

# 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 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：中科沃土基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 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。

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

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>46</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	56
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	56
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	57

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
8.12 投资组合报告附注 .....	57
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>59</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	59
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	59
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	59
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>60</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>61</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
11.4 基金投资策略的改变 .....	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	61
11.8 其他重大事件 .....	63
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>65</b>
12.1 备查文件目录 .....	65
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	中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	中科沃土沃鑫成长混合发起
基金主代码	003125
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 10 月 25 日
基金管理人	中科沃土基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	33,214,590.25 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金秉承成长投资的理念，在严格控制风险并保持基金投资组合良好的流动性的前提下，通过积极挖掘成长性行业和企业所蕴含的投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	通过对经济周期及资产价格发展变化的理解，在把握经济周期性波动的基础上，动态评估不同资产类在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置及资产的稳健增长。基于成长投资的理念，投资于优选行业中的绩优股票；对于债券投资，采用期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、可转换债券投资策略等；适当参与股指期货、权证、国债期货等金融衍生品的投资，进行分散投资，力求实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合全价（总值）指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期收益和预期风险低于股票型基金，高于货币市场基金和债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中科沃土基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨敏	郭明
	联系电话	020-23388979	010-66105799

	电子邮箱	yangmin@richlandasm.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-018-3610	95588
传真		020-23388997	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路 6号105室-5668	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		510620	100140
法定代表人		朱为绎	易会满

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.richlandasm.com.cn">http://www.richlandasm.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 21 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层
注册登记机构	中科沃土基金管理有限公司	广州市天河区珠江西路 5 号广州国 际金融中心 2107

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年	2016 年 10 月 25 日 (基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-7,780,165.75	6,604,574.09	239,394.67
本期利润	-7,654,087.98	6,484,230.68	125,583.18
加权平均基金份额本期利润	-0.2188	0.0581	0.0006
本期加权平均净值利润率	-24.03%	5.69%	0.06%
本期基金份额净值增长率	-21.67%	2.81%	0.06%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	-6,450,431.55	1,275,619.30	125,583.18
期末可供分配基金份额利润	-0.1942	0.0287	0.0006
期末基金资产净值	26,764,158.70	45,651,247.91	213,858,615.65
期末基金份额净值	0.8058	1.0287	1.0006
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	-19.42%	2.87%	0.06%

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

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

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

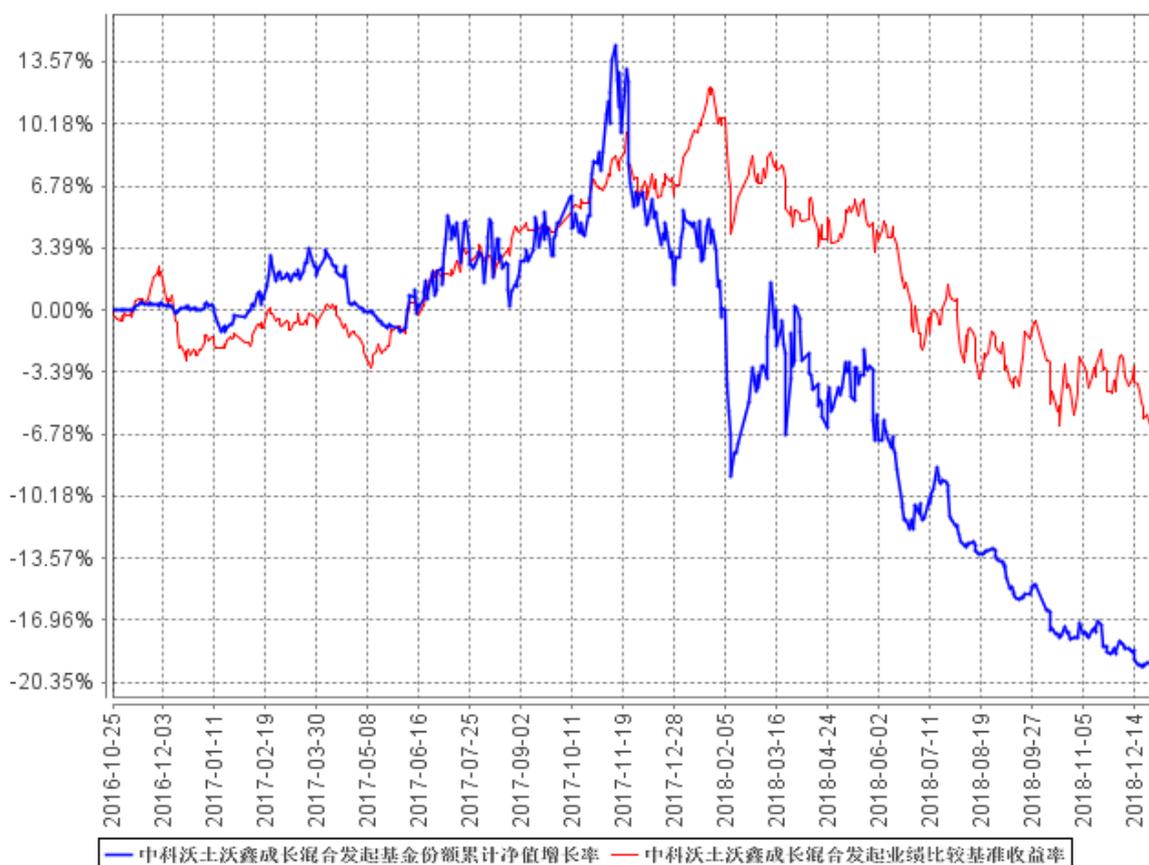
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-5.14%	0.40%	-5.23%	0.81%	0.09%	-0.41%
过去六个月	-9.76%	0.40%	-5.84%	0.74%	-3.92%	-0.34%

过去一年	-21.67%	0.94%	-10.26%	0.66%	-11.41%	0.28%
自基金合同生效起至今	-19.42%	0.83%	-6.02%	0.51%	-13.40%	0.32%

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

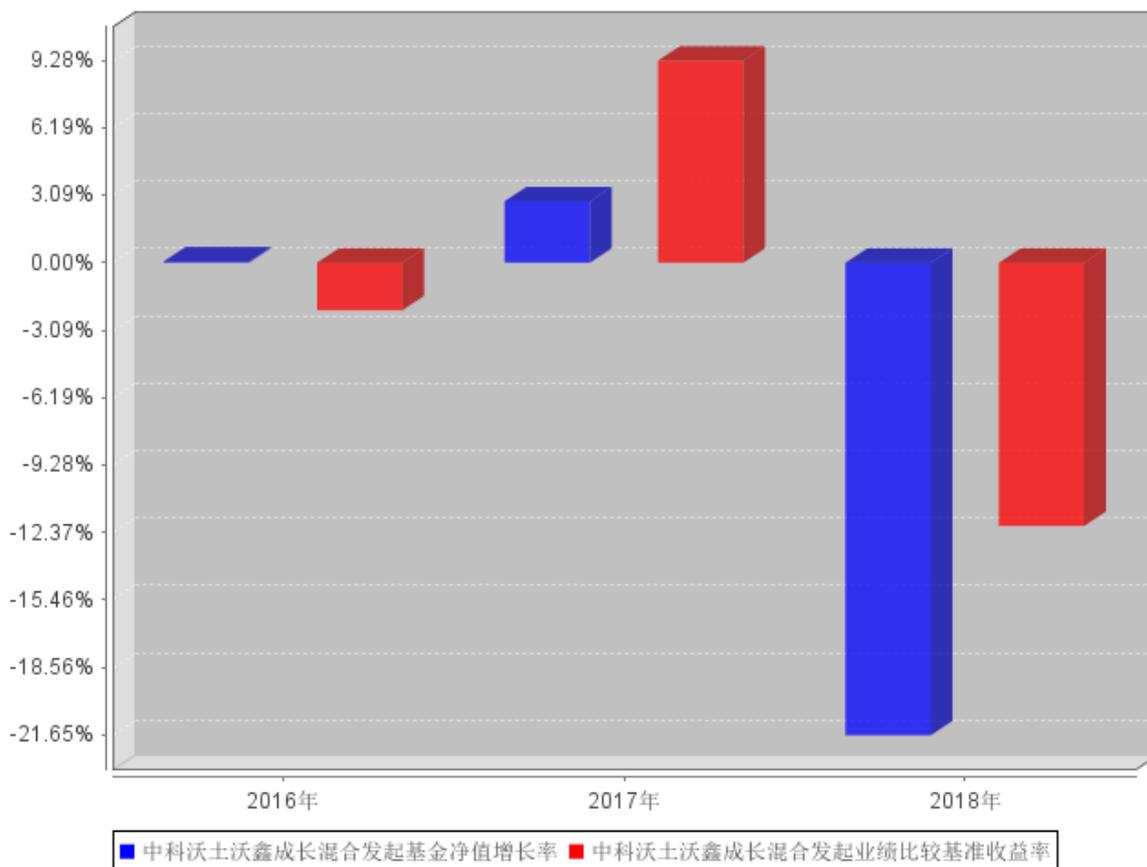
中科沃土沃鑫成长混合发起基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2016 年 10 月 25 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。

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

中科沃土沃鑫成长混合发起自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2016年10月25日）至报告期末未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中科沃土基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2015]1937 号文批准，于 2015 年 9 月 6 日正式成立，注册资本 1.42 亿元，是国内第 101 家公募基金管理公司，也是一家拥有 PE 背景的公募基金管理公司。中科沃土带着中科招商、粤科金融等主要股东强大的精神基因和优秀的文化基因，始终贯彻“持有人利益至上”的首要经营准则，遵循诚信、规范、稳健的经营方针，崇尚价值投资理念和长期、平稳、盈利的投资风格，致力于为持有人提供专业、精品、创新的投资理财服务，创造成长价值，汇聚阳光财富。截至 2018 年 12 月 31 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、中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金和中科沃土沃安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		
李昱	副总经理 兼任权益 投资部总 经理、基 金经理	2016 年 10 月 25 日	-	22 年	管理学硕士。曾任广发证券股份有限公司环市东营业部业务经理、投资理财部投资经理、资产管理部投资经理，新华基金管理有限公司专户管理部副总监、专户管理部负责人、基金管理部基金经理、基金管理部副总监，现任中科沃土基金管理有限公司副总经理兼任权益投资部总经理、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、中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金和中科沃土沃安

					债券型证券投资基金基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
宋佳蕾	基金经理助理	2017年12月15日	-	5年	会计学硕士。曾任安信证券股份有限公司分析师，中科沃土基金管理有限公司专户投资经理、研究部行业研究员，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助理。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，李昱的“任职日期”为基金合同生效之日，宋佳蕾的“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。

3. 因公司工作安排，宋佳蕾自 2019 年 2 月 1 日离任本基金基金经理助理职务。该事项已于 2019 年 2 月 1 日在《中国证券报》上进行披露。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

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 2018 年度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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中未出现交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

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

本报告期内，市场总体走势趋势向下。本年度上证指数下跌 24.59%，年度跌幅仅次于 2008 年。2018 年，国内信用风险暴露、中美贸易摩擦升级、去杠杆监管政策及汇率下跌等影响，市场风险偏好显著回落，指数大幅调整，本产品在报告期内进行了有效的防御，提前降低仓位，有效控制了净值的回撤。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.8058 元；本报告期基金份额净值增长率为-21.67%，业绩比较基准收益率为-10.26%。

#### 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 2019 年，当前处于经济基本面向下和政策持续对冲的博弈期，总理表态和降准再次释放货币政策和财政政策逆周期调节经济运行的决心，结合此前央行 TMLF 定向降准，货币政策持续宽松，叠加国内市场估值优势对比明显，外资有望继续加大配置力度，科创板的推出及资本市场的重新定位，增强了市场的信心。行业配置方面，主要为独立周期的黄金、养殖以及稳增长对冲的大基建、新基建，含 5G、新能源、轨交、特高压等。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

(3) 坚持规范运作、稳健经营的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统，积极配合各类新产品、新业务、新投资工

具的推出和应用，重点加强对高风险业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，加强对投资、交易等业务运作的日常合规检查和反馈提示，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规和基金合同的要求稳健、规范运作。

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

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

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

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本基金托管人在对中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的管理人——中科沃土基金管理有限公司在中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，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未进行利润分配。

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

本托管人依法对中科沃土基金管理有限公司编制和披露的中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	瑞华审字【2019】48490007

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称沃鑫基金）财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表，以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了沃鑫基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和所有者权益（基金净值）变动。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于沃鑫基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估沃鑫基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督沃鑫基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的

<p>责任</p>	<p>重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序。</p> <p>（三）评价沃鑫基金管理层的会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四）对沃鑫基金管理层的持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对沃鑫基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致沃鑫基金不能持续经营。</p> <p>（五）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与沃鑫基金治理层就基金的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）</p>

注册会计师的姓名	黄怀颖	闫 靖
会计师事务所的地址	北京市海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层	
审计报告日期	2019 年 3 月 26 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	14,885,406.96	2,875,312.63
结算备付金		287,550.59	264,455.94
存出保证金		52,952.06	250,447.05
交易性金融资产	7.4.7.2	2,141,999.33	36,473,256.80
其中：股票投资		2,141,999.33	36,473,256.80
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	10,000,000.00	5,000,000.00
应收证券清算款		-	1,899,216.06
应收利息	7.4.7.5	12,937.37	9,483.59
应收股利		-	-
应收申购款		-	1,590.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		27,380,846.31	46,773,763.03
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	22,587.38
应付管理人报酬		34,296.32	59,753.10
应付托管费		5,716.05	9,958.86
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	301,675.24	690,173.33
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	275,000.00	340,042.45
负债合计		616,687.61	1,122,515.12
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	33,214,590.25	44,375,628.61
未分配利润	7.4.7.10	-6,450,431.55	1,275,619.30
所有者权益合计		26,764,158.70	45,651,247.91
负债和所有者权益总计		27,380,846.31	46,773,763.03

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8058 元，基金份额总额 33,214,590.25 份。

## 7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-5,854,200.20	11,606,719.75
1. 利息收入		175,349.75	1,523,270.85
其中：存款利息收入	7.4.7.11	118,797.76	385,802.85
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		56,551.99	1,137,468.00
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,164,367.29	9,876,655.41
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-6,304,861.19	9,495,699.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	140,493.90	380,955.76
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	126,077.77	-120,343.41
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	8,739.57	327,136.90
<b>减：二、费用</b>		1,799,887.78	5,122,489.07
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	477,553.85	1,736,679.78
2. 托管费	7.4.10.2.2	79,592.36	289,446.58

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,026,315.38	2,750,951.72
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	216,426.19	345,410.99
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-7,654,087.98	6,484,230.68
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-7,654,087.98	6,484,230.68

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	44,375,628.61	1,275,619.30	45,651,247.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,654,087.98	-7,654,087.98
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）	-11,161,038.36	-71,962.87	-11,233,001.23
其中：1. 基金申购款	1,779,008.77	-21,776.38	1,757,232.39
2. 基金赎回款	-12,940,047.13	-50,186.49	-12,990,233.62
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）	33,214,590.25	-6,450,431.55	26,764,158.70
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	213,733,032.47	125,583.18	213,858,615.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,484,230.68	6,484,230.68
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）	-169,357,403.86	-5,334,194.56	-174,691,598.42
其中：1. 基金申购款	3,359,688.17	118,522.74	3,478,210.91
2. 基金赎回款	-172,717,092.03	-5,452,717.30	-178,169,809.33
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）	44,375,628.61	1,275,619.30	45,651,247.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>程文卫</u>	<u>傅军</u>	<u>李茂</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2016〕1561号），由基金发起人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》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）发起募集。本基金募集资金经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审验，并由其出具《验证报告》（安永华明(2016)验字第61247680\_G06号）。经向中国证监会备案，本基金基金合同于2016年10月25日正式生效。本基金的基金管理人为中科沃土基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为：包括国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、货币市场工具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。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部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。

#### 7.4.3 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 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。

##### 7.4.4.1 会计年度

会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1. 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资(主要为权证投资和股指期货、国债期货)等，其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报，衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

## 2. 金融负债的分类

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

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一的金融资产，予以终止确认：

- (1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- (2) 该金融资产已转移，且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- (3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。

#### 1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

##### (1) 股票投资

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

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

##### (2) 债券投资

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

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

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

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

### (3) 权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

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

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

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

### (4) 股指期货

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

## 2. 贷款及应收款项

### 买入返售金融资产

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

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

## 3. 其他金融负债

### 卖出回购金融资产款

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

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

## 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1. 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，

且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

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

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

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

具体投资品种的估值方法如下：

#### (1) 股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

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

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

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

非公开发行有明确锁定期的股票，若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，以估值日证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价为公允价值；若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按中国证监会相关规定处理。

#### (2) 债券投资

银行间和交易所市场上市交易的债券(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，采用第

三方估值机构(中央国债登记结算公司或中证指数有限公司)提供的估值净价确定公允价值。

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

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

### (3) 权证投资

交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价为公允价值。

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

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

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

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

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。公允价值计量层次可分为:

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

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时,相关款项

中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例, 损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 1. 利息收入

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

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

##### 2. 投资收益

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

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

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

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

##### 3. 公允价值变动收益

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：

1. 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2. 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3. 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4. 每一基金份额享有同等分配权；

5. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税〔2008〕1 号)、《关

于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2012〕85号)、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2015〕101号)、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36号)、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》(财税〔2016〕46号)、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》(财税〔2016〕70号)、《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税〔2016〕140号)及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(一) 2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收企业所得税。

(三) 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
活期存款	14,885,406.96	2,875,312.63
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:	14,885,406.96	2,875,312.63

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2018年12月31日

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,250,076.46	2,141,999.33	-108,077.13
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,250,076.46	2,141,999.33	-108,077.13
项目		上年度末 2017年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		36,707,411.70	36,473,256.80	-234,154.90
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		36,707,411.70	36,473,256.80	-234,154.90

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	10,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	10,000,000.00	-
项目	上年度末 2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-

银行间市场	-	-
买入返售证券	5,000,000.00	-
合计	5,000,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	3,330.82	3,434.19
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	142.34	130.90
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	9,437.92	5,794.53
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	26.29	123.97
合计	12,937.37	9,483.59

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	301,675.24	690,173.33
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	301,675.24	690,173.33

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-

应付赎回费	-	42.45
预提费用	275,000.00	340,000.00
-	-	-
合计	275,000.00	340,042.45

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,375,628.61	44,375,628.61
本期申购	1,779,008.77	1,779,008.77
本期赎回（以“-”号填列）	-12,940,047.13	-12,940,047.13
- 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	33,214,590.25	33,214,590.25

注：1. 本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,544,916.66	-2,269,297.36	1,275,619.30
本期利润	-7,780,165.75	126,077.77	-7,654,087.98
本期基金份额交易产生的变动数	-473,058.63	401,095.76	-71,962.87
其中：基金申购款	-25,102.47	3,326.09	-21,776.38
基金赎回款	-447,956.16	397,769.67	-50,186.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,708,307.72	-1,742,123.83	-6,450,431.55

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
活期存款利息收入	110,502.83	116,424.16

定期存款利息收入	-	193,691.44
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	6,686.79	73,104.24
其他	1,608.14	2,583.01
合计	118,797.76	385,802.85

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年12月31日
卖出股票成交总额	393,011,661.68	1,017,215,089.93
减：卖出股票成本总额	399,316,522.87	1,007,719,390.28
买卖股票差价收入	-6,304,861.19	9,495,699.65

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
股票投资产生的股利收益	140,493.90	380,955.76
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	140,493.90	380,955.76

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	126,077.77	-120,343.41
——股票投资	126,077.77	-120,343.41
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	126,077.77	-120,343.41

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	8,723.20	326,869.59
基金转换费收入	16.37	267.31
合计	8,739.57	327,136.90

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,026,315.38	2,750,951.72
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,026,315.38	2,750,951.72

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	15,000.00	40,000.00
信息披露费	200,000.00	300,000.00
银行汇划费	1,426.19	5,410.99
其他	-	-
合计	216,426.19	345,410.99

#### 7.4.7.21 分部报告

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

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	477,553.85	1,736,679.78
其中：支付销售机构的客户维护费	206,568.37	997,670.49

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	79,592.36	289,446.58

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2016 年 10 月 25 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	4,975,124.38	4,975,124.38
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	4,975,124.38	4,975,124.38
期末持有的基金份额占基金总份额比例	14.98%	11.21%

#### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 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	2,976,293.76	8.96%	2,976,293.76	6.71%
广东省粤科金融集团有限公司	1,000,000.00	3.01%	1,000,000.00	2.25%
广东中广投资管理有限公司	197,642.23	0.60%	197,642.23	0.450%

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	14,885,406.96	110,502.83	2,875,312.63	116,424.16

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

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金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。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金未持有暂时停牌流通受限股票。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金未从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金未从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，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和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金主要持仓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，期末未持有流动性受限资产，尚未发现由于流动性不足导致无法在合理价格变现资产或影响投资者赎回的潜在风险。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 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
-----	-------	-------	-------	-----	----

2018 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	14,885,406.96	-	-	-	14,885,406.96
结算备付金	287,550.59	-	-	-	287,550.59
存出保证金	52,952.06	-	-	-	52,952.06
交易性金融资产	-	-	-	2,141,999.33	2,141,999.33
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
应收利息	-	-	-	12,937.37	12,937.37
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	25,225,909.61	-	-	2,154,936.70	27,380,846.31
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	34,296.32	34,296.32
应付托管费	-	-	-	5,716.05	5,716.05
应付交易费用	-	-	-	301,675.24	301,675.24
其他负债	-	-	-	275,000.00	275,000.00
负债总计	-	-	-	616,687.61	616,687.61
利率敏感度缺口	25,225,909.61	-	-	1,538,249.09	26,764,158.70
上年度末 2017 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	2,875,312.63	-	-	-	2,875,312.63
结算备付金	264,455.94	-	-	-	264,455.94
存出保证金	250,447.05	-	-	-	250,447.05
交易性金融资产	-	-	-	36,473,256.80	36,473,256.80
买入返售金融资产	5,000,000.00	-	-	-	5,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,899,216.06	1,899,216.06
应收利息	-	-	-	9,483.59	9,483.59
应收申购款	-	-	-	1,590.96	1,590.96
资产总计	8,390,215.62	-	-	38,383,547.41	46,773,763.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	22,587.38	22,587.38
应付管理人报酬	-	-	-	59,753.10	59,753.10
应付托管费	-	-	-	9,958.86	9,958.86
应付交易费用	-	-	-	690,173.33	690,173.33
其他负债	-	-	-	340,042.45	340,042.45
负债总计	-	-	-	1,122,515.12	1,122,515.12
利率敏感度缺口	8,390,215.62	-	-	37,261,032.29	45,651,247.91

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 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（2018 年 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	481,107.78	4,331,255.20
	业绩比较基准下降 5%	-481,107.78	-4,331,255.20

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1. 公允价值

##### (1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

##### (2) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注 7.4.4.5。

##### (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 2,141,999.33 元，无属于第二层级和第三层级的余额。

(2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 34,033,751.18 元，属于第二层级余额为 2,439,505.62 元。无属于第三层级的余额。

) (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,141,999.33	7.82
	其中：股票	2,141,999.33	7.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	10,000,000.00	36.52
	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	15,172,957.55	55.41
8	其他各项资产	65,889.43	0.24
9	合计	27,380,846.31	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	206,167.50	0.77
B	采矿业	695.75	0.00
C	制造业	1,715,441.17	6.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,001.76	0.00
F	批发和零售业	1,310.05	0.00
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	59,072.92	0.22
J	金融业	1,711.43	0.01
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	156,598.75	0.59
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,141,999.33	8.00

### 8.2.2 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000063	中兴通讯	17,000	333,030.00	1.24
2	300498	温氏股份	7,875	206,167.50	0.77
3	600498	烽火通信	6,434	183,175.98	0.68
4	002157	正邦科技	30,000	159,300.00	0.60
5	300015	爱尔眼科	4,375	115,062.50	0.43
6	600487	亨通光电	6,568	111,984.40	0.42
7	300122	智飞生物	2,627	101,822.52	0.38
8	002371	北方华创	2,561	96,703.36	0.36
9	600522	中天科技	10,500	85,575.00	0.32
10	002792	通宇通讯	2,625	80,377.50	0.30
11	300308	中际旭创	1,903	77,433.07	0.29
12	002281	光迅科技	2,845	76,416.70	0.29
13	300666	江丰电子	1,750	72,310.00	0.27
14	600271	航天信息	2,873	65,762.97	0.25
15	000661	长春高新	352	61,600.00	0.23
16	300047	天源迪科	5,251	58,338.61	0.22
17	300760	迈瑞医疗	527	57,558.94	0.22
18	002463	沪电股份	7,380	52,914.60	0.20
19	600763	通策医疗	875	41,536.25	0.16
20	000977	浪潮信息	2,546	40,532.32	0.15

21	600703	三安光电	2,483	28,082.73	0.10
22	603826	坤彩科技	1,750	24,412.50	0.09
23	600426	华鲁恒升	312	3,765.84	0.01
24	002815	崇达技术	180	2,629.80	0.01
25	601988	中国银行	443	1,599.23	0.01
26	002024	苏宁易购	133	1,310.05	0.00
27	002195	二三四五	199	734.31	0.00
28	601390	中国中铁	104	726.96	0.00
29	600547	山东黄金	23	695.75	0.00
30	601186	中国铁建	24	260.88	0.00
31	601318	中国平安	2	112.20	0.00
32	300373	扬杰科技	2	28.88	0.00
33	603308	应流股份	3	24.06	0.00
34	002310	东方园林	2	13.92	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601939	建设银行	13,611,617.93	29.82
2	601318	中国平安	13,401,461.91	29.36
3	300122	智飞生物	8,606,897.00	18.85
4	600271	航天信息	7,571,922.64	16.59
5	002371	北方华创	6,718,475.00	14.72
6	000977	浪潮信息	6,440,949.53	14.11
7	002384	东山精密	5,653,433.00	12.38
8	601336	新华保险	5,396,118.00	11.82
9	300601	康泰生物	5,345,217.00	11.71
10	603019	中科曙光	4,941,291.39	10.82
11	300308	中际旭创	4,906,261.00	10.75
12	300017	网宿科技	4,705,163.19	10.31
13	603233	大参林	4,533,029.00	9.93
14	603986	兆易创新	4,502,415.00	9.86
15	600036	招商银行	4,318,815.00	9.46

16	600845	宝信软件	4,168,444.59	9.13
17	600138	中青旅	4,111,195.37	9.01
18	002007	华兰生物	3,966,978.00	8.69
19	600048	保利地产	3,942,018.00	8.64
20	601988	中国银行	3,792,925.00	8.31
21	000063	中兴通讯	3,634,492.61	7.96
22	300059	东方财富	3,491,769.80	7.65
23	002463	沪电股份	3,340,991.00	7.32
24	300199	翰宇药业	3,294,718.00	7.22
25	601888	中国国旅	3,260,900.00	7.14
26	300618	寒锐钴业	3,242,644.00	7.10
27	000636	风华高科	3,174,018.00	6.95
28	002916	深南电路	3,084,793.00	6.76
29	300498	温氏股份	2,982,134.00	6.53
30	002714	牧原股份	2,933,493.36	6.43
31	000725	京东方A	2,885,950.00	6.32
32	600588	用友网络	2,792,229.40	6.12
33	300142	沃森生物	2,673,088.00	5.86
34	002511	中顺洁柔	2,649,179.00	5.80
35	600029	南方航空	2,608,943.29	5.71
36	000963	华东医药	2,517,406.00	5.51
37	300433	蓝思科技	2,437,406.50	5.34
38	600754	锦江股份	2,431,796.32	5.33
39	603658	安图生物	2,400,226.90	5.26
40	000333	美的集团	2,350,413.00	5.15
41	002268	卫士通	2,308,597.46	5.06
42	002727	一心堂	2,296,984.00	5.03
43	600172	黄河旋风	2,242,103.52	4.91
44	002024	苏宁易购	2,229,579.00	4.88
45	603799	华友钴业	2,224,782.00	4.87
46	002680	*ST 长生	2,222,435.46	4.87
47	603826	坤彩科技	2,191,050.00	4.80
48	600887	伊利股份	2,164,830.00	4.74
49	600606	绿地控股	2,157,600.00	4.73
50	300236	上海新阳	2,134,512.00	4.68
51	000895	双汇发展	2,096,894.00	4.59

52	600809	山西汾酒	2,075,463.00	4.55
53	000651	格力电器	2,047,402.00	4.48
54	600346	恒力股份	1,933,366.50	4.24
55	600900	长江电力	1,913,694.00	4.19
56	600323	瀚蓝环境	1,871,409.00	4.10
57	002493	荣盛石化	1,837,533.50	4.03
58	601288	农业银行	1,836,352.00	4.02
59	603939	益丰药房	1,824,323.00	4.00
60	600340	华夏幸福	1,821,148.00	3.99
61	002497	雅化集团	1,797,611.00	3.94
62	603816	顾家家居	1,794,024.00	3.93
63	300047	天源迪科	1,764,970.00	3.87
64	300613	富瀚微	1,749,317.00	3.83
65	002677	浙江美大	1,748,078.80	3.83
66	000661	长春高新	1,742,056.50	3.82
67	600383	金地集团	1,737,699.00	3.81
68	002151	北斗星通	1,733,000.00	3.80
69	002009	天奇股份	1,689,509.00	3.70
70	600115	东方航空	1,685,698.00	3.69
71	600068	葛洲坝	1,610,000.00	3.53
72	300136	信维通信	1,587,076.00	3.48
73	601607	上海医药	1,491,653.00	3.27
74	300418	昆仑万维	1,466,340.00	3.21
75	300388	国祯环保	1,466,148.00	3.21
76	300070	碧水源	1,449,554.00	3.18
77	600276	恒瑞医药	1,440,550.12	3.16
78	002049	紫光国微	1,433,664.00	3.14
79	000001	平安银行	1,429,000.00	3.13
80	601233	桐昆股份	1,426,285.00	3.12
81	300529	健帆生物	1,419,694.00	3.11
82	601919	中远海控	1,418,000.00	3.11
83	300143	星普医科	1,400,864.90	3.07
84	002304	洋河股份	1,399,554.00	3.07
85	603387	基蛋生物	1,346,398.00	2.95
86	002001	新和成	1,304,651.00	2.86
87	600763	通策医疗	1,302,158.00	2.85

88	300470	日机密封	1,262,453.00	2.77
89	600867	通化东宝	1,261,376.20	2.76
90	300666	江丰电子	1,236,169.00	2.71
91	603818	曲美家居	1,208,307.00	2.65
92	300437	清水源	1,204,960.00	2.64
93	601636	旗滨集团	1,198,900.00	2.63
94	000858	五 粮 液	1,189,960.00	2.61
95	601111	中国国航	1,184,500.00	2.59
96	600428	中远海特	1,184,000.00	2.59
97	603393	新天然气	1,176,550.00	2.58
98	300003	乐普医疗	1,169,508.00	2.56
99	600521	华海药业	1,162,423.00	2.55
100	600498	烽火通信	1,158,819.00	2.54
101	601668	中国建筑	1,148,000.00	2.51
102	300482	万孚生物	1,124,935.00	2.46
103	600600	青岛啤酒	1,117,969.00	2.45
104	600487	亨通光电	1,115,754.00	2.44
105	002281	光迅科技	1,114,453.00	2.44
106	603369	今世缘	1,106,754.41	2.42
107	600028	中国石化	1,078,952.40	2.36
108	000002	万 科A	1,067,648.00	2.34
109	600547	山东黄金	1,066,239.00	2.34
110	300532	今天国际	1,065,852.00	2.33
111	300134	大富科技	1,063,294.00	2.33
112	601328	交通银行	1,051,502.00	2.30
113	300251	光线传媒	1,049,650.00	2.30
114	002192	融捷股份	1,048,147.00	2.30
115	002366	台海核电	1,036,389.00	2.27
116	300166	东方国信	1,031,778.00	2.26
117	603678	火炬电子	1,026,549.00	2.25
118	002664	长鹰信质	1,025,673.00	2.25
119	600584	长电科技	1,020,997.00	2.24
120	600362	江西铜业	1,009,600.00	2.21
121	601899	紫金矿业	1,004,400.00	2.20
122	300377	赢时胜	1,000,540.00	2.19
123	002456	欧菲科技	998,305.00	2.19

124	600466	蓝光发展	994,844.00	2.18
125	300315	掌趣科技	983,681.00	2.15
126	600185	格力地产	979,500.00	2.15
127	300027	华谊兄弟	978,950.00	2.14
128	603466	风语筑	974,553.00	2.13
129	600740	山西焦化	966,610.00	2.12
130	603338	浙江鼎力	958,102.00	2.10
131	603883	老百姓	956,368.00	2.09
132	300170	汉得信息	955,911.00	2.09
133	600966	博汇纸业	942,000.00	2.06
134	000488	晨鸣纸业	935,435.00	2.05
135	600667	太极实业	922,030.00	2.02
136	600141	兴发集团	921,741.00	2.02
137	600027	华电国际	920,000.00	2.02
138	002215	诺普信	918,800.00	2.01

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	15,182,396.27	33.26
2	601939	建设银行	13,399,969.98	29.35
3	300122	智飞生物	8,849,214.23	19.38
4	002371	北方华创	7,904,527.80	17.32
5	600271	航天信息	7,371,968.59	16.15
6	000977	浪潮信息	6,291,252.59	13.78
7	603019	中科曙光	5,633,738.64	12.34
8	002384	东山精密	5,427,660.23	11.89
9	300601	康泰生物	5,381,295.37	11.79
10	601988	中国银行	5,275,325.49	11.56
11	601336	新华保险	5,171,402.34	11.33
12	300308	中际旭创	5,084,061.86	11.14

13	000063	中兴通讯	4,929,940.16	10.80
14	300017	网宿科技	4,685,014.99	10.26
15	603233	大参林	4,532,297.10	9.93
16	603986	兆易创新	4,375,524.61	9.58
17	002714	牧原股份	4,316,129.72	9.45
18	600036	招商银行	4,164,297.41	9.12
19	000725	京东方A	4,134,364.54	9.06
20	600845	宝信软件	4,119,071.54	9.02
21	002007	华兰生物	4,018,312.96	8.80
22	600809	山西汾酒	3,978,984.31	8.72
23	600048	保利地产	3,945,992.61	8.64
24	600138	中青旅	3,924,268.70	8.60
25	300199	翰宇药业	3,466,339.86	7.59
26	601888	中国国旅	3,382,493.03	7.41
27	300059	东方财富	3,368,818.63	7.38
28	601233	桐昆股份	3,360,883.61	7.36
29	002463	沪电股份	3,303,635.70	7.24
30	000636	风华高科	3,206,161.48	7.02
31	002916	深南电路	3,121,670.21	6.84
32	300618	寒锐钴业	3,072,373.15	6.73
33	300498	温氏股份	2,756,342.88	6.04
34	600588	用友网络	2,755,591.19	6.04
35	300142	沃森生物	2,696,615.02	5.91
36	002049	紫光国微	2,560,969.06	5.61
37	601636	旗滨集团	2,556,981.07	5.60
38	600029	南方航空	2,522,092.75	5.52
39	603658	安图生物	2,519,718.97	5.52
40	000963	华东医药	2,501,112.76	5.48
41	002511	中顺洁柔	2,498,583.19	5.47
42	002009	天奇股份	2,410,488.19	5.28
43	300433	蓝思科技	2,401,787.92	5.26
44	002493	荣盛石化	2,401,784.68	5.26
45	600754	锦江股份	2,387,397.25	5.23
46	002727	一心堂	2,339,992.40	5.13
47	002268	卫士通	2,302,643.30	5.04
48	000333	美的集团	2,290,479.55	5.02
49	002024	苏宁易购	2,285,159.87	5.01
50	002680	*ST 长生	2,197,396.86	4.81

51	600521	华海药业	2,190,048.04	4.80
52	000651	格力电器	2,180,206.00	4.78
53	603826	坤彩科技	2,178,723.02	4.77
54	600606	绿地控股	2,132,676.52	4.67
55	600172	黄河旋风	2,115,125.85	4.63
56	603799	华友钴业	2,038,388.41	4.47
57	600346	恒力股份	2,025,560.84	4.44
58	600887	伊利股份	2,022,668.30	4.43
59	000895	双汇发展	2,021,932.53	4.43
60	000568	泸州老窖	2,005,560.42	4.39
61	603939	益丰药房	1,942,272.94	4.25
62	600340	华夏幸福	1,928,887.05	4.23
63	600323	瀚蓝环境	1,922,954.32	4.21
64	300236	上海新阳	1,919,706.05	4.21
65	600900	长江电力	1,860,473.93	4.08
66	002156	通富微电	1,841,698.37	4.03
67	603816	顾家家居	1,808,599.01	3.96
68	600383	金地集团	1,739,286.71	3.81
69	601288	农业银行	1,721,877.71	3.77
70	603690	至纯科技	1,694,896.38	3.71
71	300613	富瀚微	1,673,965.02	3.67
72	000661	长春高新	1,672,631.05	3.66
73	002497	雅化集团	1,669,771.13	3.66
74	300418	昆仑万维	1,646,399.24	3.61
75	002677	浙江美大	1,635,636.51	3.58
76	002151	北斗星通	1,630,660.00	3.57
77	300047	天源迪科	1,618,272.59	3.54
78	600276	恒瑞医药	1,604,047.75	3.51
79	600115	东方航空	1,555,900.78	3.41
80	600068	葛洲坝	1,538,667.00	3.37
81	300523	辰安科技	1,518,819.00	3.33
82	601607	上海医药	1,493,140.61	3.27
83	300143	星普医科	1,491,199.64	3.27
84	300136	信维通信	1,455,439.29	3.19
85	000001	平安银行	1,450,475.92	3.18
86	300070	碧水源	1,444,174.82	3.16
87	300388	国祯环保	1,422,018.70	3.11
88	002304	洋河股份	1,373,691.70	3.01

89	300529	健帆生物	1,351,795.45	2.96
90	300170	汉得信息	1,324,595.86	2.90
91	300383	光环新网	1,324,373.76	2.90
92	000039	中集集团	1,297,187.07	2.84
93	600763	通策医疗	1,284,440.60	2.81
94	300470	日机密封	1,280,260.50	2.80
95	601919	中远海控	1,278,170.15	2.80
96	600867	通化东宝	1,265,591.40	2.77
97	603387	基蛋生物	1,258,276.98	2.76
98	002001	新和成	1,253,774.52	2.75
99	002081	金螳螂	1,246,455.53	2.73
100	300437	清水源	1,238,965.00	2.71
101	601766	中国中车	1,225,610.00	2.68
102	603393	新天然气	1,202,230.10	2.63
103	002245	澳洋顺昌	1,188,840.33	2.60
104	300666	江丰电子	1,176,426.66	2.58
105	603369	今世缘	1,169,077.00	2.56
106	603818	曲美家居	1,165,584.28	2.55
107	300003	乐普医疗	1,148,588.41	2.52
108	601668	中国建筑	1,148,278.15	2.52
109	002773	康弘药业	1,146,980.44	2.51
110	600428	中远海特	1,138,254.00	2.49
111	000858	五粮液	1,132,324.24	2.48
112	601899	紫金矿业	1,124,330.04	2.46
113	300482	万孚生物	1,118,797.77	2.45
114	300251	光线传媒	1,111,690.71	2.44
115	600519	贵州茅台	1,101,275.21	2.41
116	300134	大富科技	1,065,404.65	2.33
117	601111	中国国航	1,064,656.44	2.33
118	600547	山东黄金	1,063,575.03	2.33
119	600584	长电科技	1,059,470.05	2.32
120	600362	江西铜业	1,054,858.07	2.31
121	000002	万科A	1,051,192.45	2.30
122	600028	中国石化	1,042,225.53	2.28
123	002366	台海核电	1,037,316.00	2.27
124	601328	交通银行	1,035,033.14	2.27
125	300377	赢时胜	1,024,093.32	2.24
126	002664	长鹰信质	1,013,846.53	2.22

127	300166	东方国信	1,001,459.40	2.19
128	603466	风语筑	999,553.96	2.19
129	002281	光迅科技	998,186.37	2.19
130	002456	欧菲科技	997,302.00	2.18
131	600740	山西焦化	982,935.10	2.15
132	600487	亨通光电	981,267.80	2.15
133	600466	蓝光发展	979,465.12	2.15
134	300285	国瓷材料	979,231.42	2.15
135	600600	青岛啤酒	974,966.35	2.14
136	300532	今天国际	970,324.99	2.13
137	603678	火炬电子	968,760.64	2.12
138	300315	掌趣科技	963,500.00	2.11
139	002192	融捷股份	958,290.30	2.10
140	603338	浙江鼎力	943,235.03	2.07
141	600498	烽火通信	942,117.68	2.06
142	002583	海能达	930,520.30	2.04
143	002353	杰瑞股份	927,873.39	2.03
144	603883	老百姓	923,246.00	2.02
145	002709	天赐材料	922,757.11	2.02

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	364,859,187.63
卖出股票收入（成交）总额	393,011,661.68

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

- 1) 本基金本报告期末未持有股指期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期末本基金未投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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

### 8.12.2

本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	52,952.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,937.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,889.43

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
821	40,456.26	9,149,060.37	27.55%	24,065,529.88	72.45%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,625,363.98	7.9000%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

注：本基金的基金经理同时为基金管理人高级管理人员。

### 9.4 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	4,975,124.38	14.98	4,975,124.38	14.98	3年
基金管理人高级管理人员	1,931,683.70	5.82	1,931,683.70	5.82	3年
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	4,173,935.99	12.57	4,173,935.99	12.57	3年
其他	-	-	-	-	-
合计	1,080,744.07	33.36	1,080,744.07	33.36	3年

注：本基金的基金经理同时为基金管理人高级管理人员。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年10月25日）基金份额总额	213,733,032.47
本报告期期初基金份额总额	44,375,628.61
本报告期期间基金总申购份额	1,779,008.77
减:本报告期期间基金总赎回份额	12,940,047.13
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	33,214,590.25

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2018 年 8 月 22 日发布公告，自 8 月 22 日起钟俊敏先生不再担任公司副总经理。于 2018 年 11 月 17 日公告，自 11 月 15 日起杨绍基先生不再担任公司总经理，自 11 月 15 日起聘任程文卫先生担任公司总经理、聘任陶安虎先生担任公司副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内为基金进行审计的会计师事务所由天健会计师事务所（特殊普通合伙）改聘为瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）。本年度支付给瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 20,000.00 元，该审计机构已提供审计服务年限为 1 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人接受了广东证监局的现场检查，根据广东证监局现场检查结果对发现的问题进行了整改，并在规定时间内完成整改，向广东证监局提交了整改完成报告。

除上述情况外，本报告期内管理人、托管人及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
国信证券		2369,210,118.91	48.72%	270,004.65	47.70%	-
兴业证券		2329,406,424.61	43.47%	240,894.17	42.56%	-
银河证券	2	59,244,900.79	7.82%	55,174.44	9.75%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
东莞证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

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

2、交易席位选择流程：

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	176,100,000.00	94.63%	-	-
银河证券	-	-	10,000,000.00	5.37%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中科沃土基金管理有限公司关于旗下基金 2017 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 1 月 2 日
2	中科沃土基金管理有限公司关于新增中正达广为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 2 月 12 日
3	中科沃土基金管理有限公司关于修订公司旗下货币市场基金和部	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 3 月 8 日

	分证券投资基金基金合同有关条款的公告	人网站	
4	中科沃土基金管理有限公司关于新增上海挖财为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 3 月 21 日
5	关于旗下部分基金参加中泰证券开展的基金申购（含定期定额申购）业务的费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 3 月 27 日
6	中科沃土基金管理有限公司关于新增洪泰财富为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 5 月 31 日
7	中科沃土基金管理有限公司关于新增万家财富为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 6 月 22 日
8	中科沃土基金旗下基金 2018 年 6 月 29 日基金资产净值和基金份额净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 6 月 30 日
9	中科沃土基金管理有限公司关于新增长量基金为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 8 月 8 日
10	中科沃土基金管理有限公司旗下基金更换会计师事务所公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018 年 11 月 20 日

## § 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鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的文件；
- 2、《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合同》；
- 3、《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鑫成长精选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

2019年3月28日