600795	国电电力	92,600	293,542.00	0.03
17 0	003816	中国广核	92,500	289,525.00	0.03
17 1	301033	迈普医学	4,708	287,628.76	0.03
17 2	600132	重庆啤酒	1,900	287,508.00	0.03
17 3	000977	浪潮信息	8,000	286,640.00	0.03
17 3	000786	北新建材	8,000	286,640.00	0.03
17 5	600079	人福医药	12,700	286,004.00	0.03
17 6	601186	中国铁建	36,200	282,360.00	0.03
17 7	601555	东吴证券	31,720	281,039.20	0.03
17 8	002555	三七互娱	10,400	281,008.00	0.03



179	603658	安图生物	5,070	279,154.20	0.03
180	601138	工业富联	23,400	278,928.00	0.03
181	600438	通威股份	6,200	278,752.00	0.03
182	000963	华东医药	6,900	277,380.00	0.03
183	600600	青岛啤酒	2,800	277,200.00	0.03
184	603517	绝味食品	4,000	273,320.00	0.03
185	000625	长安汽车	17,860	271,293.40	0.03
186	600015	华夏银行	48,300	270,480.00	0.03
187	300433	蓝思科技	11,700	268,866.00	0.03
188	300253	卫宁健康	16,000	268,160.00	0.03
189	600547	山东黄金	14,200	267,244.00	0.03
190	603369	今世缘	4,900	266,560.00	0.03
191	002821	凯莱英	600	261,000.00	0.03
192	002736	国信证券	22,700	260,596.00	0.03
193	601238	广汽集团	17,100	259,749.00	0.03
194	600352	浙江龙盛	20,400	257,652.00	0.03
19	603659	璞泰来	1,600	256,976.00	0.03

5					
19 6	688733	壹石通	3,409	256,902.24	0.03
19 7	601336	新华保险	6,600	256,608.00	0.03
19 8	000938	紫光股份	11,200	255,920.00	0.03
19 9	601901	方正证券	32,300	253,232.00	0.03
20 0	688012	中微公司	2,000	253,200.00	0.03
20 1	300595	欧普康视	4,400	252,428.00	0.03
20 2	600886	国投电力	21,900	251,193.00	0.02
20 3	002007	华兰生物	8,600	250,604.00	0.02
20 4	688363	华熙生物	1,600	248,480.00	0.02
20 5	002602	世纪华通	29,300	245,827.00	0.02
20 6	300033	同花顺	1,700	245,786.00	0.02
20 7	603882	金城医学	2,200	245,014.00	0.02
20 8	000157	中联重科	33,300	238,761.00	0.02
20 9	601800	中国交建	27,700	237,666.00	0.02
21 0	002262	恩华药业	15,000	234,750.00	0.02
21 1	688212	澳华内镜	6,200	234,174.00	0.02

21 2	000783	长江证券	30,500	229,970.00	0.02
21 3	600383	金地集团	17,700	229,569.00	0.02
21 4	002938	鹏鼎控股	5,400	229,122.00	0.02
21 5	601788	光大证券	15,300	228,429.00	0.02
21 6	601799	星宇股份	1,100	224,675.00	0.02
21 7	300003	乐普医疗	9,900	224,037.00	0.02
21 8	601066	中信建投	7,600	222,300.00	0.02
21 9	000425	徐工机械	36,900	221,031.00	0.02
22 0	603019	中科曙光	8,000	220,560.00	0.02
22 1	000596	古井贡酒	900	219,600.00	0.02
22 2	601108	财通证券	19,700	219,064.00	0.02
22 3	600109	国金证券	19,100	216,403.00	0.02
22 4	601618	中国中冶	56,400	216,012.00	0.02
22 5	601111	中国国航	23,500	214,555.00	0.02
22 6	600183	生益科技	9,000	211,950.00	0.02
22 7	002841	视源股份	2,600	211,640.00	0.02
22	603939	益丰药房	3,800	209,418.00	0.02

8					
22 9	603833	欧派家居	1,400	206,500.00	0.02
23 0	601838	成都银行	17,000	204,000.00	0.02
23 1	688396	华润微	3,100	200,260.00	0.02
23 2	000066	中国长城	13,800	195,408.00	0.02
23 3	688106	金宏气体	7,000	194,670.00	0.02
23 4	603160	汇顶科技	1,800	193,986.00	0.02
23 5	600161	天坛生物	6,500	188,240.00	0.02
23 6	600332	白云山	5,500	188,100.00	0.02
23 7	603899	晨光文具	2,900	187,079.00	0.02
23 8	002120	韵达股份	9,100	186,186.00	0.02
23 9	002624	完美世界	9,100	184,821.00	0.02
24 0	000703	恒逸石化	17,300	183,726.00	0.02
24 1	600362	江西铜业	8,200	183,106.00	0.02
24 2	002916	深南电路	1,500	182,730.00	0.02
24 3	300630	普利制药	3,300	181,632.00	0.02
24 4	600115	东方航空	35,100	181,116.00	0.02

24 5	601607	上海医药	9,100	180,817.00	0.02
24 6	002252	上海莱士	26,500	180,730.00	0.02
24 7	002414	高德红外	7,400	179,154.00	0.02
24 8	600143	金发科技	14,200	178,636.00	0.02
24 9	688257	新锐股份	2,899	177,128.90	0.02
25 0	300144	宋城演艺	12,300	176,136.00	0.02
25 1	601727	上海电气	36,000	174,960.00	0.02
25 2	300628	亿联网络	2,100	171,045.00	0.02
25 3	300529	健帆生物	3,200	170,560.00	0.02
25 4	002044	美年健康	21,600	169,560.00	0.02
25 5	688049	炬芯科技	3,260	168,574.60	0.02
25 6	300451	创业慧康	15,000	167,700.00	0.02
25 7	600872	中炬高新	4,400	167,068.00	0.02
25 8	600061	国投资本	20,272	166,635.84	0.02
25 9	601021	春秋航空	2,900	164,720.00	0.02
26 0	002600	领益智造	22,100	162,656.00	0.02
26	000708	中信特钢	7,900	161,792.00	0.02

1					
26 2	600703	三安光电	4,300	161,508.00	0.02
26 3	300596	利安隆	3,600	161,136.00	0.02
26 4	601878	浙商证券	12,200	160,796.00	0.02
26 5	300759	康龙化成	1,100	155,397.00	0.02
26 6	603338	浙江鼎力	1,900	152,494.00	0.02
26 7	000876	新希望	10,000	152,100.00	0.02
26 8	600018	上港集团	27,500	150,700.00	0.01
26 9	688793	倍轻松	1,454	147,915.42	0.01
27 0	300677	英科医疗	2,550	147,492.00	0.01
27 1	002064	华峰化学	14,000	146,160.00	0.01
27 2	002791	坚朗五金	800	145,272.00	0.01
27 3	601990	南京证券	14,500	143,695.00	0.01
27 4	300676	华大基因	1,600	140,480.00	0.01
27 5	601216	君正集团	26,400	138,072.00	0.01
27 6	601162	天风证券	33,900	137,295.00	0.01
27 7	601868	N中能	50,000	136,500.00	0.01

27 8	000301	东方盛虹	7,000	135,380.00	0.01
27 9	600976	健民集团	1,700	134,113.00	0.01
28 0	688121	卓然股份	3,681	134,062.02	0.01
28 1	300782	卓胜微	400	130,720.00	0.01
28 2	300999	金龙鱼	2,000	125,860.00	0.01
28 3	600655	豫园股份	12,200	125,660.00	0.01
28 4	600489	中金黄金	15,200	125,096.00	0.01
28 5	300888	稳健医疗	1,500	123,675.00	0.01
28 6	603486	科沃斯	800	120,760.00	0.01
28 7	601933	永辉超市	29,800	120,690.00	0.01
28 8	688737	中自科技	2,186	120,361.16	0.01
28 9	002024	苏宁易购	29,200	120,304.00	0.01
29 0	002157	正邦科技	12,400	119,784.00	0.01
29 1	002607	中公教育	14,600	114,756.00	0.01
29 2	002709	天赐材料	1,000	114,650.00	0.01
29 3	601881	中国银河	10,100	113,019.00	0.01
29	300825	阿尔特	4,000	112,040.00	0.01

4					
29 5	601998	中信银行	24,000	110,880.00	0.01
29 6	603392	万泰生物	500	110,750.00	0.01
29 7	601966	玲珑轮胎	3,000	109,650.00	0.01
29 8	605499	东鹏饮料	600	109,104.00	0.01
29 9	688981	中芯国际	2,000	105,980.00	0.01
30 0	688314	康拓医疗	1,600	105,568.00	0.01
30 1	688561	奇安信	1,200	105,504.00	0.01
30 2	601995	中金公司	2,100	102,963.00	0.01
30 3	688009	中国通号	20,400	101,592.00	0.01
30 4	688126	沪硅产业	3,900	100,698.00	0.01
30 5	603195	公牛集团	600	100,380.00	0.01
30 6	689009	九号公司	1,400	98,098.00	0.01
30 7	688509	正元地信	15,433	95,221.61	0.01
30 8	600025	华能水电	14,200	93,578.00	0.01
30 9	002459	晶澳科技	1,000	92,700.00	0.01
31 0	688110	东芯股份	2,049	92,573.82	0.01



31 1	301155	海力风电	936	91,933.40	0.01
31 2	601319	中国人保	19,500	91,650.00	0.01
31 3	002191	劲嘉股份	6,000	90,780.00	0.01
31 4	601236	红塔证券	7,410	88,327.20	0.01
31 5	600845	宝信软件	1,450	88,203.50	0.01
31 6	601696	中银证券	6,500	87,425.00	0.01
31 7	688718	唯赛勃	3,145	87,147.95	0.01
31 8	000069	华侨城 A	12,300	86,592.00	0.01
31 9	601231	环旭电子	5,200	83,512.00	0.01
32 0	300316	晶盛机电	1,200	83,400.00	0.01
32 1	002032	苏泊尔	1,300	80,912.00	0.01
32 2	603233	大参林	1,900	80,009.00	0.01
32 3	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.01
32 4	688677	海泰新光	800	75,280.00	0.01
32 5	000800	一汽解放	7,300	75,117.00	0.01
32 6	002568	百润股份	1,200	71,796.00	0.01
32	601808	中海油服	4,700	70,500.00	0.01

7					
32 8	601865	福莱特	1,200	69,528.00	0.01
32 9	688599	天合光能	800	63,120.00	0.01
33 0	601898	中煤能源	10,000	62,900.00	0.01
33 1	600918	中泰证券	6,100	60,817.00	0.01
33 2	300233	金城医药	2,000	58,180.00	0.01
33 3	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.01
33 4	300866	安克创新	500	51,250.00	0.01
33 5	601698	中国卫通	3,400	48,926.00	0.00
33 6	301087	可孚医疗	613	46,183.42	0.00
33 7	002466	天齐锂业	400	42,800.00	0.00
33 8	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
33 9	688038	中科通达	2,132	39,911.04	0.00
34 0	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
34 1	301211	亨迪药业	1,064	36,187.72	0.00
34 2	603087	甘李药业	500	35,170.00	0.00
34 3	601155	新城控股	1,100	32,043.00	0.00

34 4	301090	华润材料	2,835	31,952.12	0.00
34 5	301166	优宁维	328	31,633.50	0.00
34 6	688728	格科微	1,033	31,165.61	0.00
34 7	301127	天源环保	1,743	30,017.06	0.00
34 8	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.00
34 9	301058	中粮工科	1,560	28,687.56	0.00
35 0	603260	合盛硅业	200	26,394.00	0.00
35 1	301069	凯盛新材	586	26,121.38	0.00
35 2	301221	光庭信息	291	25,891.77	0.00
35 3	301039	N中集	2,064	25,820.64	0.00
35 4	001317	三羊马	300	25,722.00	0.00
35 5	301096	百诚医药	314	24,968.38	0.00
35 6	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
35 7	301093	华兰股份	488	24,512.45	0.00
35 8	301046	能辉科技	491	24,397.80	0.00
35 9	688622	禾信仪器	400	23,980.00	0.00
36	300982	苏文电能	317	23,328.03	0.00

0					
36 1	300994	久祺股份	495	22,660.50	0.00
36 2	301100	风光股份	685	21,839.16	0.00
36 3	301060	兰卫医学	669	21,009.64	0.00
36 4	301082	久盛电气	944	20,421.18	0.00
36 5	301018	C申菱	782	20,378.92	0.00
36 6	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
36 7	301168	通灵股份	381	20,273.89	0.00
36 8	301048	金鹰重工	1,424	18,867.55	0.00
36 9	603213	镇洋发展	799	18,504.84	0.00
37 0	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
37 1	301088	戎美股份	736	18,196.48	0.00
37 2	301052	果麦文化	520	18,031.48	0.00
37 3	301101	明月镜片	403	17,826.72	0.00
37 4	301190	善水科技	641	17,782.70	0.00
37 5	301179	泽宇智能	341	17,526.01	0.00
37 6	301118	恒光股份	342	17,116.65	0.00

37 7	301091	深城交	540	16,933.80	0.00
37 8	301138	华研精机	349	16,554.70	0.00
37 9	605289	罗曼股份	379	15,197.90	0.00
38 0	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
38 1	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
38 2	300985	致远新能	295	14,460.90	0.00
38 3	301111	粤万年青	383	14,094.72	0.00
38 4	301126	达嘉维康	715	13,932.83	0.00
38 5	301199	迈赫股份	414	13,285.80	0.00
38 6	301020	C密封	421	12,815.24	0.00
38 7	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
38 8	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
38 9	301021	C英诺	290	12,014.70	0.00
39 0	301092	争光股份	330	11,744.63	0.00
39 1	301193	家联科技	370	10,979.63	0.00
39 2	301078	孩子王	851	10,757.69	0.00
39	301182	凯旺科技	332	10,345.60	0.00

3					
39 4	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
39 5	301055	张小泉	441	9,687.54	0.00
39 6	301198	喜悦智行	313	9,547.09	0.00
39 7	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
39 8	300814	中富电路	380	9,119.12	0.00
39 9	301062	上海艾录	525	8,932.29	0.00
40 0	301098	金埔园林	369	8,560.79	0.00
40 1	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
40 2	301063	海锅股份	224	8,308.03	0.00
40 3	301056	森赫股份	716	8,003.80	0.00
40 4	301073	君亭酒店	232	7,628.16	0.00
40 5	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
40 6	301068	大地海洋	236	6,904.68	0.00
40 7	301072	中捷精工	202	6,846.26	0.00
40 8	300998	宁波方正	201	6,699.33	0.00
40 9	301083	百胜智能	460	6,667.72	0.00

41 0	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
41 1	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
41 2	300854	中兰环保	226	6,211.01	0.00
41 3	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
41 4	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
41 5	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
41 6	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
41 7	301059	金三江	281	5,451.68	0.00
41 8	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
41 9	301079	邵阳液压	196	5,252.80	0.00
42 0	600606	绿地控股	1,135	4,925.90	0.00
42 1	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
42 2	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
42 3	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
42 4	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
42 5	600848	上海临港	200	2,974.00	0.00
42	688285	高铁电气	159	1,617.03	0.00

6					
---	--	--	--	--	--

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	600519	贵州茅台	10,737,365.91	184.11
2	601318	中国平安	8,582,414.90	147.16
3	000001	平安银行	6,072,465.00	104.12
4	600036	招商银行	5,309,313.37	91.04
5	000858	五粮液	5,254,887.00	90.10
6	000333	美的集团	4,567,730.54	78.32
7	600276	恒瑞医药	3,745,842.80	64.23
8	002930	宏川智慧	3,686,368.09	63.21
9	600905	三峡能源	3,587,527.95	61.51
10	601166	兴业银行	2,811,596.00	48.21
11	000651	格力电器	2,706,805.00	46.41
12	601888	中国中免	2,663,882.68	45.68
13	601012	隆基股份	2,647,178.00	45.39
14	300059	东方财富	2,570,817.00	44.08
15	601728	中国电信	2,554,624.69	43.80
16	600031	三一重工	2,510,281.00	43.04
17	600030	中信证券	2,257,208.00	38.70
18	600887	伊利股份	2,249,030.00	38.56
19	002415	海康威视	2,248,942.86	38.56
20	002475	立讯精密	2,066,573.08	35.44
21	002594	比亚迪	2,058,792.00	35.30
22	603259	药明康德	2,025,539.60	34.73
23	600900	长江电力	1,922,378.00	32.96
24	603288	海天味业	1,763,424.32	30.24



25	600309	万华化学	1,756,041.00	30.11
26	603501	韦尔股份	1,737,469.00	29.79
27	000002	万科A	1,716,270.00	29.43
28	000568	泸州老窖	1,706,318.82	29.26
29	002714	牧原股份	1,628,187.24	27.92
30	000725	京东方A	1,611,252.00	27.63
31	002352	顺丰控股	1,603,605.00	27.50
32	601398	工商银行	1,504,482.00	25.80
33	002304	洋河股份	1,481,360.00	25.40
34	300633	开立医疗	1,475,184.00	25.29
35	601601	中国太保	1,447,903.00	24.83
36	600809	山西汾酒	1,409,265.00	24.16
37	300122	智飞生物	1,403,165.00	24.06
38	601899	紫金矿业	1,360,531.00	23.33
39	300124	汇川技术	1,292,138.44	22.16
40	600570	恒生电子	1,265,896.00	21.71
41	300015	爱尔眼科	1,248,397.00	21.41
42	601939	建设银行	1,198,092.00	20.54
43	600438	通威股份	1,178,928.00	20.21
44	002142	宁波银行	1,152,360.10	19.76
45	000661	长春高新	1,132,899.00	19.43
46	600585	海螺水泥	1,128,383.00	19.35
47	002597	金禾实业	1,123,888.00	19.27
48	601328	交通银行	1,115,265.00	19.12
49	300142	沃森生物	1,087,501.00	18.65
50	000513	丽珠集团	1,070,860.88	18.36
51	600837	海通证券	1,045,051.00	17.92
52	600690	海尔智家	1,028,446.00	17.63
53	000100	TCL科技	1,020,214.00	17.49
54	600000	浦发银行	999,448.00	17.14
55	600048	保利地产	994,752.00	17.06

56	603986	兆易创新	989,025.64	16.96
57	002027	分众传媒	978,710.00	16.78
58	002987	京北方	974,293.00	16.71
59	002007	华兰生物	973,920.00	16.70
60	300630	普利制药	967,970.41	16.60
61	601688	华泰证券	959,817.00	16.46
62	300628	亿联网络	957,840.00	16.42
63	300014	亿纬锂能	945,686.00	16.22
64	002821	凯莱英	942,851.96	16.17
65	601668	中国建筑	935,156.00	16.03
66	000063	中兴通讯	924,667.00	15.86
67	300601	康泰生物	924,362.00	15.85
68	300558	贝达药业	914,278.00	15.68
69	600111	北方稀土	912,345.00	15.64
70	000338	潍柴动力	905,790.00	15.53
71	688111	金山办公	898,298.00	15.40
72	002812	恩捷股份	891,449.00	15.29
73	600016	民生银行	889,623.00	15.25
74	600588	用友网络	879,058.71	15.07
75	300498	温氏股份	844,943.00	14.49
76	600406	国电南瑞	841,769.00	14.43
77	300274	阳光电源	840,692.00	14.42
78	600999	招商证券	823,328.00	14.12
79	300003	乐普医疗	820,881.00	14.08
80	600161	天坛生物	817,835.00	14.02
81	601816	京沪高铁	813,913.00	13.96
82	600703	三安光电	781,916.00	13.41
83	002460	赣锋锂业	781,345.00	13.40
84	300294	博雅生物	780,390.00	13.38
85	300750	宁德时代	778,749.00	13.35
86	601919	中远海控	777,870.00	13.34

87	300347	泰格医药	777,627.77	13.33
88	601288	农业银行	759,553.00	13.02
89	600104	上汽集团	752,529.00	12.90
90	600436	片仔癀	742,269.00	12.73
91	002410	广联达	720,044.14	12.35
92	002230	科大讯飞	719,625.00	12.34
93	601211	国泰君安	717,728.00	12.31
94	688538	和辉光电	715,796.80	12.27
95	300596	利安隆	706,194.00	12.11
96	603658	安图生物	703,831.00	12.07
97	600763	通策医疗	694,444.00	11.91
98	688187	时代电气	689,287.16	11.82
99	601229	上海银行	683,100.00	11.71
100	600660	福耀玻璃	680,435.10	11.67
101	002271	东方雨虹	680,114.00	11.66
102	688169	石头科技	673,918.00	11.56
103	002241	歌尔股份	672,930.00	11.54
104	600050	中国联通	671,886.00	11.52
105	600009	上海机场	670,962.00	11.50
106	603799	华友钴业	667,952.00	11.45
107	601766	中国中车	662,454.00	11.36
108	600346	恒力石化	661,224.00	11.34
109	300685	艾德生物	655,070.00	11.23
110	600919	江苏银行	641,021.00	10.99
111	000776	广发证券	636,900.00	10.92
112	600893	航发动力	614,681.00	10.54
113	688303	大全能源	612,787.35	10.51
114	002291	星期六	609,189.00	10.45
115	000538	云南白药	594,640.00	10.20
116	600196	复星医药	589,258.00	10.10
117	601818	光大银行	585,589.00	10.04

118	603993	洛阳钼业	583,924.00	10.01
119	603516	淳中科技	581,190.80	9.97
120	601628	中国人寿	577,111.00	9.90
121	301087	可孚医疗	570,455.52	9.78
122	002202	金风科技	566,615.00	9.72
123	601169	北京银行	562,606.00	9.65
124	002262	恩华药业	561,555.00	9.63
125	002422	科伦药业	558,077.00	9.57
126	601988	中国银行	553,378.00	9.49
127	688739	成大生物	550,330.00	9.44
128	600085	同仁堂	544,686.00	9.34
129	002049	紫光国微	537,828.00	9.22
130	601088	中国神华	536,729.28	9.20
131	301155	海力风电	535,991.76	9.19
132	002493	荣盛石化	528,983.00	9.07
133	601658	邮储银行	521,115.00	8.94
134	601607	上海医药	520,530.00	8.93
135	600019	宝钢股份	511,797.00	8.78
136	300413	芒果超媒	510,743.00	8.76
137	000895	双汇发展	509,770.00	8.74
138	600745	闻泰科技	506,132.00	8.68
139	603517	绝味食品	501,474.00	8.60
140	002311	海大集团	491,044.00	8.42
141	000768	中航西飞	488,508.00	8.38
142	600028	中国石化	488,312.00	8.37
143	601390	中国中铁	486,920.00	8.35
144	301033	迈普医学	486,551.64	8.34
145	600976	健民集团	484,092.00	8.30
146	002212	天融信	476,938.00	8.18
147	002001	新和成	470,233.00	8.06
148	601100	恒立液压	460,009.00	7.89

149	300233	金城医药	457,808.00	7.85
150	002129	中环股份	451,870.00	7.75
151	002050	三花智控	446,250.00	7.65
152	000786	北新建材	445,003.78	7.63
153	600958	东方证券	439,524.00	7.54
154	000625	长安汽车	439,458.00	7.54
155	000876	新希望	438,035.00	7.51
156	300760	迈瑞医疗	437,116.00	7.50
157	601009	南京银行	435,019.00	7.46
158	000066	中国长城	434,407.00	7.45
159	601336	新华保险	433,491.00	7.43
160	000166	申万宏源	429,448.00	7.36
161	688151	华强科技	429,431.42	7.36
162	002236	大华股份	428,964.00	7.36
163	300450	先导智能	428,833.20	7.35
164	000157	中联重科	427,386.00	7.33
165	601901	方正证券	426,389.00	7.31
166	002555	三七互娱	425,648.00	7.30
167	600584	长电科技	425,585.00	7.30
168	601633	长城汽车	425,196.00	7.29
169	601377	兴业证券	423,813.00	7.27
170	600741	华域汽车	415,952.17	7.13
171	605016	百龙创园	412,681.90	7.08
172	002179	中航光电	412,276.00	7.07
173	002044	美年健康	410,328.00	7.04
174	600176	中国巨石	410,044.00	7.03
175	688110	东芯股份	399,854.82	6.86
176	600547	山东黄金	397,836.00	6.82
177	002371	北方华创	397,532.00	6.82
178	002601	龙佰集团	396,625.87	6.80
179	300825	阿尔特	390,491.00	6.70

180	002286	保龄宝	388,777.00	6.67
181	600426	华鲁恒升	388,543.50	6.66
182	688425	铁建重工	388,259.34	6.66
183	601877	正泰电器	386,912.00	6.63
184	300529	健帆生物	384,458.00	6.59
185	600010	包钢股份	383,500.00	6.58
186	300433	蓝思科技	382,866.00	6.56
187	688076	诺泰生物	381,933.85	6.55
188	600926	杭州银行	380,346.00	6.52
189	001979	招商蛇口	373,342.00	6.40
190	601857	中国石油	370,326.00	6.35
191	300408	三环集团	369,966.76	6.34
192	601225	陕西煤业	368,991.00	6.33
193	688036	传音控股	368,242.00	6.31
194	002841	视源股份	365,311.00	6.26
195	600392	盛和资源	362,421.00	6.21
196	688606	奥泰生物	361,310.01	6.20
197	600109	国金证券	360,175.00	6.18
198	601066	中信建投	360,098.00	6.17
199	000860	顺鑫农业	356,746.00	6.12
200	601989	中国重工	355,600.00	6.10
201	002736	国信证券	355,600.00	6.10
202	600132	重庆啤酒	352,917.00	6.05
203	600015	华夏银行	352,140.00	6.04
204	688230	芯导科技	349,697.14	6.00
205	603939	益丰药房	348,447.00	5.97
206	688008	澜起科技	348,386.45	5.97
207	603160	汇顶科技	347,993.00	5.97
208	601006	大秦铁路	347,928.00	5.97
209	600760	中航沈飞	347,456.00	5.96
210	688553	汇宇制药	347,031.36	5.95

211	601788	光大证券	346,818.00	5.95
212	300896	爱美客	344,094.00	5.90
213	300595	欧普康视	344,032.00	5.90
214	603882	金城医学	343,979.00	5.90
215	002008	大族激光	341,360.00	5.85
216	603659	璞泰来	340,950.80	5.85
217	002607	中公教育	340,409.00	5.84
218	601155	新城控股	339,048.00	5.81
219	601555	东吴证券	338,732.80	5.81
220	002624	完美世界	335,542.00	5.75
221	600872	中炬高新	332,580.00	5.70
222	603369	今世缘	332,284.00	5.70
223	688728	格科微	331,214.54	5.68
224	601138	工业富联	329,852.00	5.66
225	601186	中国铁建	327,675.00	5.62
226	603899	晨光文具	326,545.00	5.60
227	688363	华熙生物	325,443.02	5.58
228	603019	中科曙光	323,455.00	5.55
229	600352	浙江龙盛	321,527.00	5.51
230	300957	贝泰妮	320,850.07	5.50
231	688660	电气风电	318,934.72	5.47
232	605336	帅丰电器	314,309.20	5.39
233	300463	迈克生物	311,460.00	5.34
234	600079	人福医药	310,134.00	5.32
235	600600	青岛啤酒	309,431.00	5.31
236	300979	华利集团	307,152.12	5.27
237	688012	中微公司	306,675.39	5.26
238	003816	中国广核	306,416.00	5.25
239	000783	长江证券	303,494.00	5.20
240	002600	领益智造	301,667.00	5.17
241	002938	鹏鼎控股	301,029.00	5.16

242	603538	美诺华	299,887.00	5.14
243	688262	国芯科技	299,275.42	5.13
244	002268	卫士通	295,158.00	5.06
245	603883	老百姓	294,789.00	5.05
246	688280	精进电动	292,287.58	5.01
247	600183	生益科技	291,906.00	5.01
248	300981	中红医疗	291,685.77	5.00
249	600029	南方航空	290,057.00	4.97
250	002991	甘源食品	289,703.00	4.97
251	301090	华润材料	288,785.75	4.95
252	601108	财通证券	288,638.00	4.95
253	600143	金发科技	288,503.00	4.95
254	601985	中国核电	287,555.00	4.93
255	301189	奥尼电子	287,552.10	4.93
256	002384	东山精密	285,628.00	4.90
257	688396	华润微	284,309.71	4.88
258	688561	奇安信	282,772.58	4.85
259	002675	东诚药业	281,527.00	4.83
260	000069	华侨城 A	280,477.00	4.81
261	601111	中国国航	280,334.00	4.81
262	688083	中望软件	276,468.50	4.74
263	688798	艾为电子	275,075.36	4.72
264	601669	中国电建	272,890.00	4.68
265	603806	福斯特	272,443.00	4.67
266	002557	洽洽食品	271,780.00	4.66
267	601799	星宇股份	271,683.00	4.66
268	300687	赛意信息	269,754.00	4.63
269	600845	宝信软件	268,838.00	4.61
270	000938	紫光股份	267,256.00	4.58
271	603233	大参林	267,133.00	4.58
272	000596	古井贡酒	265,983.00	4.56



273	600383	金地集团	264,911.00	4.54
274	300253	卫宁健康	264,392.00	4.53
275	002456	欧菲光	264,316.00	4.53
276	600061	国投资本	264,297.00	4.53
277	600989	宝丰能源	262,842.00	4.51
278	002602	世纪华通	262,411.00	4.50
279	600580	卧龙电驱	257,156.00	4.41
280	002024	苏宁易购	256,698.00	4.40
281	300676	华大基因	256,278.00	4.39
282	300136	信维通信	256,188.00	4.39
283	300144	宋城演艺	255,325.00	4.38
284	600089	特变电工	253,885.00	4.35
285	002414	高德红外	253,668.00	4.35
286	688314	康拓医疗	252,598.06	4.33
287	601878	浙商证券	250,640.00	4.30
288	002923	润都股份	249,909.00	4.29
289	301211	亨迪药业	249,331.20	4.28
290	600522	中天科技	246,130.00	4.22
291	600886	国投电力	245,804.00	4.21
292	601933	永辉超市	245,448.00	4.21
293	688779	长远锂科	243,435.90	4.17
294	300033	同花顺	242,217.00	4.15
295	002916	深南电路	241,966.00	4.15
296	688248	南网科技	240,052.04	4.12
297	000425	徐工机械	237,808.00	4.08
298	301093	华兰股份	237,431.04	4.07
299	600795	国电电力	236,354.00	4.05
300	000708	中信特钢	235,926.00	4.05
301	601238	广汽集团	235,764.00	4.04
302	301088	戎美股份	233,313.76	4.00
303	000963	华东医药	230,733.80	3.96

304	601800	中国交建	230,480.00	3.95
305	688112	鼎阳科技	228,386.60	3.92
306	688212	澳华内镜	227,640.00	3.90
307	000728	国元证券	227,590.00	3.90
308	688777	中控技术	227,353.93	3.90
309	600150	中国船舶	226,086.25	3.88
310	002120	韵达股份	225,940.00	3.87
311	600705	中航资本	225,500.00	3.87
312	603833	欧派家居	224,924.00	3.86
313	601600	中国铝业	224,114.14	3.84
314	000703	恒逸石化	223,202.00	3.83
315	301166	优宁维	217,559.68	3.73
316	301096	百诚医药	216,034.40	3.70
317	002157	正邦科技	212,179.00	3.64
318	601162	天风证券	211,634.00	3.63
319	601727	上海电气	208,752.00	3.58
320	601077	渝农商行	208,290.00	3.57
321	000403	派林生物	207,379.00	3.56
322	000977	浪潮信息	206,974.00	3.55
323	601838	成都银行	206,311.00	3.54
324	600362	江西铜业	204,974.00	3.51
325	300438	鹏辉能源	204,805.00	3.51
326	002463	沪电股份	204,232.00	3.50
327	002739	万达电影	203,358.00	3.49
328	301127	天源环保	202,621.29	3.47
329	688265	南模生物	200,887.88	3.44
330	688106	金宏气体	199,155.20	3.41
331	300759	康龙化成	197,044.00	3.38
332	300677	英科医疗	195,469.00	3.35
333	600066	宇通客车	195,272.00	3.35
334	301221	光庭信息	195,062.99	3.34

335	002399	海普瑞	194,039.00	3.33
336	601696	中银证券	192,904.00	3.31
337	000656	金科股份	192,808.00	3.31
338	002252	上海莱士	191,975.00	3.29
339	301091	深城交	191,260.00	3.28
340	600606	绿地控股	190,493.00	3.27
341	002946	新乳业	187,532.00	3.22
342	688772	珠海冠宇	187,012.80	3.21
343	600115	东方航空	186,960.00	3.21
344	603486	科沃斯	185,561.00	3.18
345	600918	中泰证券	184,954.00	3.17
346	600487	亨通光电	184,170.00	3.16
347	688257	新锐股份	180,607.70	3.10
348	600177	雅戈尔	180,591.00	3.10
349	601618	中国中冶	179,584.00	3.08
350	600011	华能国际	178,880.00	3.07
351	603195	公牛集团	178,664.00	3.06
352	601021	春秋航空	176,657.00	3.03
353	600118	中国卫星	175,729.00	3.01
354	002931	锋龙股份	175,057.00	3.00
355	688677	海泰新光	172,924.02	2.97
356	300832	新产业	172,387.00	2.96
357	600369	西南证券	171,920.00	2.95
358	002508	老板电器	171,792.00	2.95
359	000301	东方盛虹	170,678.00	2.93
360	688206	概伦电子	169,680.00	2.91
361	600521	华海药业	168,390.71	2.89
362	601198	东兴证券	167,130.00	2.87
363	301100	风光股份	166,442.85	2.85
364	600637	东方明珠	165,908.00	2.84
365	600068	葛洲坝	165,189.00	2.83

366	002673	西部证券	162,129.00	2.78
367	603392	万泰生物	161,475.00	2.77
368	002773	康弘药业	161,312.00	2.77
369	300748	金力永磁	161,267.00	2.77
370	301108	洁雅股份	160,356.00	2.75
371	600498	烽火通信	159,990.00	2.74
372	301190	善水科技	159,886.85	2.74
373	688167	炬光科技	158,481.66	2.72
374	002558	巨人网络	158,272.00	2.71
375	600489	中金黄金	155,437.00	2.67
376	688737	中自科技	154,987.40	2.66
377	688227	品高股份	154,442.76	2.65
378	300973	立高食品	153,381.04	2.63
379	002064	华峰化学	153,150.00	2.63
380	600332	白云山	152,547.00	2.62
381	600004	白云机场	151,404.00	2.60
382	600848	上海临港	150,067.00	2.57
383	300782	卓胜微	148,000.00	2.54
384	600018	上港集团	147,601.00	2.53
385	000627	天茂集团	147,566.00	2.53
386	601990	南京证券	146,915.00	2.52
387	001209	洪兴股份	145,872.48	2.50
388	605499	东鹏饮料	145,213.64	2.49
389	601216	君正集团	144,363.00	2.48
390	601881	中国银河	144,315.00	2.47
391	301039	N中集	143,654.40	2.46
392	603520	司太立	143,528.00	2.46
393	600390	五矿资本	143,235.00	2.46
394	002791	坚朗五金	142,878.00	2.45
395	301035	润丰股份	141,893.52	2.43
396	301082	久盛电气	141,549.12	2.43

397	301050	雷电微力	141,230.56	2.42
398	688049	炬芯科技	140,114.80	2.40
399	688161	威高骨科	139,929.18	2.40
400	600655	豫园股份	139,887.00	2.40
401	000961	中南建设	139,608.00	2.39
402	300451	创业慧康	138,772.00	2.38
403	601319	中国人保	138,140.00	2.37
404	688009	中国通号	137,856.00	2.36
405	601825	沪农商行	137,772.00	2.36
406	000831	五矿稀土	135,190.00	2.32
407	688575	亚辉龙	132,798.83	2.28
408	601868	N中能	132,500.00	2.27
409	601236	红塔证券	132,166.30	2.27
410	600271	航天信息	130,866.27	2.24
411	600233	圆通速递	130,387.00	2.24
412	601117	中国化学	129,908.00	2.23
413	601998	中信银行	129,809.00	2.23
414	002709	天赐材料	129,788.00	2.23
415	301179	泽宇智能	129,374.59	2.22
416	688981	中芯国际	129,318.00	2.22
417	603429	集友股份	128,704.00	2.21
418	301168	通灵股份	128,221.48	2.20
419	000723	美锦能源	127,368.00	2.18
420	688131	皓元医药	127,055.45	2.18
421	601995	中金公司	126,875.00	2.18
422	300999	金龙鱼	126,725.00	2.17
423	688276	百克生物	126,716.10	2.17
424	300888	稳健医疗	125,777.00	2.16
425	688091	上海谊众	125,501.40	2.15
426	688778	厦钨新能	124,337.50	2.13
427	603338	浙江鼎力	123,185.00	2.11

428	600998	九州通	123,183.00	2.11
429	300986	志特新材	122,814.28	2.11
430	601872	招商轮船	122,675.00	2.10
431	301149	隆华新材	122,229.66	2.10
432	600208	新湖中宝	121,581.00	2.08
433	688236	春立医疗	120,790.12	2.07
434	002032	苏泊尔	119,860.00	2.06
435	603707	健友股份	119,705.66	2.05
436	300731	科创新源	119,082.00	2.04
437	601966	玲珑轮胎	118,265.00	2.03
438	301199	迈赫股份	117,529.92	2.02
439	301092	争光股份	117,281.30	2.01
440	000739	普洛药业	117,000.00	2.01

#### 8.4.2 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	600905	三峡能源	6,422,204.60	110.12
2	000001	平安银行	4,078,343.00	69.93
3	688303	大全能源	1,893,981.61	32.48
4	601318	中国平安	1,810,888.00	31.05
5	002930	宏川智慧	1,377,134.00	23.61
6	601012	隆基股份	1,321,650.00	22.66
7	301155	海力风电	1,289,405.20	22.11
8	688538	和辉光电	1,251,772.64	21.46
9	688187	时代电气	1,194,093.00	20.47
10	300957	贝泰妮	1,108,464.74	19.01
11	002597	金禾实业	1,060,330.00	18.18
12	688779	长远锂科	1,028,917.28	17.64
13	300633	开立医疗	955,327.00	16.38

14	600438	通威股份	955,036.00	16.38
15	601939	建设银行	902,370.00	15.47
16	002821	凯莱英	892,485.61	15.30
17	300979	华利集团	848,094.87	14.54
18	601888	中国中免	824,557.00	14.14
19	300628	亿联网络	812,390.00	13.93
20	300630	普利制药	797,975.00	13.68
21	688083	中望软件	779,225.00	13.36
22	688728	格科微	776,627.68	13.32
23	601728	中国电信	775,530.00	13.30
24	600703	三安光电	758,872.00	13.01
25	300981	中红医疗	752,417.31	12.90
26	688425	铁建重工	732,171.35	12.55
27	600161	天坛生物	715,823.00	12.27
28	002714	牧原股份	702,843.00	12.05
29	300059	东方财富	687,074.80	11.78
30	603288	海天味业	669,315.00	11.48
31	000333	美的集团	648,057.00	11.11
32	688131	皓元医药	645,605.05	11.07
33	688660	电气风电	640,202.32	10.98
34	601919	中远海控	634,696.00	10.88
35	000651	格力电器	630,357.00	10.81
36	300601	康泰生物	622,406.00	10.67
37	300122	智飞生物	604,651.00	10.37
38	300596	利安隆	603,844.00	10.35
39	603501	韦尔股份	602,606.00	10.33
40	600276	恒瑞医药	601,431.00	10.31
41	600588	用友网络	586,507.02	10.06
42	600570	恒生电子	582,182.00	9.98
43	301050	雷电微力	576,524.00	9.89
44	002422	科伦药业	568,796.00	9.75

45	688111	金山办公	566,543.50	9.71
46	000513	丽珠集团	553,000.00	9.48
47	000547	航天发展	551,577.00	9.46
48	688778	厦钨新能	550,630.25	9.44
49	300003	乐普医疗	532,436.00	9.13
50	603516	淳中科技	530,619.00	9.10
51	300124	汇川技术	525,622.00	9.01
52	688112	鼎阳科技	524,828.59	9.00
53	601601	中国太保	524,583.00	8.99
54	688110	东芯股份	517,589.80	8.88
55	002304	洋河股份	516,866.00	8.86
56	688151	华强科技	515,769.96	8.84
57	301087	可孚医疗	506,045.12	8.68
58	688230	芯导科技	503,133.55	8.63
59	002007	华兰生物	494,076.00	8.47
60	603658	安图生物	489,079.50	8.39
61	300498	温氏股份	488,726.00	8.38
62	002241	歌尔股份	485,448.00	8.32
63	688385	复旦微电	479,850.91	8.23
64	688772	珠海冠宇	473,982.98	8.13
65	600809	山西汾酒	472,053.00	8.09
66	301029	怡合达	447,810.01	7.68
67	603986	兆易创新	444,960.00	7.63
68	600392	盛和资源	443,629.00	7.61
69	688076	诺泰生物	440,299.89	7.55
70	300463	迈克生物	438,160.00	7.51
71	600976	健民集团	418,616.00	7.18
72	688606	奥泰生物	417,058.10	7.15
73	600519	贵州茅台	410,677.00	7.04
74	300558	贝达药业	410,325.00	7.04
75	688739	成大生物	407,774.15	6.99



76	002286	保龄宝	406,083.00	6.96
77	603659	璞泰来	400,334.00	6.86
78	002594	比亚迪	399,663.00	6.85
79	605016	百龙创园	399,604.40	6.85
80	688499	利元亨	396,792.00	6.80
81	688167	炬光科技	394,740.85	6.77
82	300973	立高食品	392,296.50	6.73
83	301090	华润材料	391,280.00	6.71
84	688707	振华新材	382,422.54	6.56
85	600522	中天科技	377,541.00	6.47
86	000776	广发证券	376,705.00	6.46
87	300233	金城医药	374,333.00	6.42
88	600845	宝信软件	372,728.00	6.39
89	600111	北方稀土	367,782.00	6.31
90	688161	威高骨科	363,670.79	6.24
91	600309	万华化学	359,499.00	6.16
92	300142	沃森生物	352,890.00	6.05
93	601607	上海医药	350,630.00	6.01
94	301039	N中集	345,499.34	5.92
95	601899	紫金矿业	343,735.00	5.89
96	000066	中国长城	343,224.00	5.89
97	301211	亨迪药业	343,216.00	5.89
98	603538	美诺华	342,236.00	5.87
99	300687	赛意信息	339,699.20	5.82
100	002262	恩华药业	337,505.40	5.79
101	688553	汇宇制药	332,311.89	5.70
102	688690	纳微科技	329,435.10	5.65
103	605336	帅丰电器	328,829.72	5.64
104	688280	精进电动	328,126.70	5.63
105	600036	招商银行	325,140.00	5.58
106	301127	天源环保	324,931.21	5.57

107	601166	兴业银行	322,689.00	5.53
108	002384	东山精密	321,279.00	5.51
109	600031	三一重工	319,662.00	5.48
110	002812	恩捷股份	314,748.00	5.40
111	002923	润都股份	313,251.00	5.37
112	600030	中信证券	311,324.00	5.34
113	002268	卫士通	308,657.00	5.29
114	000625	长安汽车	297,172.00	5.10
115	603883	老百姓	295,892.00	5.07
116	301100	风光股份	294,976.00	5.06
117	688575	亚辉龙	289,850.31	4.97
118	301033	迈普医学	282,775.00	4.85
119	002675	东诚药业	280,561.00	4.81
120	300997	欢乐家	272,129.68	4.67
121	300825	阿尔特	269,958.00	4.63
122	300968	格林精密	269,154.06	4.62
123	600580	卧龙电驱	266,968.00	4.58
124	301096	百诚医药	266,660.00	4.57
125	300438	鹏辉能源	264,730.50	4.54
126	002991	甘源食品	264,323.00	4.53
127	002946	新乳业	263,179.00	4.51
128	600089	特变电工	257,276.00	4.41
129	688314	康拓医疗	251,140.10	4.31
130	000858	五粮液	248,442.00	4.26
131	002291	星期六	247,511.00	4.24
132	000002	万科A	246,697.00	4.23
133	603517	绝味食品	245,670.00	4.21
134	600887	伊利股份	245,453.00	4.21
135	601688	华泰证券	244,500.00	4.19
136	688789	宏华数科	244,356.00	4.19
137	002557	洽洽食品	243,977.00	4.18

138	688206	概伦电子	241,200.00	4.14
139	002202	金风科技	240,842.00	4.13
140	688276	百克生物	238,177.36	4.08
141	301035	润丰股份	234,767.49	4.03
142	002456	欧菲光	233,364.00	4.00
143	301166	优宁维	233,267.00	4.00
144	301009	可靠股份	232,789.53	3.99
145	301221	光庭信息	230,969.64	3.96
146	688777	中控技术	230,424.18	3.95
147	600529	山东药玻	230,127.00	3.95
148	300953	震裕科技	229,884.75	3.94
149	301011	华立科技	228,397.25	3.92
150	301108	洁雅股份	227,968.18	3.91
151	600010	包钢股份	227,266.00	3.90
152	300294	博雅生物	224,078.00	3.84
153	301189	奥尼电子	224,043.00	3.84
154	603993	洛阳钼业	220,920.00	3.79
155	000860	顺鑫农业	220,265.00	3.78
156	000403	派林生物	219,878.00	3.77
157	601155	新城控股	219,797.00	3.77
158	301002	崧盛股份	219,049.82	3.76
159	000069	华侨城 A	219,000.00	3.76
160	301082	久盛电气	217,808.00	3.73
161	300832	新产业	217,744.70	3.73
162	000728	国元证券	217,095.00	3.72
163	600705	中航资本	216,809.00	3.72
164	600536	中国软件	216,379.00	3.71
165	600048	保利地产	213,395.00	3.66
166	301101	明月镜片	212,148.00	3.64
167	688561	奇安信	211,571.00	3.63
168	002833	弘亚数控	210,742.00	3.61

169	300529	健帆生物	208,447.00	3.57
170	300986	志特新材	207,524.24	3.56
171	300454	深信服	205,826.00	3.53
172	300136	信维通信	203,498.00	3.49
173	301018	C申菱	203,236.65	3.48
174	688776	国光电气	202,778.00	3.48
175	301149	隆华新材	202,094.00	3.47
176	601077	渝农商行	200,822.00	3.44
177	301190	善水科技	198,730.00	3.41
178	002463	沪电股份	198,098.20	3.40
179	301006	迈拓股份	197,469.01	3.39
180	600196	复星医药	195,512.00	3.35
181	688345	博力威	193,899.54	3.32
182	002212	天融信	190,490.00	3.27
183	301093	华兰股份	190,260.89	3.26
184	600177	雅戈尔	190,252.00	3.26
185	600233	圆通速递	189,626.00	3.25
186	688087	英科再生	189,372.30	3.25
187	600066	宇通客车	187,983.00	3.22
188	688601	力芯微	187,601.94	3.22
189	688117	圣诺生物	185,500.76	3.18
190	301088	戎美股份	184,618.36	3.17
191	002399	海普瑞	183,737.00	3.15
192	688383	新益昌	182,317.00	3.13
193	600487	亨通光电	179,850.00	3.08
194	688621	阳光诺和	179,493.88	3.08
195	600068	葛洲坝	178,755.00	3.07
196	600585	海螺水泥	178,680.00	3.06
197	002931	锋龙股份	177,361.00	3.04
198	002049	紫光国微	177,008.00	3.04
199	688800	瑞可达	176,264.98	3.02

200	600369	西南证券	176,225.00	3.02
201	688626	翔宇医疗	176,043.85	3.02
202	688767	博拓生物	175,777.23	3.01
203	688169	石头科技	175,602.00	3.01
204	600763	通策医疗	175,380.00	3.01
205	301015	百洋医药	175,252.02	3.01
206	000568	泸州老窖	173,799.00	2.98
207	300685	艾德生物	172,346.00	2.96
208	600900	长江电力	171,241.00	2.94
209	301058	中粮工科	170,215.00	2.92
210	301026	浩通科技	169,241.28	2.90
211	600637	东方明珠	169,208.00	2.90
212	688265	南模生物	167,865.80	2.88
213	601198	东兴证券	167,081.00	2.86
214	301185	鸥玛软件	165,608.28	2.84
215	600521	华海药业	164,638.00	2.82
216	300978	东箭科技	164,276.07	2.82
217	688613	奥精医疗	163,285.19	2.80
218	601328	交通银行	162,837.00	2.79
219	688305	科德数控	161,926.20	2.78
220	002508	老板电器	161,533.50	2.77
221	600271	航天信息	161,230.00	2.76
222	688285	高铁电气	161,150.48	2.76
223	000876	新希望	160,130.00	2.75
224	300958	建工修复	158,712.38	2.72
225	600606	绿地控股	157,746.00	2.70
226	002739	万达电影	157,740.00	2.70
227	601117	中国化学	156,410.00	2.68
228	301091	深城交	156,112.00	2.68
229	300961	深水海纳	155,773.82	2.67
230	688091	上海谊众	155,601.84	2.67

231	301168	通灵股份	154,092.00	2.64
232	301179	泽宇智能	153,558.00	2.63
233	301069	凯盛新材	153,292.00	2.63
234	601009	南京银行	153,184.00	2.63
235	688016	心脉医疗	152,624.00	2.62
236	600085	同仁堂	151,353.00	2.60
237	600498	烽火通信	150,480.00	2.58
238	688711	宏微科技	150,318.15	2.58
239	301199	迈赫股份	149,976.00	2.57
240	603233	大参林	149,865.00	2.57
241	300967	晓鸣股份	149,600.19	2.57
242	300996	普联软件	148,468.85	2.55
243	000627	天茂集团	148,302.00	2.54
244	301118	恒光股份	148,231.00	2.54
245	300748	金力永磁	147,718.00	2.53
246	688667	菱电电控	147,502.50	2.53
247	001209	洪兴股份	146,778.74	2.52
248	002352	顺丰控股	146,146.00	2.51
249	688269	凯立新材	145,613.82	2.50
250	300962	中金辐照	144,553.42	2.48
251	301126	达嘉维康	143,888.66	2.47
252	603156	养元饮品	143,827.00	2.47
253	000063	中兴通讯	143,397.00	2.46
254	301078	孩子王	143,222.00	2.46
255	688216	气派科技	143,194.00	2.46
256	605499	东鹏饮料	142,908.16	2.45
257	600118	中国卫星	142,814.00	2.45
258	002497	雅化集团	141,550.00	2.43
259	600390	五矿资本	141,390.00	2.42
260	688630	芯碁微装	140,791.50	2.41
261	600104	上汽集团	140,624.00	2.41

262	601211	国泰君安	139,705.00	2.40
263	300955	嘉亨家化	139,107.04	2.39
264	600919	江苏银行	138,866.00	2.38
265	300987	川网传媒	138,636.81	2.38
266	688396	华润微	138,294.00	2.37
267	300993	玉马遮阳	138,250.60	2.37
268	000831	五矿稀土	138,140.00	2.37
269	601668	中国建筑	137,974.00	2.37
270	688227	品高股份	137,037.24	2.35
271	601825	沪农商行	136,688.40	2.34
272	688511	天微电子	136,335.00	2.34
273	300991	创益通	135,397.35	2.32
274	002673	西部证券	135,171.00	2.32
275	002624	完美世界	135,059.00	2.32
276	688609	九联科技	134,990.24	2.31
277	002153	石基信息	134,405.00	2.30
278	301198	喜悦智行	134,306.00	2.30
279	600848	上海临港	132,510.80	2.27
280	000723	美锦能源	131,681.00	2.26
281	301013	利和兴	131,540.58	2.26
282	603859	能科股份	131,456.00	2.25
283	600004	白云机场	130,680.00	2.24
284	300975	商络电子	130,506.36	2.24
285	600208	新湖中宝	130,415.00	2.24
286	601872	招商轮船	129,605.00	2.22
287	688697	纽威数控	128,989.59	2.21
288	300614	百川畅银	128,864.05	2.21
289	603259	药明康德	126,773.00	2.17
290	002050	三花智控	125,820.00	2.16
291	603939	益丰药房	125,624.00	2.15
292	002939	长城证券	124,554.00	2.14

293	301182	凯旺科技	123,688.00	2.12
294	002179	中航光电	123,425.00	2.12
295	300982	苏文电能	123,249.60	2.11
296	000656	金科股份	123,144.00	2.11
297	603707	健友股份	122,992.00	2.11
298	301028	东亚机械	122,182.00	2.10
299	002987	京北方	121,938.00	2.09
300	000768	中航西飞	121,890.00	2.09
301	300985	致远新能	121,873.50	2.09
302	300971	博亚精工	121,631.50	2.09
303	603520	司太立	121,023.00	2.08
304	600837	海通证券	119,772.00	2.05
305	688456	有研粉材	119,677.20	2.05
306	600297	广汇汽车	119,000.00	2.04
307	688799	华纳药厂	118,834.83	2.04
308	688316	青云科技	118,126.00	2.03
309	000961	中南建设	117,559.00	2.02
310	688787	海天瑞声	117,393.00	2.01
311	688682	霍莱沃	117,285.08	2.01
312	603429	集友股份	117,280.00	2.01
313	301021	C英诺	117,246.13	2.01

#### 8.4.3 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	280,979,342.83
卖出股票收入（成交）总额	133,681,815.45

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-



2	央行票据	-	-
3	金融债券	294,567,000.00	29.19
	其中：政策性金融债	294,567,000.00	29.19
4	企业债券	76,350,500.00	7.56
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,201,681.40	0.12
8	同业存单	39,316,000.00	3.90
9	其他	-	-
10	合计	411,435,181.40	40.76

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	210203	21国开03	700,000	71,477,000.00	7.08
2	210205	21国开05	600,000	62,424,000.00	6.18
3	210202	21国开02	500,000	50,450,000.00	5.00
4	155367	19中林03	475,000	47,091,500.00	4.67
5	210206	21国开06	400,000	40,028,000.00	3.97

### 8.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

报告期内未投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：

- ( 1) 本基金本报告期末未持有国债期货。
- ( 2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

### 8.12.3 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	27,703.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,724,833.66
5	应收申购款	809.10

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,753,346.39

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 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 沃嘉A 级	222	2,569,546.24	568,953,800.31	99.74%	1,485,464.21	0.26%
中科 沃土 沃嘉C 级	322	784,524.14	252,030,075.52	99.77%	586,696.33	0.23%
合计	544	1,512,970.66	820,983,875.83	99.75%	2,072,160.54	0.25%

#### 9.2 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	占基金总份额比
----	------	--------	---------

		(份)	例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中科沃土沃嘉A级	0.00	0.00%
	中科沃土沃嘉C级	8.79	0.00%
	合计	8.79	0.00%

### 9.3 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	中科沃土沃嘉A级	0
	中科沃土沃嘉C级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中科沃土沃嘉A级	0
	中科沃土沃嘉C级	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	中科沃土沃嘉混合A	中科沃土沃嘉混合C
基金合同生效日(2017年12月06日)基金份额总额	32,667,493.83	172,494,778.28
本报告期期初基金份额总额	3,040,214.66	2,019,511.44
本报告期基金总申购份额	1,467,491,270.49	252,897,261.93
减：本报告期基金总赎回份额	900,092,220.63	2,300,001.52
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	570,439,264.52	252,616,771.85

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

## 11.2 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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 11.3 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。

## 11.4 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。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内为基金进行审计的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙),本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙),审计费用 60,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期末，公司收到中国证券监督管理委员会广东监管局对我司采取的监管措施，公司按照监管要求积极整改。本报告期内，托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
华创证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	384,856,548.26	100.00%	281,445.67	100.00%	-

### 11.7.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	87,376,022.71	100.00%	11,376,518,000.00	100.00%	-	-	-	-

#### 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。

### 11.8 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	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	公司网站、证券日报	2021-02-05
2	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新（C类份额）	公司网站、证券日报	2021-03-17

3	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新(A类份额)	公司网站、证券日报	2021-03-17
4	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	公司网站、证券日报	2021-04-09
5	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新(中科沃土沃嘉混合C份额)	公司网站、证券日报	2021-04-10
6	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新(中科沃土沃嘉混合A份额)	公司网站、证券日报	2021-04-10
7	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	公司网站、证券日报	2021-04-10
8	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金2021年第一季度报告	公司网站、证券日报	2021-04-21
9	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	公司网站、证券日报	2021-04-27
10	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金(中科沃土沃嘉混合C份额)基金产品资料概要更新	公司网站、证券日报	2021-04-29
11	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金(中科沃土沃嘉混合A份额)基金产品资料概要更新	公司网站、证券日报	2021-04-29
12	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	公司网站、证券日报	2021-04-29

13	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金2021年第二季度报告	公司网站、证券日报	2021-07-20
14	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金2021年中期报告	公司网站、证券日报	2021-08-31
15	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金2021年第三季度报告	公司网站、证券日报	2021-10-27

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20210113-20211128	-	253,613,043.38	253,613,043.38	-	-
	2	20210113-20210117 20210122-20211125	-	215,075,716.75	215,075,716.75	-	-
	3	20210112-20211125 20211129-20211206	-	214,692,939.06	214,692,939.06	-	-
	4	20210112-202111206	-	214,692,939.06	214,692,939.06	-	-
	5	20211130-202111231	-	206,973,253.90	-	206,973,253.90	25.1469%
	6	20211126-202111231	-	206,866,013.62	-	206,866,013.62	25.1339%
个人	1	20210105-20210111	994,687.84	0.00	0.00	994,687.84	0.1209%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p>							



## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
2. 《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
5. 关于申请募集注册中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书；
6. 中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 13.3 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  
二〇二二年三月三十一日