

中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:中科沃土基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日至2022年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§8 基金份额持有人信息	59

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	59
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	60
§9 开放式基金份额变动	60
§10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息	64
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	64
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	中科沃土沃瑞混合发起	
基金主代码	005855	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年01月14日	
基金管理人	中科沃土基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	38,312,325.92份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中科沃土沃瑞混合发起A	中科沃土沃瑞混合发起C
下属分级基金的交易代码	005855	005856
报告期末下属分级基金的份额总额	23,338,926.79份	14,973,399.13份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过系统化的方法精选环境、财务可持续的上市公司，通过精选个股和风险控制，力争为投资者创造超越业绩比较基准的回报。
投资策略	通过对经济周期及资产价格发展变化的理解，在把握经济周期性波动的基础上，动态评估不同资产类在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置及资产的稳健增长。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数(全价)收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中科沃土基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曹萍	陆志俊
	联系电话	0757-86208608	95559
	电子邮箱	caoping@richlandasm.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-018-3610	95559
传真		0757-86208604	021-62701216
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）	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188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）	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		528200	200336
法定代表人		智会杰	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.richlandasm.com.cn
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日-2022年06月30日)	
	中科沃土沃瑞混合 发起A	中科沃土沃瑞混合 发起C
本期已实现收益	-4,660,819.91	-4,647,734.43
本期利润	-4,654,968.62	-5,034,031.17
加权平均基金份额本期利润	-0.1836	-0.2737
本期加权平均净值利润率	-6.06%	-9.16%
本期基金份额净值增长率	-4.81%	-5.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	40,584,285.74	25,322,772.16
期末可供分配基金份额利润	1.7389	1.6912
期末基金资产净值	72,468,705.83	45,722,798.73
期末基金份额净值	3.1051	3.0536
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	210.51%	205.36%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中科沃土沃瑞混合发起A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.89%	1.51%	5.68%	0.64%	-4.79%	0.87%
过去三个月	4.74%	1.48%	3.85%	0.86%	0.89%	0.62%
过去六个月	-4.81%	1.17%	-5.38%	0.87%	0.57%	0.30%
过去一年	4.48%	1.06%	-7.76%	0.75%	12.24%	0.31%
过去三年	197.22%	1.37%	11.75%	0.76%	185.47%	0.61%
自基金合同 生效起至今	210.51%	1.31%	28.22%	0.78%	182.29%	0.53%

中科沃土沃瑞混合发起C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.84%	1.51%	5.68%	0.64%	-4.84%	0.87%
过去三个月	4.59%	1.48%	3.85%	0.86%	0.74%	0.62%
过去六个月	-5.25%	1.16%	-5.38%	0.87%	0.13%	0.29%
过去一年	3.83%	1.06%	-7.76%	0.75%	11.59%	0.31%
过去三年	193.36%	1.37%	11.75%	0.76%	181.61%	0.61%
自基金合同 生效起至今	205.36%	1.31%	28.22%	0.78%	177.14%	0.53%

注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中科沃土沃瑞混合发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年01月14日-2022年06月30日)



中科沃土沃瑞混合发起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
(2019年01月14日-2022年06月30日)



注：本基金合同于 2019 年 1 月 14 日生效，按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中科沃土基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2015]1937号文批准，于2015年9月6日正式成立，注册资本2.42亿元，是国内第100家公募基金管理公司，也是一家拥有PE背景的公募基金管理公司。中科沃土带着中科招商、粤科金融等主要股东强大的精神基因和优秀的文化基因，始终贯彻“持有人利益至上”的首要经营原则，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2022年6月30日，中科沃土旗下共管理6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和中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金。

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		
林皓	权益投资部基金经理	2019-11-08	2022-03-01	6年	学硕士。曾任中科沃土基金管理有限公司研究部研究员，现任中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
徐伟	基金经理、权益投资部总经理助理（主持工作）	2022-03-01	-	11年	工学硕士，曾任宏源证券研究所分析师，中信建投证券研究发展部首席分析师，上海磐信投资有限公司金融市场部高级研究员，中科沃土基金管理有

					限公司研究部资深研究员，现任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基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

注：1. 此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，“任职日期”为公告确定的聘任日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

2022年二季度初，国内部分经济发达地区的防疫形势较严峻，对经济的影响不仅局限在服务业，也开始波及到制造业。5月之后全国生产生活开始恢复正常，同时国家稳经济的一揽子措施加快落地，财政政策加大实施力度，主要经济指标有了边际改善。但因为居民部门对未来收入的预期偏悲观，导致二季度的消费增长还是受到较大抑制。

投资方面受到房地产投资下滑的拖累，整体上也不乐观。受益于能源等方面的成本比较优势，5、6月外贸出口增长强劲，成为目前拉动经济增长最重要的积极因素。

2022年上半年，海外发达经济体因为大宗商品、食品与工资的大幅度上涨导致CPI持续高企，导致欧美货币政策收紧力度持续加强，美联储在6、7月份连续加息75个基点，加息速度加快，抑制了海外总需求的增长，市场开始预期海外发达经济体2023年开始衰退，与此同时我们也观察到了海外的能源消费已经出现了负反馈的现象，上述因素导致了以原油为代表的大宗商品价格开始出现大幅度下跌。

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瑞混合发起A基金份额净值为3.1051元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.81%，同期业绩比较基准收益率为-5.38%；截至报告期末中科沃土沃瑞混合发起C基金份额净值为3.0536元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.25%，同期业绩比较基准收益率为-5.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从2021年底开始，中央政府多次提出要加强稳增长的力度，在上半年经济运行受到疫情影响较大的背景下，我们预计财政政策将继续发力，充分发挥托底作用，基建作为稳定经济增长的关键抓手，投资力度将进一步加大，地方政府专项债也可能会进一步前置，我们也将密切关注这方面的边际变化。同时由于国内的能源及中间产品价格显著低于国外价格，中国的制造业相对竞争力进一步加强，从而提升中国在全球贸易中的份额，预计中国的外贸顺差还能维持较高的增速。但是下半年经济复苏的基础还不稳固，整体上看下半年经济运行仍然面临较大不确定性。

国内CPI在三季度虽然可能会因为猪肉价格上涨而出现同比上升的压力，但其他分项的涨幅会比较小；而得益于国内卓有成效的上游大宗商品保供措施（以煤炭为典型代表），预计国内下半年PPI的同比增速会下降比较快；因此我们认为国内在下半年仍然维持较为宽松的货币政策。信贷政策上，预计房地产信贷调控政策可能边际上有所放松，对实体经济发展的也会给予更大的支持。

国家继续稳步推进金融改革，大幅提高了对股票欺诈发行、信息披露造假等金融证券犯罪的处罚力度，还开始逐步明确中介机构的责任，为资本市场的健康发展创造了良好的法律环境，资本市场在未来中国转型升级中将承担更为重要的角色，并将继续获得政策层面的大力支持。在前述宏观经济状况下，我们在二季度的投资策略中，提高了股票仓位水平，行业配置较为均衡，估值较为合理。精选优质公司，分享公司的业绩增长也仍然是我们投资组合的核心策略。我们希望通过较长期持有权益市场上的优质标的，为投资者创造价值。在2022年下半年的投资策略中，我们将重点关注与宏观经济关系较小的成长性较好的行业与公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人按照相关法律法规、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，定期对估值政策和程序进行评价。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

基金日常估值由运营科技部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责对基金估值程序和方法进行核查，确保估值相关各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关固定收益品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，无相关预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,607,919.71	21,894,149.61
结算备付金		4,606,201.89	8,509,835.60
存出保证金		2,348,705.32	378,952.48
交易性金融资产	6.4.7.2	94,558,802.16	110,183,372.58
其中：股票投资		94,448,994.91	109,862,372.58
基金投资		-	-
债券投资		109,807.25	321,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	7,000,000.00	30,000,000.00
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-

其他权益工具投资		-	-
应收清算款		801,132.60	-
应收股利		-	-
应收申购款		148,581.78	339,529.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-641.99
资产总计		120,071,343.46	171,305,198.18
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	11,518,650.14
应付赎回款		1,543,100.76	2,081,045.04
应付管理人报酬		148,567.76	218,201.19
应付托管费		24,761.29	36,366.87
应付销售服务费		31,052.62	63,233.94
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.31	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	132,356.16	612,852.47
负债合计		1,879,838.90	14,530,349.65
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	38,312,325.92	48,359,492.15
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	79,879,178.64	108,415,356.38
净资产合计		118,191,504.56	156,774,848.53
负债和净资产总计		120,071,343.46	171,305,198.18

注：报告截止日2022年6月30日，中科沃土沃瑞混合发起A基金份额净值3.1051元，基金份额总额23,338,926.79份；中科沃土沃瑞混合发起C基金份额净值3.0536元，基金份额总额14,973,399.13份。中科沃土沃瑞混合发起份额总额合计为 38,312,325.92份。

6.2 利润表

会计主体：中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日 至2022年06月30 日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		-8,221,833.88	29,742,109.52
1. 利息收入		392,194.98	172,990.92
其中：存款利息收入	6.4.7.9	180,592.95	54,888.07
债券利息收入		-	14,425.83
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		211,602.03	103,677.02
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-8,995,672.67	20,508,056.06
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-11,434,057.40	20,560,675.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	42,476.93	32,998.15
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	636,506.84	-280,765.84
股利收益	6.4.7.15	1,759,400.96	195,148.38

以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-380,445.45	8,698,438.81
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	762,089.26	362,623.73
减：二、营业总支出		1,467,165.91	3,756,181.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	986,512.10	484,994.00
2. 托管费	6.4.10.2.2	164,418.67	80,832.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	221,533.52	106,932.71
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		1,149.74	236.73
8. 其他费用	6.4.7.18	93,551.88	3,083,186.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,688,999.79	25,985,927.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,688,999.79	25,985,927.57
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-9,688,999.79	25,985,927.57

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	48,359,492.15	-	108,415,356.38	156,774,848.53
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	48,359,492.15	-	108,415,356.38	156,774,848.53
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-10,047,166.23	-	-28,536,177.74	-38,583,343.97
(一)、综合收益总额	-	-	-9,688,999.79	-9,688,999.79
(二)、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)	-10,047,166.23	-	-18,847,177.95	-28,894,344.18
其中：1. 基金申购款	47,431,730.70	-	98,458,437.86	145,890,168.56
2. 基金赎回款	-57,478,896.93	-	-117,305,615.81	-174,784,512.74
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收	-	-	-	-

益结转留存收益				
四、本期期末净资产 (基金净值)	38,312,325.92	-	79,879,178.64	118,191,504.56
项 目	上 年 度 可 比 期 间			
	2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	28,138,944.20	-	34,453,974.32	62,592,918.52
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	28,138,944.20	-	34,453,974.32	62,592,918.52
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	105,016,259.85	-	225,386,363.07	330,402,622.92
(一)、综合收益总额	-	-	25,985,927.57	25,985,927.57
(二)、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)	105,016,259.85	-	199,400,435.50	304,416,695.35
其中：1. 基金申购款	138,120,242.99	-	249,338,296.17	387,458,539.16
2. 基金赎回款	-33,103,983.14	-	-49,937,860.67	-83,041,843.81
(三)、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)	-	-	-	-

(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	133,155,204.05	-	259,840,337.39	392,995,541.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]第 590 号《关于准予中科沃土沃瑞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《中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式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10,472,931.26元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)(瑞华)验字第(2019)48090001号验证报告予以验证。经向中国证监会备案,《中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2019年1月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为10,478,812.69份基金份额,其中认购资金利息折合5,881.43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,基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

据《中科沃土沃瑞灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据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。在投资人申购时收取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《中科沃土沃瑞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)、股指期货、国债期货、权证、债券(包括但不限于国债、地方政府债、

金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×60%+中债综合全价(总值)指数收益率×40%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、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》、《中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。除下述会计政策外,本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资

产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段和金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

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(对于贴现债为按发

行价计算的利率)或合同利率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投资收益。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投资收益。

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扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益,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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

6.4.4.4 费用的确认和计量

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《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》及《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”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外, 财政部于2022年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14号), 本基金的的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定, 本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额, 2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日, 本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于2022年1月1日, 本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息和应收申购款, 金额分别为21,894,149.61元、8,509,835.60元、378,952.48元、30,000,000.00元、-641.99元和339,529.90元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收申购款, 金额分别为21,900,595.64元、8,510,643.55元、379,140.03元、29,991,909.44元、0.00元和339,529.90元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为110,183,372.58元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为110,183,379.62元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款, 金额分别为11,518,650.14元、2,081,045.04元、218,201.19元、36,366.87元、63,233.94元、492,236.40元和616.07元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款, 金额分别为11,518,650.14元、2,081,045.04元、218,201.19元、36,366.87元、63,233.94元、492,236.40元和616.07元。

于2021年12月31日, 本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日, 本基金根据新金融工具准则下的计量类别, 将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示, 无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	10,607,919.71
等于：本金	10,604,900.44
加：应计利息	3,019.27
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	10,607,919.71

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		89,453,498.08	-	94,448,994.91	4,995,496.83
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	98,000.00	8.05	109,807.25	11,799.20
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	98,000.00	8.05	109,807.25	11,799.20
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		89,551,498.08	8.05	94,558,802.16	5,007,296.03

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目		本期末 2022年06月30日			
		合同/名义金额	公允价值		备注
			资产	负债	
利率衍生工具		-	-	-	
货币衍生工具		-	-	-	
权益衍生工具		17,179,500.00	-	-	
--股指期货		17,179,500.00	-	-	
其他衍生工具		-	-	-	
合计		17,179,500.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2209	沪深300股指期货2209合约	-14.00	-18,678,240.00	-1,498,740.00
合计				-1,498,740.00
减：可抵销期货暂收款				-1,498,740.00
净额				-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	7,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本报告期末本基金无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	874.14
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	40,777.14
其中：交易所市场	40,777.14
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	59,835.79
预提费用-信息披露费	30,869.09
合计	132,356.16

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 中科沃土沃瑞混合发起A

金额单位：人民币元

项目 (中科沃土沃瑞混合发起A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	23,429,379.84	23,429,379.84
本期申购	25,456,252.10	25,456,252.10
本期赎回(以“-”号填列)	-25,546,705.15	-25,546,705.15
本期末	23,338,926.79	23,338,926.79

6.4.7.7.2 中科沃土沃瑞混合发起C

金额单位：人民币元

项目 (中科沃土沃瑞混合发起C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	24,930,112.31	24,930,112.31
本期申购	21,975,478.60	21,975,478.60
本期赎回(以“-”号填列)	-31,932,191.78	-31,932,191.78
本期末	14,973,399.13	14,973,399.13

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 中科沃土沃瑞混合发起A

单位：人民币元

项目 (中科沃土沃瑞混合发起A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	45,159,993.19	7,837,572.77	52,997,565.96
本期利润	-4,660,819.91	5,851.29	-4,654,968.62
本期基金份额交易产生的变动数	85,112.46	702,069.24	787,181.70
其中：基金申购款	46,160,290.14	7,584,773.79	53,745,063.93
基金赎回款	-46,075,177.68	-6,882,704.55	-52,957,882.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,584,285.74	8,545,493.30	49,129,779.04

6.4.7.8.2 中科沃土沃瑞混合发起C

单位：人民币元

项目 (中科沃土沃瑞混合发起C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	47,155,255.58	8,262,534.84	55,417,790.42
本期利润	-4,647,734.43	-386,296.74	-5,034,031.17
本期基金份额交易产生的变动数	-17,184,748.99	-2,449,610.66	-19,634,359.65
其中：基金申购款	38,164,146.25	6,549,227.68	44,713,373.93
基金赎回款	-55,348,895.24	-8,998,838.34	-64,347,733.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,322,772.16	5,426,627.44	30,749,399.60

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	117,855.47
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	61,121.73
其他	1,615.75
合计	180,592.95

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	331,688,505.83
减：卖出股票成本总额	342,251,017.78
减：交易费用	871,545.45
买卖股票差价收入	-11,434,057.40

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	34.48
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	42,442.45
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	42,476.93

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	363,476.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	321,000.00
减：应计利息总额	33.77
减：交易费用	0.38
买卖债券差价收入	42,442.45

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2022年01月01日至2022年06月30日
期货投资	636,506.84

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,759,400.96
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	1,759,400.96

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	1,118,294.55
——股票投资	1,106,495.35
——债券投资	11,799.20
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-1,498,740.00
——权证投资	-
——期货投资	-1,498,740.00
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	-380,445.45

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	762,047.75
转换费收入	41.51
合计	762,089.26

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。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	70,869.09
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,847.00
合计	93,551.88

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中科沃土基金管理有限公司（“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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	交通银行股份有限公司（“交通银行”）

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	986,512.10	484,994.00
其中：支付销售机构的客户维护费	310,353.15	147,365.43

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1.50%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 × 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	164,418.67	80,832.34

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃瑞混合发起A	中科沃土沃瑞混合发起C	合计
中科沃土基金	0.00	11,182.00	11,182.00
交通银行股份有限公司	0.00	9,333.73	9,333.73
合计	0.00	20,515.73	20,515.73
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃瑞混合发起A	中科沃土沃瑞混合发起C	合计
中科沃土基金	0.00	10,577.30	10,577.30
合计	0.00	10,577.30	10,577.30

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0.80%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 0.80%/ 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金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。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中科沃土沃瑞混合发起A

关联方名称	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广州西拓投资合伙企业（有限合伙）	0.00	0.00%	8,003,602.74	16.55%

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	10,607,919.71	117,855.47	75,063,262.80	32,820.86

公司				
----	--	--	--	--

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
600938	中国海油	2022-04-14	6个月	新股锁定	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688348	昱能科技	2022-05-31	6个月	科创板打新限售	163.00	416.57	470	76,610.00	195,787.90	-
688400	凌云光	2022-06-27	7个交易日	新股未上市	21.93	21.93	2,034	44,605.62	44,605.62	-

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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资部门负责人和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、合规稽核部、风险管理部、集中交易部和基金事务部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

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

6.4.13.2 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交通银行，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。

截至2022年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.09%。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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债券投资。

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	109,807.25	321,000.00
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	109,807.25	321,000.00

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.5 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未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 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未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，合规稽核部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金 2022 年中期报告

2022年06月30日					
资产					
银行存款	10,607,919.71	-	-	-	10,607,919.71
结算备付金	773,518.42	-	-	3,832,683.47	4,606,201.89
存出保证金	2,348,705.32	-	-	-	2,348,705.32
交易性金融资产	-	109,807.25	-	94,448,994.91	94,558,802.16
买入返售金融资产	7,000,000.00	-	-	-	7,000,000.00
应收清算款	-	-	-	801,132.60	801,132.60
应收申购款	-	-	-	148,581.78	148,581.78
资产总计	20,730,143.45	109,807.25	-	99,231,392.76	120,071,343.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,543,100.76	1,543,100.76
应付管理人报酬	-	-	-	148,567.76	148,567.76
应付托管费	-	-	-	24,761.29	24,761.29
应付销售服务费	-	-	-	31,052.62	31,052.62
应交税费	-	-	-	0.31	0.31
其他负债	-	-	-	132,356.16	132,356.16
负债总计	-	-	-	1,879,838.90	1,879,838.90
利率敏感度缺口	20,730,143.45	109,807.25	-	97,351,553.86	118,191,504.56
上年度末 2021年1	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金 2022 年中期报告

2月31日					
资产					
银行存款	21,894,149.61	-	-	-	21,894,149.61
结算备付金	8,509,835.60	-	-	-	8,509,835.60
存出保证金	378,952.48	-	-	-	378,952.48
交易性金融资产	-	-	321,000.00	109,862,372.58	110,183,372.58
买入返售金融资产	30,000,000.00	-	-	-	30,000,000.00
应收利息	-	-	-	-641.99	-641.99
应收申购款	-	-	-	339,529.90	339,529.90
资产总计	60,782,937.69	-	321,000.00	110,201,260.49	171,305,198.18
负债					
应付证券清算款	-	-	-	11,518,650.14	11,518,650.14
应付赎回款	-	-	-	2,081,045.04	2,081,045.04
应付管理人报酬	-	-	-	218,201.19	218,201.19
应付托管费	-	-	-	36,366.87	36,366.87
应付销售服务费	-	-	-	63,233.94	63,233.94
应付交易费用	-	-	-	492,236.40	492,236.40
其他负债	-	-	-	120,616.07	120,616.07
负债总计	-	-	-	14,530,349.65	14,530,349.65
利率敏感度缺口	60,782,937.69	-	321,000.00	95,670,910.84	156,774,848.53

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年6月30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0.1%(2021年12月31日：0.2%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021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	94,448,994.91	79.91	109,862,372.58	70.08
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	94,448,994.91	79.91	109,862,372.58	70.08

6.4.13.4.3.2 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	2,317,052.52	4,158,416.70
	业绩比较基准下降5%	-2,317,052.52	-4,158,416.70

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	92,986,105.20	109,244,716.61
第二层次	44,605.62	375,243.27
第三层次	1,528,091.34	563,412.70
合计	94,558,802.16	110,183,372.58

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	94,448,994.91	78.66
	其中：股票	94,448,994.91	78.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	109,807.25	0.09
	其中：债券	109,807.25	0.09
	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	7,000,000.00	5.83

	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	15,214,121.60	12.67
8	其他各项资产	3,298,419.70	2.75
9	合计	120,071,343.46	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	43,286,756.93	36.62
C	制造业	13,790,621.98	11.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,102,282.00	3.47
E	建筑业	4,723,600.00	4.00
F	批发和零售业	4,086,600.00	3.46
G	交通运输、仓储和邮政业	2,445,819.00	2.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,460,800.00	1.24
J	金融业	8,990,939.00	7.61
K	房地产业	10,872,776.00	9.20
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	688,800.00	0.58
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	94,448,994.91	79.91

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	600188	兖州煤业	204,300	8,065,764.00	6.82
2	601088	中国神华	175,000	5,827,500.00	4.93
3	000983	山西焦煤	360,000	4,820,400.00	4.08
4	601225	陕西煤业	200,000	4,236,000.00	3.58
5	600546	山煤国际	210,000	4,086,600.00	3.46
6	000933	神火股份	310,000	4,054,800.00	3.43
7	600048	保利地产	225,000	3,928,500.00	3.32
8	600123	兰花科创	220,000	3,619,000.00	3.06
9	601699	潞安环能	240,000	3,508,800.00	2.97
10	600383	金地集团	225,900	3,036,096.00	2.57
11	601398	工商银行	600,000	2,862,000.00	2.42
12	600938	中国海油	154,905	2,569,525.89	2.17
13	600395	盘江股份	280,000	2,455,600.00	2.08
14	600328	中盐化工	102,100	2,404,455.00	2.03
15	002142	宁波银行	62,000	2,220,220.00	1.88
16	601985	中国核电	320,000	2,195,200.00	1.86
17	000937	冀中能源	260,000	1,939,600.00	1.64
18	600985	淮北矿业	130,000	1,892,800.00	1.60
19	600926	杭州银行	95,000	1,423,100.00	1.20
20	601166	兴业银行	65,000	1,293,500.00	1.09
21	601857	中国石油	240,000	1,272,000.00	1.08
22	601618	中国中冶	350,000	1,225,000.00	1.04
23	605090	九丰能源	54,000	1,094,580.00	0.93

24	601669	中国电建	130,000	1,023,100.00	0.87
25	601898	中煤能源	90,000	934,200.00	0.79
26	600438	通威股份	15,000	897,900.00	0.76
27	002244	滨江集团	100,000	865,000.00	0.73
28	600256	广汇能源	80,000	843,200.00	0.71
29	002594	比亚迪	2,500	833,725.00	0.71
30	601800	中国交建	80,000	742,400.00	0.63
31	600028	中国石化	180,000	734,400.00	0.62
32	603357	设计总院	60,000	688,800.00	0.58
33	000860	顺鑫农业	25,000	670,500.00	0.57
34	002507	涪陵榨菜	19,000	655,880.00	0.55
35	601868	中国能建	270,000	639,900.00	0.54
36	002555	三七互娱	30,000	636,900.00	0.54
37	601009	南京银行	60,000	625,200.00	0.53
38	601006	大秦铁路	90,000	593,100.00	0.50
39	002532	天山铝业	90,000	587,700.00	0.50
40	601390	中国中铁	90,000	552,600.00	0.47
41	601816	京沪高铁	110,000	552,200.00	0.47
42	000402	金融街	80,000	476,000.00	0.40
43	002208	合肥城建	50,000	448,000.00	0.38
44	600657	信达地产	62,000	427,180.00	0.36
45	600050	中国联通	120,000	415,200.00	0.35
46	600026	中远海能	40,000	413,200.00	0.35
47	000807	云铝股份	40,000	395,200.00	0.33
48	600266	城建发展	90,000	367,200.00	0.31
49	300888	稳健医疗	5,000	332,500.00	0.28
50	600875	东方电气	20,000	329,000.00	0.28
51	600406	国电南瑞	12,000	324,000.00	0.27
52	601233	桐昆股份	20,000	317,600.00	0.27
53	000703	恒逸石化	30,000	315,300.00	0.27
54	688290	景业智能	6,000	305,400.00	0.26

55	600325	华发股份	40,000	302,800.00	0.26
56	600376	首开股份	60,000	294,600.00	0.25
57	000767	晋控电力	77,400	288,702.00	0.24
58	000560	我爱我家	100,000	288,000.00	0.24
59	600377	宁沪高速	30,000	257,100.00	0.22
60	601186	中国铁建	30,000	237,000.00	0.20
61	601318	中国平安	5,000	233,450.00	0.20
62	002092	中泰化学	30,000	232,800.00	0.20
63	601872	招商轮船	40,000	230,400.00	0.19
64	300332	天壕环境	20,000	224,000.00	0.19
65	601995	中金公司	5,000	222,450.00	0.19
66	601333	广深铁路	100,000	218,000.00	0.18
67	600497	驰宏锌锗	40,000	207,600.00	0.18
68	600691	阳煤化工	50,000	202,000.00	0.17
69	688348	昱能科技	470	195,787.90	0.17
70	600210	紫江企业	30,000	191,700.00	0.16
71	601666	平煤股份	13,456	182,867.04	0.15
72	600863	内蒙华电	50,000	182,500.00	0.15
73	601001	晋控煤业	10,000	177,500.00	0.15
74	000656	金科股份	60,000	171,600.00	0.15
75	601668	中国建筑	30,000	159,600.00	0.14
76	002460	赣锋锂业	1,000	148,700.00	0.13
77	600502	安徽建工	20,000	144,000.00	0.12
78	600582	天地科技	30,000	143,400.00	0.12
79	601919	中远海控	10,000	139,000.00	0.12
80	001979	招商蛇口	10,000	134,300.00	0.11
81	002305	南国置业	50,000	133,500.00	0.11
82	600795	国电电力	30,000	117,300.00	0.10
83	600581	八一钢铁	20,000	112,400.00	0.10
84	601658	邮储银行	20,000	107,800.00	0.09
85	600519	贵州茅台	50	102,250.00	0.09

86	601728	中国电信	20,000	74,600.00	0.06
87	688739	成大生物	1,234	62,699.54	0.05
88	001270	铖昌科技	568	57,481.60	0.05
89	688400	凌云光	2,034	44,605.62	0.04
90	600233	圆通速递	2,100	42,819.00	0.04
91	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.03
92	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.02
93	601600	中国铝业	5,000	23,750.00	0.02
94	688680	海优新材	100	19,870.00	0.02
95	605499	东鹏饮料	100	17,086.00	0.01
96	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
97	300122	智飞生物	100	11,101.00	0.01
98	688099	晶晨股份	100	10,100.00	0.01
99	301053	远信工业	300	7,008.00	0.01
100	688008	澜起科技	100	6,058.00	0.01
101	600298	安琪酵母	100	4,875.00	0.00
102	600887	伊利股份	100	3,895.00	0.00
103	601865	福莱特	100	3,810.00	0.00
104	300709	精研科技	120	3,550.80	0.00
105	600585	海螺水泥	100	3,528.00	0.00
106	002475	立讯精密	100	3,379.00	0.00
107	002241	歌尔股份	100	3,360.00	0.00
108	601336	新华保险	100	3,219.00	0.00
109	300035	中科电气	100	2,795.00	0.00
110	600872	中炬高新	55	1,903.55	0.00
111	000970	中科三环	100	1,878.00	0.00
112	002036	联创电子	100	1,536.00	0.00
113	301035	润丰股份	11	906.95	0.00
114	688210	统联精密	13	281.71	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	14,327,471.65	9.14
2	601336	新华保险	12,560,708.49	8.01
3	300035	中科电气	8,702,596.80	5.55
4	002142	宁波银行	7,988,280.50	5.10
5	600926	杭州银行	7,907,240.00	5.04
6	600188	兖州煤业	7,886,301.00	5.03
7	000001	平安银行	7,301,724.40	4.66
8	002916	深南电路	6,948,441.00	4.43
9	300709	精研科技	6,343,815.89	4.05
10	688388	嘉元科技	6,273,553.84	4.00
11	605111	新洁能	6,139,626.92	3.92
12	600547	山东黄金	5,576,793.84	3.56
13	000977	浪潮信息	5,469,935.63	3.49
14	688187	时代电气	5,161,414.68	3.29
15	300073	当升科技	5,149,741.76	3.28
16	601088	中国神华	4,912,802.00	3.13
17	601009	南京银行	4,870,604.00	3.11
18	688008	澜起科技	4,494,165.48	2.87
19	300623	捷捷微电	4,454,409.00	2.84
20	000983	山西焦煤	4,301,484.00	2.74
21	300373	扬杰科技	4,237,902.00	2.70
22	000933	神火股份	4,166,637.00	2.66
23	000333	美的集团	4,097,525.00	2.61
24	601699	潞安环能	3,975,256.00	2.54
25	300122	智飞生物	3,960,769.00	2.53
26	600111	北方稀土	3,876,867.00	2.47
27	600048	保利地产	3,853,203.00	2.46

28	601666	平煤股份	3,759,482.41	2.40
29	000970	中科三环	3,720,139.00	2.37
30	002475	立讯精密	3,720,008.00	2.37
31	002241	歌尔股份	3,689,066.00	2.35
32	002511	中顺洁柔	3,658,506.00	2.33
33	000858	五粮液	3,641,229.00	2.32
34	688696	极米科技	3,430,701.70	2.19
35	000831	五矿稀土	3,404,041.00	2.17
36	600383	金地集团	3,149,929.00	2.01
37	002008	大族激光	3,146,018.00	2.01

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	13,185,883.00	8.41
2	601336	新华保险	11,935,793.10	7.61
3	688008	澜起科技	11,909,641.25	7.60
4	300035	中科电气	11,067,865.98	7.06
5	300709	精研科技	9,327,856.91	5.95
6	000001	平安银行	8,808,107.00	5.62
7	002142	宁波银行	8,722,943.64	5.56
8	688388	嘉元科技	8,721,475.72	5.56
9	300073	当升科技	8,658,941.74	5.52
10	002241	歌尔股份	7,542,711.12	4.81
11	601009	南京银行	7,522,866.00	4.80
12	002916	深南电路	6,974,165.30	4.45

13	600926	杭州银行	6,814,594.00	4.35
14	605111	新洁能	6,810,082.40	4.34
15	002850	科达利	6,615,294.31	4.22
16	000858	五粮液	6,027,721.00	3.84
17	002475	立讯精密	5,767,553.00	3.68
18	600547	山东黄金	5,575,792.00	3.56
19	600298	安琪酵母	5,407,027.40	3.45
20	603986	兆易创新	5,402,033.60	3.45
21	000977	浪潮信息	5,259,090.00	3.35
22	601658	邮储银行	5,085,102.00	3.24
23	688187	时代电气	4,834,231.23	3.08
24	601166	兴业银行	4,667,193.00	2.98
25	600111	北方稀土	4,384,537.00	2.80
26	300623	捷捷微电	4,207,448.66	2.68
27	002597	金禾实业	4,115,833.00	2.63
28	688598	金博股份	4,024,110.34	2.57
29	300122	智飞生物	3,987,022.35	2.54
30	300373	扬杰科技	3,976,673.00	2.54
31	601666	平煤股份	3,968,014.00	2.53
32	603198	迎驾贡酒	3,797,676.00	2.42
33	000333	美的集团	3,777,496.00	2.41
34	000970	中科三环	3,693,691.00	2.36
35	000831	五矿稀土	3,673,505.00	2.34
36	002511	中顺洁柔	3,466,577.00	2.21
37	603501	韦尔股份	3,440,560.00	2.19
38	688162	巨一科技	3,211,185.66	2.05

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	325,731,144.76
卖出股票收入（成交）总额	331,688,505.83

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	109,807.25	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	109,807.25	0.09

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132026	G三峡EB2	980	109,807.25	0.09

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，根据风险管理的原则，本基金以保持股票仓位平稳与套期保值为目的，通过投资交易活跃、流动性较好的股指期货空单对冲部分系统性风险。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期末本基金未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,348,705.32
2	应收清算款	801,132.60
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	148,581.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,298,419.70

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中科沃土沃瑞混合发起A	5,730	4,073.11	11,204,717.79	48.01%	12,134,209.00	51.99%
中科沃土沃瑞混合发起C	7,500	1,996.45	17,962.67	0.12%	14,955,436.46	99.88%
合计	13,230	2,895.87	11,222,680.46	29.29%	27,089,645.46	70.71%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中科沃土沃瑞混合发起A	175,119.04	0.7503%
	中科沃土沃瑞混合发起C	891.74	0.0059%
	合计	176,010.78	0.4594%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区
----	------	--------------

		间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中科沃土沃瑞混合发起A	0~10
	中科沃土沃瑞混合发起C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中科沃土沃瑞混合发起A	0
	中科沃土沃瑞混合发起C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

截至本报告期末，发起资金认购的本基金基金份额持有期限已满3年。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C
基金合同生效日(2019年01月14日)基金份额总额	8,992,376.24	1,486,436.45
本报告期期初基金份额总额	23,429,379.84	24,930,112.31
本报告期基金总申购份额	25,456,252.10	21,975,478.60
减：本报告期基金总赎回份额	25,546,705.15	31,932,191.78
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	23,338,926.79	14,973,399.13

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、基金托管人及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	195,093,897.43	29.77%	142,672.78	29.77%	-
长城证券	1	31,736,281.88	4.84%	23,208.14	4.84%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	2,680,357.61	0.41%	1,960.11	0.41%	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	48,273,292.03	7.37%	35,302.61	7.37%	-

海通证券	1	146,384,778.17	22.34%	107,049.93	22.34%	-
华安证券	1	8,579,968.11	1.31%	6,274.72	1.31%	-
财达证券	2	111,368,908.63	17.00%	81,445.13	17.00%	-
东方财富证券	2	111,135,418.34	16.96%	81,272.95	16.96%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程：

- (1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。
- (2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总	成交金额	占当期债券回	成交	占当期权证成	成交金额	占当期基金成

		额的比例		购成交 总额的 比例	金 额	交总额 的比例		交总额 的比例
安信证券	-	-	915,000,000.00	43.31%	-	-	-	-
长城证券	-	-	447,000,000.00	21.16%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	155,000,000.00	7.34%	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	363,476.60	100.00%	510,000,000.00	24.14%	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	85,800,000.00	4.06%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	上证报及管理人网站	2022-03-01
2	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新（C类份额）	上证报及管理人网站	2022-03-03
3	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新（A类份额）	上证报及管理人网站	2022-03-03
4	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书更新	上证报及管理人网站	2022-03-03
5	中科沃土基金管理有限公司关于新增中植基金为旗下部分基金销售机构的公告	上证报及管理人网站	2022-03-18
6	中科沃土基金管理有限公司关于新增申万宏源西部证券	上证报及管理人网站	2022-03-18

	为旗下部分基金销售机构的公告		
7	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金2022年第一季度报告	上证报及管理人网站	2022-04-22
8	中科沃土基金管理有限公司关于新增奕丰基金为旗下部分基金销售机构的公告	上证报及管理人网站	2022-06-09
9	中科沃土基金管理有限公司关于新增泰信财富基金为旗下部分基金销售机构的公告	上证报及管理人网站	2022-06-24
10	中科沃土基金管理有限公司关于新增福克斯（北京）基金为旗下部分基金销售机构的公告	上证报及管理人网站	2022-06-28

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220316-20220412 20220517-20220630	8,003,602.74	-	-	8,003,602.74	20.89%
	2	20220113-20220125	-	15,909,061.98	15,909,061.98	-	0.00%
产品特有风险							
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。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。							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的文件；

2. 《中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金合同》；
3. 《中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式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. 基金托管人业务资格批件、营业执照；
6. 关于申请募集注册中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金之法律意见书；
7. 中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中科沃土基金管理有限公司
二〇二二年八月三十一日