

中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券 投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：中科沃土基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
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.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	56
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	58
§10 重大事件揭示.....	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	61

§11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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.....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	错误！未定义书签。
§12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

§ 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 1 月 14 日	
基金管理人	中科沃土基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	133,155,204.05 份	
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	44,714,904.91 份	88,440,299.14 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。	
	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中科沃土基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曹萍	陆志俊
	联系电话	020-37128608	95559
	电子邮箱	caoping@richlandasm.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-018-3610	95559
传真		020-23388997	021-62701216
注册地址		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		广东省广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 21 楼 01 单元自编 06-08 号	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		510620	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	广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 21 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中科沃土基金管理有限公司	广东省广州市天河区珠江西路 5 号 广州国际金融中心 21 楼 01

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	9,569,520.81	7,717,967.95
本期利润	13,682,420.49	12,303,507.08
加权平均基金份额本期利润	0.8224	1.0817
本期加权平均净值利润率	35.46%	44.45%
本期基金份额净值增长率	33.17%	32.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	70,832,252.78	137,694,143.81
期末可供分配基金份额利润	1.5841	1.5569
期末基金资产净值	132,887,087.11	260,108,454.33
期末基金份额净值	2.9719	2.9411
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	197.19%	194.11%

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	19.74%	1.78%	-1.23%	0.48%	20.97%	1.30%
过去三个月	47.50%	1.39%	2.27%	0.59%	45.23%	0.80%
过去六个月	33.17%	1.59%	0.41%	0.79%	32.76%	0.80%
过去一年	77.25%	1.63%	15.19%	0.80%	62.06%	0.83%

自基金合同生效起至今	197.19%	1.40%	41.81%	0.80%	155.38%	0.60%
------------	---------	-------	--------	-------	---------	-------

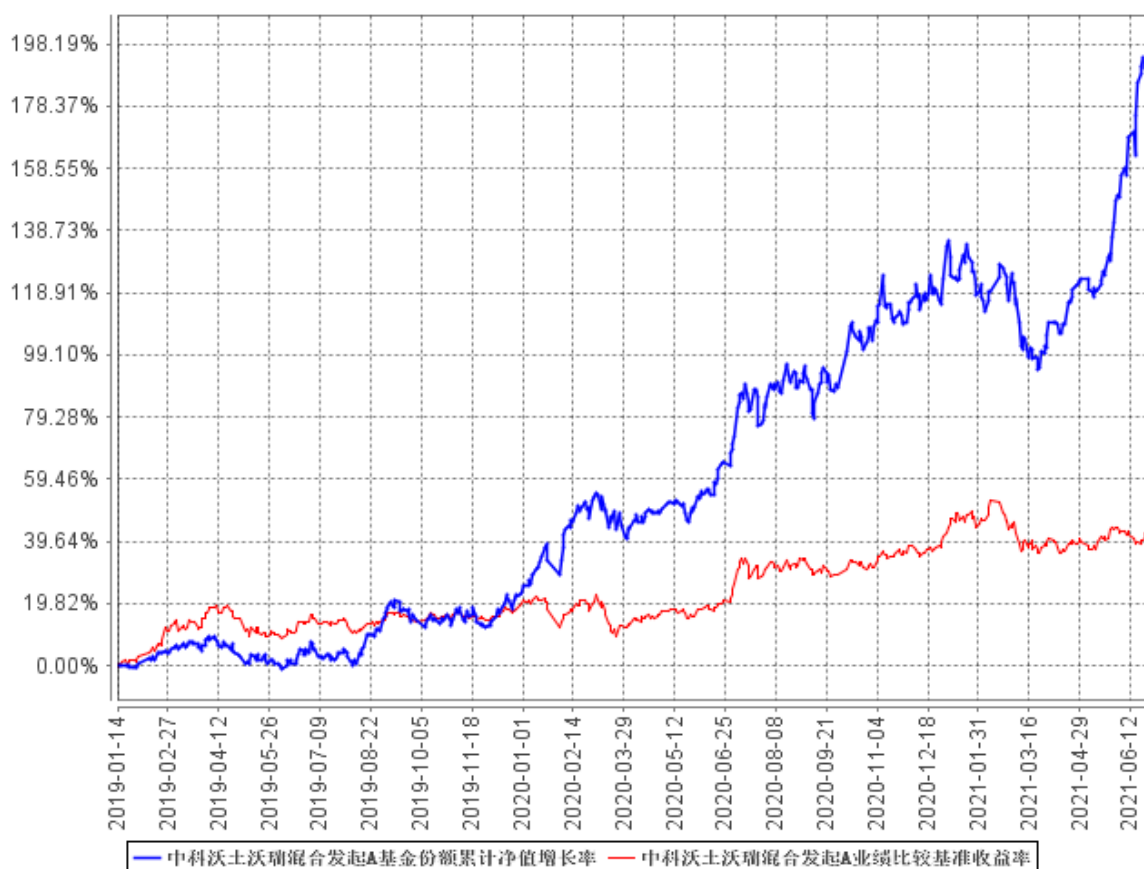
中科沃土沃瑞混合发起 C

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	19.90%	1.80%	-1.23%	0.48%	21.13%	1.32%
过去三个月	47.49%	1.39%	2.27%	0.59%	45.22%	0.80%
过去六个月	32.96%	1.59%	0.41%	0.79%	32.55%	0.80%
过去一年	76.05%	1.63%	15.19%	0.80%	60.86%	0.83%
自基金合同生效起至今	194.11%	1.40%	41.81%	0.80%	152.30%	0.60%

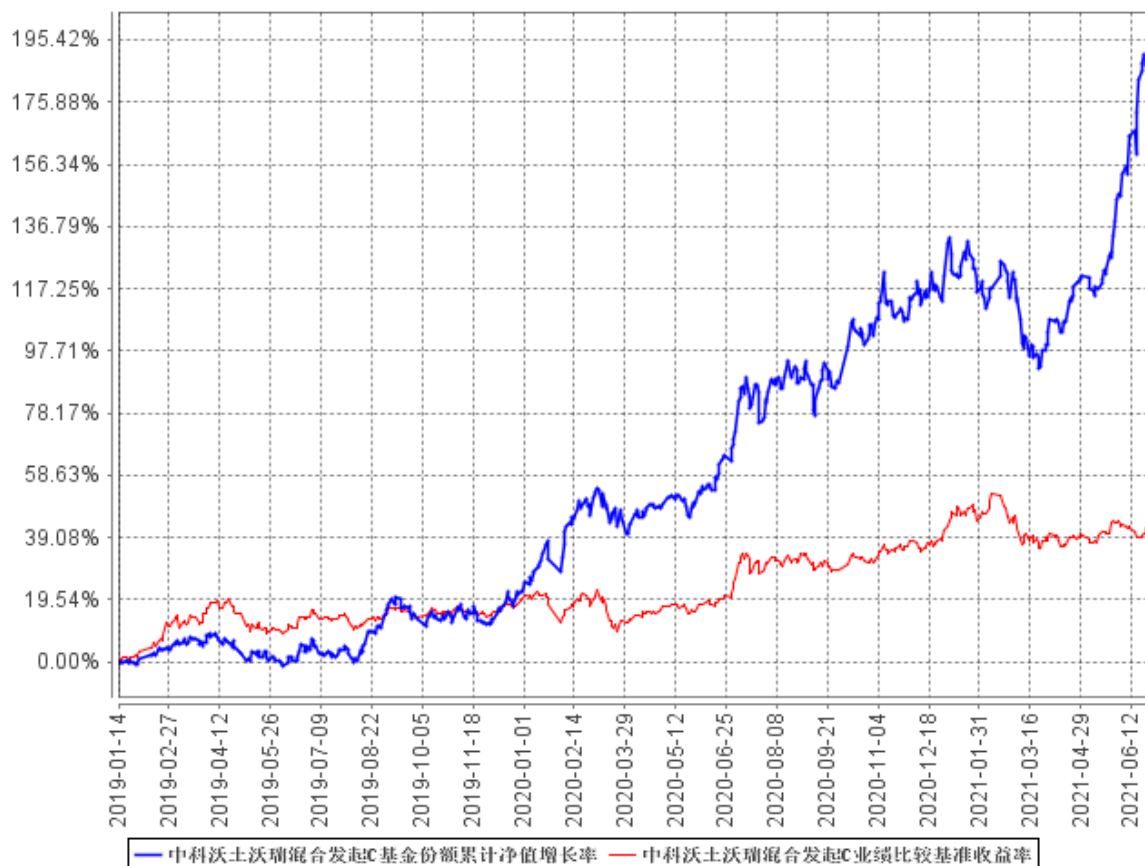
注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

中科沃土沃瑞混合发起A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中科沃土沃瑞混合发起C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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，本基金建仓期为六个月，建仓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 6 月 30 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		
黄艺明	权益投资部副总经理、基金经理	2019 年 1 月 14 日	-	12 年	经济学硕士。曾任广东粤财信托有限公司研究员，金鹰基金管理有限公司基金经理助理、研究总监助理，七匹狼控股集团有限公司投资经理助理，广东富业盛德资产管理有限公司执行董事、投资总监，中科沃土基金管理有限公司专户投资部副总经理、投资经理，现任中科沃土基金管理有限公司权益投资部副总经理、中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
林皓	基金经理	2019 年 11 月 8 日	-	5 年	工学硕士。曾任中科沃土基金管理有限公司研究部研究员，现任中科沃土沃

					瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	---------------------------------------

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期内，不存在本基金的基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3 日内、5 日内），对我司旗下所有投资组合在本报告期的同向交易价差情况进行了分析，根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年的投资运作，对错参半，基金收益尚能差强人意，然而 3 月份基金净值回撤过大，深以为憾。年初，对于计算机自主可控相关公司的布局，尽管一季报业绩整体靓丽、如期兑现，

但在市场系统性风险释放中，高仓位、高贝塔性行业不具防守性，叠加一自主可控龙头持仓公司意外被纳入美国实体清单，导致基金净值回撤偏大。好在我们基金经理团队及时应对，动态调整组合风险暴露和组合弹性，积极布局的芯片半导体、新能源等产业链在二季度表现良好，基金净值稳健回升并创出新高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中科沃土沃瑞混合发起 A 基金份额净值为 2.9719 元，本报告期基金份额净值增长率为 33.17%；截至本报告期末中科沃土沃瑞混合发起 C 基金份额净值为 2.9411 元，本报告期基金份额净值增长率为 32.96%；同期业绩比较基准收益率为 0.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们对市场趋势的看法相对中性，三季度不排除阶段系统性风险需要释放，市场先抑后扬，但部分高景气行业中报业绩靓丽，结构性机会仍有望不断呈现。

中国 5 月 PPI 创出 10 多年新高并已连续 3 个月处于高位，美国 CPI 创出 08 年以来新高，全球通胀压力上行，预期强烈。美联储 6 月已上调隔夜逆回购利率及超额准备金利率，Taper 政策预期可能在三季度加剧全球市场波动。防患于未然，我们的基金投资组合仓位、结构已开始积极应对、平稳过渡。

结构上，我们仍然看好科技与消费，两手都要抓，两手都要硬。

自主可控芯片、新能源锂电池和光伏、汽车电子等科技产业链相关公司在行业高景气度、产业运用及企业适配场景不断扩大背景下，叠加国家政策扶持，规模及盈利能力双升，投资价值深挖仍大有可为。

尽管当前面临新冠疫情反复，居民预防性储蓄上升，叠加原材料成本上升，消费增速阶段性下行，但在消费占据经济增长长期主导作用的趋势下，以医美、宅经济等新型消费异军突出。另外，我们也将积极布局受益疫苗接种大幅上升、群体免疫后消费复苏的各类景气环比向上行业，包括但不限于家居家电建材、食品饮料等传统消费。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

基金日常估值由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。监察风控部负责对基金估值程序和方法进行核查，确保估值相关各项决策得以有效执行。

以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	75,063,262.80	3,473,933.17
结算备付金		4,692,890.33	1,627,127.18
存出保证金		1,641,059.08	202,109.60
交易性金融资产	6.4.7.2	244,332,264.20	58,215,107.32
其中：股票投资		240,015,808.26	58,166,607.32
基金投资		-	-
债券投资		4,316,455.94	48,500.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	45,000,000.00	-
应收证券清算款		56,077,426.99	2,171,363.35
应收利息	6.4.7.5	58,228.37	1,576.43
应收股利		-	-
应收申购款		20,755,456.07	229,118.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		447,620,587.84	65,920,335.80
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		33,758,406.46	1,961,855.74
应付赎回款		19,405,358.34	547,688.31
应付管理人报酬		168,085.15	78,321.14
应付托管费		28,014.20	13,053.51
应付销售服务费		49,625.85	15,816.59
应付交易费用	6.4.7.7	1,155,998.82	670,639.18
应交税费		-	0.15

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	59,557.58	40,042.66
负债合计		54,625,046.40	3,327,417.28
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	133,155,204.05	28,138,944.20
未分配利润	6.4.7.10	259,840,337.39	34,453,974.32
所有者权益合计		392,995,541.44	62,592,918.52
负债和所有者权益总计		447,620,587.84	65,920,335.80

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，中科沃土沃瑞混合发起 A 基金份额净值 2.9719 元，基金份额总额 44,714,904.91 份；中科沃土沃瑞混合发起 C 基金份额净值 2.9411 元，基金份额总额 88,440,299.14 份。中科沃土沃瑞混合发起份额总额合计为 133,155,204.05 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		29,742,109.52	14,234,919.27
1.利息收入		172,990.92	65,533.05
其中：存款利息收入	6.4.7.11	54,888.07	34,222.42
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		103,677.02	31,310.63
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		20,508,056.06	5,289,021.31
其中：股票投资收益	6.4.7.12	20,560,675.37	5,582,105.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13.1	32,998.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-280,765.84	-449,580.00
股利收益	6.4.7.16	195,148.38	156,496.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	8,698,438.81	8,691,157.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	362,623.73	189,207.44
减：二、费用		3,756,181.95	1,693,347.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	484,994.00	263,689.43
2. 托管费	6.4.10.2.2	80,832.34	43,948.20
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	106,932.71	57,815.12
4. 交易费用	6.4.7.19	3,021,877.35	1,311,680.07
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		236.73	-
7. 其他费用	6.4.7.20	61,308.82	16,214.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,985,927.57	12,541,572.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,985,927.57	12,541,572.17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	28,138,944.20	34,453,974.32	62,592,918.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,985,927.57	25,985,927.57
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）	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
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）	133,155,204.05	259,840,337.39	392,995,541.44
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	12,331,524.85	2,837,506.18	15,169,031.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,541,572.17	12,541,572.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	56,913,972.44	31,214,518.41	88,128,490.85
其中：1.基金申购款	85,267,392.54	44,463,027.46	129,730,420.00
2.基金赎回款	-28,353,420.10	-13,248,509.05	-41,601,929.15
四、本期向基金份额持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）	69,245,497.29	46,593,596.76	115,839,094.05

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”)。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,006,686.86 基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《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颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	75,063,262.80
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：	75,063,262.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	227,156,834.17	240,015,808.26	12,858,974.09	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	4,313,600.00	4,316,455.94	2,855.94
	银行间市场	-	-	-
	合计	4,313,600.00	4,316,455.94	2,855.94
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	

其他	-	-	-
合计	231,470,434.17	244,332,264.20	12,861,830.03

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-11,355,134.00	-	-	股指期货
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-11,355,134.00	-	-	

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 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	45,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	45,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金无买断式逆回购。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	11,185.88
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	888.60
应收债券利息	46,091.99

应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	61.90
合计	58,228.37

6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,155,998.82
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,155,998.82

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	50.21
应付证券出借违约金	-
预提费用	59,507.37
合计	59,557.58

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中科沃土沃瑞混合发起 A		
项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,688,154.37	17,688,154.37
本期申购	35,513,302.69	35,513,302.69

本期赎回(以“-”号填列)	-8,486,552.15	-8,486,552.15
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	44,714,904.91	44,714,904.91

金额单位：人民币元

中科沃土沃瑞混合发起 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,450,789.83	10,450,789.83
本期申购	102,606,940.30	102,606,940.30
本期赎回(以“-”号填列)	-24,617,430.99	-24,617,430.99
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	88,440,299.14	88,440,299.14

注：本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中科沃土沃瑞混合发起 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,665,323.65	3,121,371.04	21,786,694.69
本期利润	9,569,520.81	4,112,899.68	13,682,420.49
本期基金份额交易产生的变动数	42,597,408.32	10,105,658.70	52,703,067.02
其中：基金申购款	53,489,803.76	11,485,276.72	64,975,080.48
基金赎回款	-10,892,395.44	-1,379,618.02	-12,272,013.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	70,832,252.78	17,339,929.42	88,172,182.20

单位：人民币元

中科沃土沃瑞混合发起 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,831,649.90	1,835,629.73	12,667,279.63
本期利润	7,717,967.95	4,585,539.13	12,303,507.08

本期基金份额交易产生的变动数	119,144,525.96	27,552,842.52	146,697,368.48
其中：基金申购款	151,934,813.31	32,428,402.38	184,363,215.69
基金赎回款	-32,790,287.35	-4,875,559.86	-37,665,847.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	137,694,143.81	33,974,011.38	171,668,155.19

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	32,820.86
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	20,903.24
其他	1,163.97
合计	54,888.07

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	1,097,097,443.93
减：卖出股票成本总额	1,076,536,768.56
买卖股票差价收入	20,560,675.37

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	17,880,931.49
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）	17,651,748.50

成本总额	
减：应收利息总额	196,184.84
买卖债券差价收入	32,998.15

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	-280,765.84

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	195,148.38
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	195,148.38

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	8,747,724.81
——股票投资	8,744,868.87
——债券投资	2,855.94
——资产支持证券投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-49,286.00
——权证投资	-
股指期货投资	-49,286.00
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	8,698,438.81

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	362,521.21
基金转换费收入	102.52
转出基金补偿收入	-
合计	362,623.73

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	3,021,877.35
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	3,021,877.35

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	39,671.58

证券出借违约金	-
银行汇划费	1,801.45
其他	-
合计	61,308.82

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”）	基金托管人、基金销售机构

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 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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	484,994.00	263,689.43
其中：支付销售机构的客户维护费	147,365.43	64,411.51

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	80,832.34	43,948.20

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C	合计
中科沃土基金	-	10,577.30	10,577.30
合计	-	10,577.30	10,577.30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C	合计
中科沃土基金	-	29,222.72	29,222.72
合计	-	29,222.72	29,222.72

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。C 类基金份额的销售

服务费的计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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

本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中科沃土沃瑞混合发起 A				
关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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）	8,003,602.74	6.0100%	8,003,602.74	28.4400%

份额单位：份

中科沃土沃瑞混合发起 C				
关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
广东中科科创 创业投资管理 有限责任公司	1,000,410.96	0.7500%	1,000,410.96	3.5600%

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	75,063,262.80	32,820.86	6,926,553.60	26,044.32

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

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内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

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
600905	三峡能源	2021年6月2日	2021年12月10日	主板锁定	2.65	5.67	578,699	1,533,552.35	3,281,223.33	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021年6月30日	临时停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	300	11,681.74	16,905.00	-

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、监察风控部、集中交易部和基金事务部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

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

6.4.13.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人通过严格的备选库制度、对交易对手（包括存款银行）、证券发行人的信用评级进行跟踪，和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2021 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 0.0034%(2020 年 12 月 31 日：无)。

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，监察风控部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

6.4.13.3.1 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状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	75,063,262.80	-	-	-	75,063,262.80
结算备付金	4,692,890.33	-	-	-	4,692,890.33
存出保证金	137,626.28	-	-	1,503,432.80	1,641,059.08
交易性金融资产	4,303,010.00	-	13,445.94	240,015,808.26	244,332,264.20
买入返售金融资产	45,000,000.00	-	-	-	45,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	56,077,426.99	56,077,426.99
应收利息	-	-	-	58,228.37	58,228.37
应收申购款	-	-	-	20,755,456.07	20,755,456.07
资产总计	129,196,789.41	-	13,445.94	318,410,352.49	447,620,587.84
负债					
应付证券清算款	-	-	-	33,758,406.46	33,758,406.46
应付赎回款	-	-	-	19,405,358.34	19,405,358.34
应付管理人报酬	-	-	-	168,085.15	168,085.15
应付托管费	-	-	-	28,014.20	28,014.20
应付销售服务费	-	-	-	49,625.85	49,625.85
应付交易费用	-	-	-	1,155,998.82	1,155,998.82
其他负债	-	-	-	59,557.58	59,557.58
负债总计	-	-	-	54,625,046.40	54,625,046.40
利率敏感度缺口	129,196,789.41	-	13,445.94	263,785,306.09	392,995,541.44
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	3,473,933.17	-	-	-	3,473,933.17
结算备付金	1,627,127.18	-	-	-	1,627,127.18
存出保证金	202,109.60	-	-	-	202,109.60
交易性金融资产	48,500.00	-	-	58,166,607.32	58,215,107.32
应收证券清算款	-	-	-	2,171,363.35	2,171,363.35
应收利息	-	-	-	1,576.43	1,576.43
应收申购款	-	-	-	229,118.75	229,118.75
资产总计	5,351,669.95	-	-	60,568,665.85	65,920,335.80
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,961,855.74	1,961,855.74
应付赎回款	-	-	-	547,688.31	547,688.31
应付管理人报酬	-	-	-	78,321.14	78,321.14
应付托管费	-	-	-	13,053.51	13,053.51
应付销售服务费	-	-	-	15,816.59	15,816.59
应付交易费用	-	-	-	670,639.18	670,639.18
应交税费	-	-	-	0.15	0.15
其他负债	-	-	-	40,042.66	40,042.66
负债总计	-	-	-	3,327,417.28	3,327,417.28
利率敏感度缺口	5,351,669.95	-	-	57,241,248.57	62,592,918.52

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.09%，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。（2020 年 6 月 30 日无债券投资）

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 2021 年 6 月 30 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	240,015,808.26	61.07	58,166,607.32	92.93
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	4,316,455.94	1.10	48,500.00	0.08
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	244,332,264.20	62.17	58,215,107.32	93.01

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准下降 5%	12,972,744.75	3,206,599.31
	业绩比较基准上升 5%	-12,972,744.75	-3,206,599.31

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(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 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 240,015,808.26 元，属于第二层次的余额为 4,316,455.94 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 58,147,275.32 元，属于第二层次 67,832.00 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

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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(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) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	240,015,808.26	53.62
	其中：股票	240,015,808.26	53.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,316,455.94	0.96
	其中：债券	4,316,455.94	0.96
	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	45,000,000.00	10.05
	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	79,756,153.13	17.82
8	其他各项资产	78,532,170.51	17.54
9	合计	447,620,587.84	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	204,929,562.89	52.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,285,885.33	0.84
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,488,245.60	0.63
J	金融业	29,301,100.00	7.46
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	240,015,808.26	61.07

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002511	中顺洁柔	617,791	17,020,142.05	4.33
2	688345	博力威	227,700	16,747,335.00	4.26
3	300953	震裕科技	123,708	13,477,986.60	3.43
4	002850	科达利	133,300	11,650,420.00	2.96
5	600745	闻泰科技	107,768	10,442,719.20	2.66
6	601166	兴业银行	497,700	10,227,735.00	2.60
7	688396	华润微	111,700	10,166,934.00	2.59
8	603986	兆易创新	53,300	10,015,070.00	2.55
9	300223	北京君正	97,708	9,860,691.36	2.51
10	300073	当升科技	170,000	9,552,300.00	2.43
11	603690	至纯科技	227,768	9,204,104.88	2.34
12	301002	崧盛股份	90,000	7,371,000.00	1.88
13	601628	中国人寿	207,700	7,038,953.00	1.79
14	002138	顺络电子	177,700	6,889,429.00	1.75
15	688012	中微公司	37,700	6,255,184.00	1.59
16	688063	派能科技	31,700	6,238,560.00	1.59
17	601601	中国太保	207,700	6,017,069.00	1.53
18	002240	盛新锂能	200,100	5,712,855.00	1.45
19	300837	浙矿股份	101,700	4,677,183.00	1.19
20	002074	国轩高科	97,700	4,255,812.00	1.08
21	002142	宁波银行	97,700	3,807,369.00	0.97
22	000568	泸州老窖	15,400	3,633,476.00	0.92
23	603005	晶方科技	57,700	3,417,571.00	0.87

24	688037	芯源微	22,700	3,382,300.00	0.86
25	600905	三峡能源	578,699	3,281,223.33	0.83
26	600584	长电科技	77,700	2,927,736.00	0.74
27	002407	多氟多	77,700	2,761,458.00	0.70
28	000858	五粮液	9,000	2,681,010.00	0.68
29	000596	古井贡酒	11,000	2,634,500.00	0.67
30	605111	新洁能	13,000	2,343,510.00	0.60
31	000001	平安银行	97,700	2,209,974.00	0.56
32	603589	口子窖	31,700	2,145,773.00	0.55
33	688699	明微电子	7,000	1,997,240.00	0.51
34	603195	公牛集团	8,800	1,777,600.00	0.45
35	603919	金徽酒	41,000	1,685,920.00	0.43
36	600426	华鲁恒升	50,000	1,547,500.00	0.39
37	002156	通富微电	53,300	1,281,332.00	0.33
38	002636	金安国纪	77,700	1,260,294.00	0.32
39	300790	宇瞳光学	35,000	1,187,550.00	0.30
40	600779	水井坊	9,000	1,137,150.00	0.29
41	603198	迎驾贡酒	25,400	1,125,220.00	0.29
42	688550	瑞联新材	12,000	1,094,040.00	0.28
43	601636	旗滨集团	57,700	1,070,912.00	0.27
44	002461	珠江啤酒	90,000	984,600.00	0.25
45	605089	味知香	11,000	957,220.00	0.24
46	002304	洋河股份	4,600	953,120.00	0.24
47	600176	中国巨石	37,700	584,727.00	0.15
48	600702	舍得酒业	2,300	491,694.00	0.13
49	002466	天齐锂业	7,700	477,554.00	0.12
50	688018	乐鑫科技	2,000	466,840.00	0.12
51	002738	中矿资源	10,100	448,440.00	0.11
52	688366	昊海生科	1,700	355,810.00	0.09
53	688390	固德威	800	267,200.00	0.07
54	600519	贵州茅台	100	205,670.00	0.05
55	300740	水羊股份	7,700	160,776.00	0.04
56	688008	澜起科技	1,500	93,570.00	0.02
57	300458	全志科技	1,000	87,660.00	0.02
58	688598	金博股份	200	53,800.00	0.01
59	600809	山西汾酒	100	44,800.00	0.01
60	603659	璞泰来	300	40,980.00	0.01
61	002709	天赐材料	200	21,316.00	0.01
62	600460	士兰微	300	16,905.00	0.00

63	688516	奥特维	100	14,800.00	0.00
64	300671	富满电子	100	13,164.00	0.00
65	001208	华菱线缆	1,660	12,831.80	0.00
66	688005	容百科技	100	12,120.00	0.00
67	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
68	603171	税友股份	573	11,001.60	0.00
69	603516	淳中科技	420	8,946.00	0.00
70	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
71	300035	中科电气	100	2,445.00	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	300073	当升科技	25,943,114.64	41.45
2	688396	华润微	22,985,682.56	36.72
3	002850	科达利	22,869,385.60	36.54
4	002240	盛新锂能	22,712,911.75	36.29
5	688063	派能科技	21,734,212.76	34.72
6	600745	闻泰科技	21,363,227.08	34.13
7	605111	新洁能	21,232,965.53	33.92
8	603986	兆易创新	20,976,762.56	33.51
9	603690	至纯科技	20,750,756.85	33.15
10	002138	顺络电子	19,563,819.90	31.26
11	300035	中科电气	19,243,614.99	30.74
12	600711	盛屯矿业	18,990,853.06	30.34
13	600392	盛和资源	18,782,491.82	30.01
14	603198	迎驾贡酒	18,514,420.45	29.58
15	002511	中顺洁柔	18,145,688.74	28.99
16	688012	中微公司	15,699,251.91	25.08
17	688345	博力威	15,169,865.64	24.24
18	688390	固德威	15,089,766.69	24.11
19	300379	东方通	14,283,428.04	22.82
20	300223	北京君正	14,239,492.56	22.75
21	600460	士兰微	13,489,856.96	21.55

22	300953	震裕科技	13,309,508.96	21.26
23	002738	中矿资源	13,214,399.28	21.11
24	688005	容百科技	12,220,791.55	19.52
25	688598	金博股份	12,218,336.28	19.52
26	603659	璞泰来	12,050,117.29	19.25
27	688037	芯源微	11,427,439.16	18.26
28	002043	兔宝宝	11,350,681.04	18.13
29	002466	天齐锂业	11,290,570.92	18.04
30	300373	扬杰科技	10,910,212.45	17.43
31	600438	通威股份	10,863,928.00	17.36
32	688981	中芯国际	10,502,811.90	16.78
33	603180	金牌厨柜	10,183,796.80	16.27
34	601166	兴业银行	10,057,587.33	16.07
35	603317	天味食品	10,034,435.21	16.03
36	300659	中孚信息	9,913,340.28	15.84
37	300115	长盈精密	9,557,720.90	15.27
38	300598	诚迈科技	9,380,656.36	14.99
39	002709	天赐材料	9,247,536.80	14.77
40	603185	上机数控	9,189,663.07	14.68
41	000977	浪潮信息	9,162,471.96	14.64
42	601636	旗滨集团	8,993,618.00	14.37
43	600111	北方稀土	8,910,507.79	14.24
44	002074	国轩高科	8,826,430.00	14.10
45	000858	五粮液	8,504,819.00	13.59
46	002600	领益智造	8,427,113.66	13.46
47	002572	索菲亚	8,216,526.46	13.13
48	002409	雅克科技	8,105,263.00	12.95
49	601628	中国人寿	7,401,175.00	11.82
50	300358	楚天科技	7,396,582.99	11.82
51	600536	中国软件	7,338,852.71	11.72
52	603801	志邦家居	7,206,936.13	11.51
53	002407	多氟多	7,172,753.00	11.46
54	002497	雅化集团	7,131,846.70	11.39
55	301002	崧盛股份	7,041,014.38	11.25
56	300623	捷捷微电	7,017,616.00	11.21
57	300825	阿尔特	7,012,129.00	11.20

58	000066	中国长城	6,883,651.00	11.00
59	688696	极米科技	6,761,283.11	10.80
60	300671	富满电子	6,698,480.90	10.70
61	000568	泸州老窖	6,652,180.00	10.63
62	688268	华特气体	6,648,722.24	10.62
63	601601	中国太保	6,511,304.48	10.40
64	300458	全志科技	6,308,228.00	10.08
65	603787	新日股份	6,263,005.00	10.01
66	605089	味知香	6,203,341.61	9.91
67	002027	分众传媒	6,024,045.17	9.62
68	688006	杭可科技	5,784,121.85	9.24
69	600489	中金黄金	5,679,655.38	9.07
70	605358	立昂微	5,582,244.00	8.92
71	300890	翔丰华	5,425,969.00	8.67
72	002384	东山精密	5,389,395.67	8.61
73	603456	九洲药业	5,351,439.00	8.55
74	688599	天合光能	5,116,148.40	8.17
75	002460	赣锋锂业	5,069,643.89	8.10
76	000596	古井贡酒	5,015,189.00	8.01
77	000830	鲁西化工	4,854,718.00	7.76
78	300837	浙矿股份	4,760,757.00	7.61
79	688408	中信博	4,732,763.64	7.56
80	603589	口子窖	4,706,344.00	7.52
81	300253	卫宁健康	4,685,504.00	7.49
82	688699	明微电子	4,553,419.38	7.27
83	605336	帅丰电器	4,524,597.40	7.23
84	688516	奥特维	4,500,961.32	7.19
85	603353	和顺石油	4,325,368.00	6.91
86	002756	永兴材料	4,162,734.00	6.65
87	300033	同花顺	4,119,004.00	6.58
88	300568	星源材质	4,101,549.00	6.55
89	002439	启明星辰	4,080,857.00	6.52
90	600872	中炬高新	4,065,586.00	6.50
91	688018	乐鑫科技	3,976,391.25	6.35
92	600887	伊利股份	3,888,383.00	6.21
93	002142	宁波银行	3,855,306.00	6.16

94	003026	中晶科技	3,840,995.43	6.14
95	600549	厦门钨业	3,732,760.00	5.96
96	000786	北新建材	3,714,719.00	5.93
97	002597	金禾实业	3,667,467.20	5.86
98	300369	绿盟科技	3,552,904.09	5.68
99	300578	会畅通讯	3,545,902.00	5.67
100	002695	煌上煌	3,540,694.12	5.66
101	603043	广州酒家	3,435,724.00	5.49
102	003012	东鹏控股	3,401,987.90	5.44
103	600426	华鲁恒升	3,357,203.70	5.36
104	600176	中国巨石	3,327,650.57	5.32
105	688383	新益昌	3,293,883.01	5.26
106	603005	晶方科技	3,283,842.98	5.25
107	603919	金徽酒	3,236,655.89	5.17
108	300009	安科生物	3,226,468.80	5.15
109	300433	蓝思科技	3,198,324.00	5.11
110	002182	云海金属	3,174,030.06	5.07
111	002636	金安国纪	3,108,653.00	4.97
112	300790	宇瞳光学	3,095,289.20	4.95
113	688258	卓易信息	3,026,430.00	4.84
114	600230	沧州大化	2,937,276.00	4.69
115	688058	宝兰德	2,890,964.90	4.62
116	600584	长电科技	2,880,415.00	4.60
117	600519	贵州茅台	2,861,115.68	4.57
118	688008	澜起科技	2,809,883.71	4.49
119	300687	赛意信息	2,732,803.50	4.37
120	603195	公牛集团	2,694,664.35	4.31
121	300582	英飞特	2,673,168.00	4.27
122	002938	鹏鼎控股	2,672,091.00	4.27
123	600850	电科数字	2,635,804.00	4.21
124	688519	南亚新材	2,572,698.46	4.11
125	000799	酒鬼酒	2,571,133.00	4.11
126	603078	江化微	2,552,867.00	4.08
127	603686	龙马环卫	2,534,351.02	4.05
128	002304	洋河股份	2,534,122.00	4.05
129	300911	亿田智能	2,428,971.00	3.88

130	300121	阳谷华泰	2,387,537.00	3.81
131	600876	洛阳玻璃	2,336,645.00	3.73
132	002258	利尔化学	2,324,326.00	3.71
133	603799	华友钴业	2,319,363.00	3.71
134	600085	同仁堂	2,317,654.63	3.70
135	600497	驰宏锌锗	2,305,661.96	3.68
136	000001	平安银行	2,271,355.52	3.63
137	601336	新华保险	2,205,541.00	3.52
138	600028	中国石化	2,204,732.00	3.52
139	600905	三峡能源	2,190,786.80	3.50
140	688118	普元信息	2,178,415.21	3.48
141	600348	华阳股份	2,166,088.92	3.46
142	603516	淳中科技	2,145,876.00	3.43
143	688001	华兴源创	2,145,518.69	3.43
144	000661	长春高新	2,134,492.00	3.41
145	300748	金力永磁	2,112,040.60	3.37
146	600259	广晟有色	2,094,097.00	3.35
147	000725	京东方 A	2,072,840.00	3.31
148	603993	洛阳钼业	2,069,184.00	3.31
149	300037	新宙邦	2,042,540.00	3.26
150	600456	宝钛股份	1,971,540.00	3.15
151	300451	创业慧康	1,904,542.00	3.04
152	600809	山西汾酒	1,861,671.00	2.97
153	600690	海尔智家	1,839,668.00	2.94
154	000333	美的集团	1,801,050.00	2.88
155	300655	晶瑞股份	1,792,782.00	2.86
156	600089	特变电工	1,738,847.09	2.78
157	600885	宏发股份	1,693,315.48	2.71
158	002237	恒邦股份	1,690,672.00	2.70
159	002368	太极股份	1,674,704.00	2.68
160	002245	蔚蓝锂芯	1,664,895.02	2.66
161	600499	科达制造	1,650,890.00	2.64
162	002371	北方华创	1,640,116.84	2.62
163	603313	梦百合	1,612,343.00	2.58
164	600779	水井坊	1,596,712.54	2.55
165	600219	南山铝业	1,593,284.00	2.55

166	300618	寒锐钴业	1,589,667.00	2.54
167	000831	五矿稀土	1,574,312.32	2.52
168	002156	通富微电	1,570,390.00	2.51
169	003032	传智教育	1,566,762.24	2.50
170	000426	兴业矿业	1,557,772.00	2.49
171	600623	华谊集团	1,552,878.00	2.48
172	600183	生益科技	1,547,055.00	2.47
173	603305	旭升股份	1,544,907.00	2.47
174	601009	南京银行	1,505,926.00	2.41
175	601818	光大银行	1,505,323.00	2.40
176	600988	赤峰黄金	1,496,301.00	2.39
177	000060	中金岭南	1,469,838.00	2.35
178	000983	山西焦煤	1,443,770.00	2.31
179	600315	上海家化	1,441,280.00	2.30
180	000723	美锦能源	1,436,880.21	2.30
181	688630	芯碁微装	1,432,822.22	2.29
182	603657	春光科技	1,427,068.00	2.28
183	300999	金龙鱼	1,362,752.00	2.18
184	603520	司太立	1,329,613.00	2.12
185	600171	上海贝岭	1,305,213.00	2.09
186	300364	中文在线	1,292,097.00	2.06
187	300476	胜宏科技	1,275,903.50	2.04
188	603899	晨光文具	1,268,807.00	2.03
189	300010	豆神教育	1,255,814.00	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	300035	中科电气	23,026,771.00	36.79
2	605111	新洁能	19,508,562.00	31.17
3	002240	盛新锂能	19,245,022.40	30.75

4	300073	当升科技	19,090,260.44	30.50
5	600392	盛和资源	18,891,911.04	30.18
6	600711	盛屯矿业	18,754,526.00	29.96
7	603198	迎驾贡酒	17,523,795.87	28.00
8	688063	派能科技	17,109,090.93	27.33
9	300379	东方通	16,608,253.67	26.53
10	688390	固德威	15,962,254.29	25.50
11	600460	士兰微	15,085,523.49	24.10
12	688396	华润微	14,683,686.52	23.46
13	603690	至纯科技	13,917,029.63	22.23
14	002738	中矿资源	13,718,357.00	21.92
15	688598	金博股份	13,437,794.76	21.47
16	688005	容百科技	13,280,056.59	21.22
17	002138	顺络电子	13,143,035.00	21.00
18	603659	璞泰来	12,819,021.35	20.48
19	603986	兆易创新	12,339,210.74	19.71
20	002850	科达利	12,242,894.00	19.56
21	600745	闻泰科技	11,935,458.00	19.07
22	002466	天齐锂业	11,527,598.00	18.42
23	300659	中孚信息	11,480,299.00	18.34
24	002043	兔宝宝	11,381,115.00	18.18
25	300115	长盈精密	11,298,160.21	18.05
26	600438	通威股份	11,251,658.00	17.98
27	300373	扬杰科技	10,899,035.00	17.41
28	300598	诚迈科技	10,891,952.60	17.40
29	688037	芯源微	10,716,775.22	17.12
30	688981	中芯国际	10,486,497.52	16.75
31	603180	金牌厨柜	10,275,382.88	16.42
32	688012	中微公司	10,186,554.09	16.27
33	603317	天味食品	9,993,716.00	15.97
34	002709	天赐材料	9,733,622.58	15.55
35	002409	雅克科技	9,726,105.76	15.54
36	000977	浪潮信息	9,357,923.00	14.95
37	000066	中国长城	9,314,660.63	14.88
38	600536	中国软件	9,258,440.52	14.79
39	603185	上机数控	9,171,164.00	14.65
40	002600	领益智造	8,920,756.00	14.25
41	600111	北方稀土	8,883,140.82	14.19

42	688006	杭可科技	8,328,939.02	13.31
43	002572	索菲亚	8,148,809.00	13.02
44	601636	旗滨集团	8,033,047.14	12.83
45	603787	新日股份	7,995,936.00	12.77
46	002027	分众传媒	7,783,179.00	12.43
47	603456	九洲药业	7,780,268.38	12.43
48	300671	富满电子	7,549,029.50	12.06
49	300890	翔丰华	7,459,347.00	11.92
50	300358	楚天科技	7,457,712.30	11.91
51	300458	全志科技	7,201,493.12	11.51
52	002497	雅化集团	7,059,807.22	11.28
53	688696	极米科技	7,044,231.24	11.25
54	300623	捷捷微电	6,879,120.54	10.99
55	688268	华特气体	6,780,558.53	10.83
56	300825	阿尔特	6,746,780.00	10.78
57	603801	志邦家居	6,693,931.90	10.69
58	000858	五粮液	5,831,357.00	9.32
59	688599	天合光能	5,714,585.60	9.13
60	300223	北京君正	5,664,254.00	9.05
61	600489	中金黄金	5,662,858.00	9.05
62	300568	星源材质	5,618,352.68	8.98
63	605358	立昂微	5,580,045.00	8.91
64	300578	会畅通讯	5,460,675.00	8.72
65	002384	东山精密	5,318,087.00	8.50
66	605089	味知香	5,262,793.52	8.41
67	002597	金禾实业	5,249,107.63	8.39
68	002074	国轩高科	5,138,984.00	8.21
69	688516	奥特维	5,138,334.39	8.21
70	002460	赣锋锂业	5,090,499.00	8.13
71	002407	多氟多	4,875,366.20	7.79
72	300253	卫宁健康	4,874,625.00	7.79
73	688408	中信博	4,785,133.31	7.64
74	605336	帅丰电器	4,561,972.00	7.29
75	000830	鲁西化工	4,483,609.00	7.16
76	300033	同花顺	4,312,287.00	6.89
77	603353	和顺石油	4,201,669.00	6.71
78	002439	启明星辰	4,130,434.00	6.60
79	688058	宝兰德	4,114,807.27	6.57

80	688018	乐鑫科技	4,104,344.79	6.56
81	002756	永兴材料	4,075,509.00	6.51
82	600872	中炬高新	4,011,999.00	6.41
83	600887	伊利股份	3,819,868.00	6.10
84	003026	中晶科技	3,745,035.33	5.98
85	600549	厦门钨业	3,636,660.70	5.81
86	000786	北新建材	3,626,995.00	5.79
87	300369	绿盟科技	3,603,679.75	5.76
88	002695	煌上煌	3,509,175.81	5.61
89	688699	明微电子	3,492,148.57	5.58
90	688383	新益昌	3,439,231.47	5.49
91	603043	广州酒家	3,422,092.00	5.47
92	603799	华友钴业	3,338,306.00	5.33
93	003012	东鹏控股	3,336,282.28	5.33
94	300433	蓝思科技	3,282,237.00	5.24
95	300009	安科生物	3,263,378.50	5.21
96	002182	云海金属	3,158,880.08	5.05
97	000568	泸州老窖	3,031,805.42	4.84
98	300687	赛意信息	3,027,241.70	4.84
99	688258	卓易信息	3,005,084.26	4.80
100	300582	英飞特	2,881,752.00	4.60
101	600230	沧州大化	2,821,119.68	4.51
102	603520	司太立	2,785,871.35	4.45
103	600519	贵州茅台	2,748,047.00	4.39
104	600176	中国巨石	2,730,633.71	4.36
105	600850	电科数字	2,659,560.00	4.25
106	000799	酒鬼酒	2,624,256.00	4.19
107	002938	鹏鼎控股	2,592,785.94	4.14
108	688008	澜起科技	2,558,244.92	4.09
109	688519	南亚新材	2,550,695.68	4.08
110	000596	古井贡酒	2,544,353.00	4.06
111	300911	亿田智能	2,537,666.00	4.05
112	603589	口子窖	2,526,306.00	4.04
113	603686	龙马环卫	2,509,572.00	4.01
114	603078	江化微	2,459,393.00	3.93
115	600085	同仁堂	2,348,213.00	3.75
116	300121	阳谷华泰	2,334,366.00	3.73
117	002258	利尔化学	2,308,364.00	3.69

118	600876	洛阳玻璃	2,303,214.00	3.68
119	300790	宇瞳光学	2,287,875.00	3.66
120	600497	驰宏锌锗	2,283,175.00	3.65
121	600028	中国石化	2,192,093.00	3.50
122	601336	新华保险	2,175,877.00	3.48
123	688118	普元信息	2,151,804.76	3.44
124	688561	奇安信	2,141,517.08	3.42
125	600348	华阳股份	2,138,659.00	3.42
126	002335	科华数据	2,125,626.00	3.40
127	000661	长春高新	2,125,300.00	3.40
128	300748	金力永磁	2,097,301.00	3.35
129	000725	京东方 A	2,069,285.00	3.31
130	688001	华兴源创	2,067,853.47	3.30
131	600259	广晟有色	2,038,573.00	3.26
132	601377	兴业证券	2,028,710.00	3.24
133	300037	新宙邦	2,028,366.00	3.24
134	600456	宝钛股份	2,006,468.00	3.21
135	603232	格尔软件	1,995,666.46	3.19
136	603993	洛阳钼业	1,995,145.00	3.19
137	603516	淳中科技	1,983,192.00	3.17
138	002636	金安国纪	1,900,320.00	3.04
139	300596	利安隆	1,890,301.00	3.02
140	300451	创业慧康	1,886,241.00	3.01
141	300953	震裕科技	1,867,883.00	2.98
142	002368	太极股份	1,858,729.00	2.97
143	600809	山西汾酒	1,846,479.00	2.95
144	600426	华鲁恒升	1,837,682.50	2.94
145	300655	晶瑞股份	1,830,594.00	2.92
146	600690	海尔智家	1,812,103.00	2.90
147	300188	美亚柏科	1,780,640.95	2.84
148	000333	美的集团	1,766,270.00	2.82
149	600089	特变电工	1,760,750.00	2.81
150	603313	梦百合	1,732,279.50	2.77
151	002237	恒邦股份	1,726,641.00	2.76
152	600315	上海家化	1,713,404.50	2.74
153	603919	金徽酒	1,709,005.00	2.73
154	600885	宏发股份	1,700,344.00	2.72
155	600499	科达制造	1,641,876.00	2.62

156	603657	春光科技	1,623,377.00	2.59
157	002371	北方华创	1,608,897.60	2.57
158	600219	南山铝业	1,594,532.60	2.55
159	002304	洋河股份	1,580,676.00	2.53
160	600623	华谊集团	1,576,409.00	2.52
161	002245	蔚蓝锂芯	1,572,888.00	2.51
162	600183	生益科技	1,557,854.85	2.49
163	000831	五矿稀土	1,557,732.00	2.49
164	688023	安恒信息	1,537,912.56	2.46
165	000426	兴业矿业	1,529,534.50	2.44
166	603305	旭升股份	1,525,167.00	2.44
167	601818	光大银行	1,495,692.00	2.39
168	601009	南京银行	1,492,524.00	2.38
169	003032	传智教育	1,473,697.48	2.35
170	600988	赤峰黄金	1,473,325.00	2.35
171	688630	芯碁微装	1,465,238.41	2.34
172	600030	中信证券	1,440,494.00	2.30
173	300618	寒锐钴业	1,439,520.00	2.30
174	000060	中金岭南	1,437,881.34	2.30
175	000723	美锦能源	1,430,868.00	2.29
176	603859	能科股份	1,417,480.00	2.26
177	000983	山西焦煤	1,391,159.00	2.22
178	300999	金龙鱼	1,340,404.00	2.14
179	688127	蓝特光学	1,309,960.14	2.09
180	300010	豆神教育	1,304,037.00	2.08
181	300476	胜宏科技	1,285,752.30	2.05
182	600171	上海贝岭	1,279,998.00	2.04
183	600916	中国黄金	1,277,437.00	2.04
184	603899	晨光文具	1,267,539.00	2.03

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,249,641,100.63
卖出股票收入（成交）总额	1,097,097,443.93

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	4,303,010.00	1.09
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）	13,445.94	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,316,455.94	1.10

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	019649	21 国债 01	43,000	4,303,010.00	1.09
2	123115	捷捷转债	93	13,445.94	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2107	IC2107	-3	-4,060,320.00	-23,166.00	-
IC2108	IC2108	-2	-2,684,800.00	-8,480.00	-
IF2108	IF2108	-3	-4,659,300.00	-17,640.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-49,286.00
股指期货投资本期收益（元）					-280,765.84
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-49,286.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据风险管理的原则，本基金投资股指期货以套期保值为目的，选择交易活跃、流动性较好的股指期货合约进行投资。

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投资国债期货

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,641,059.08
2	应收证券清算款	56,077,426.99
3	应收股利	-
4	应收利息	58,228.37
5	应收申购款	20,755,456.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,532,170.51

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中未存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中科沃土沃瑞混合发起 A	14,667	3,048.67	8,003,602.74	17.90%	36,711,302.17	82.10%
中科沃土沃瑞混合发起 C	21,910	4,036.53	2,056,421.43	2.33%	86,383,877.71	97.67%
合计	36,577	3,640.41	10,060,024.17	7.56%	123,095,179.88	92.44%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中科沃土沃瑞混合发起 A	1,691,230.43	3.78%
	中科沃土沃瑞混合发起 C	156,231.14	0.18%
	合计	1,847,461.57	1.39%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中科沃土沃瑞混合发起 A	50~100
	中科沃土沃瑞混合发起 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开	中科沃土沃瑞混合发	50~100

放式基金	起 A	
	中科沃土沃瑞混合发起 C	0~10
	合计	>100

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	634,683.45	0.48	108,749.48	0.08	3
基金经理等人员	1,022,705.71	0.77	804,089.32	0.60	3
基金管理人股东	9,004,013.70	6.76	9,004,013.70	6.76	3
其他	89,386.68	0.07	89,834.36	0.70	3
合计	10,750,789.54	8.08	10,006,686.86	7.51	3

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中科沃土沃瑞混 合发起 A	中科沃土沃瑞混 合发起 C
基金合同生效日（2019 年 1 月 14 日）基金份 额总额	8,992,376.24	1,486,436.45
本报告期期初基金份额总额	17,688,154.37	10,450,789.83
本报告期基金总申购份额	35,513,302.69	102,606,940.30
减：本报告期基金总赎回份额	8,486,552.15	24,617,430.99
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	44,714,904.91	88,440,299.14

§ 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

中科沃土基金管理有限公司（以下简称“本公司”）自 2021 年 4 月 17 日起，智会杰先生担任公司副总经理职务。自 2021 年 5 月 21 日起，智会杰先生担任公司总经理职务，同日，于建伟先生离任公司总经理职务并转任公司副董事长职务。上述公司高管人员变动情况已根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法》等的相关规定进行了披露。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	468,288,494.63	19.98%	342,458.24	19.98%	-
安信证券	1	430,550,377.39	18.37%	314,859.92	18.37%	-
东方财富证券	2	397,258,606.23	16.95%	290,516.30	16.95%	-
国盛证券	1	329,961,817.39	14.08%	241,301.96	14.08%	-
长江证券	1	212,987,886.33	9.09%	155,758.07	9.09%	-

银河证券	2	205,318,659.95	8.76%	150,149.75	8.76%	-
东兴证券	1	109,791,322.58	4.68%	80,291.57	4.68%	-
中信建投	2	102,145,970.39	4.36%	74,699.21	4.36%	-
浙商证券	2	87,699,773.62	3.74%	64,134.93	3.74%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

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

2、交易席位选择流程：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	17,713,650.00	44.83%	471,100,000.00	53.82%	-	-
安信证券	-	-	161,700,000.00	18.47%	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	62,079.52	0.16%	-	-	-	-
长江证券	47,300.86	0.12%	-	-	-	-
银河证券	11,157,615.20	28.24%	61,900,000.00	7.07%	-	-
东兴证券	6,036,422.10	15.28%	89,700,000.00	10.25%	-	-

中信建投	4,498,270.00	11.38%	91,000,000.00	10.40%	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金 2020 年第四季度报告	上证报及管理人网站	2021 年 1 月 21 日
2	中科沃土基金管理有限公司基金管理人的法定名称、住所发生变更的公告	上证报及管理人网站	2021 年 3 月 6 日
3	中科沃土基金管理有限公司基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东事项公告	上证报及管理人网站	2021 年 3 月 20 日
4	中科沃土基金管理有限公司关于旗下基金在东方财富证券推出定期定额投资业务的公告	上证报及管理人网站	2021 年 3 月 26 日
5	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金 2020 年年度报告	上证报及管理人网站	2021 年 3 月 30 日
6	中科沃土基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上证报及管理人网站	2021 年 4 月 17 日
7	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金 2021 年第一季度报告	上证报及管理人网站	2021 年 4 月 21 日
8	中科沃土基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上证报及管理人网站	2021 年 5 月 22 日
9	中科沃土基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告	上证报及管理人网站	2021 年 5 月 26 日
10	中科沃土基金管理有限公司关于选举副董事长的公告	上证报及管理人网站	2021 年 5 月 28 日
11	中科沃土基金管理有限公司关于新增金海九州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	2021 年 6 月 4 日

§ 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	20210101-20210620	8,003,602.74	-	-	8,003,602.74	6.01%
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。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>							

§ 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

2021 年 8 月 31 日