
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4季度报告

2021年12月31日

基金管理人:中科沃土基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2022年01月23日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年10月1日起至2021年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中科沃土沃瑞混合发起	
基金主代码	005855	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年01月14日	
报告期末基金份额总额	48,359,492.15份	
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	
下属分级基金的基金简称	中科沃土沃瑞A级	中科沃土沃瑞C级
下属分级基金的交易代码	005855	005856
报告期末下属分级基金的份额总额	23,429,379.84份	24,930,112.31份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2021年10月01日 - 2021年12月31日)	
	中科沃土沃瑞A级	中科沃土沃瑞C级
1. 本期已实现收益	1,811,879.31	2,256,413.89

2. 本期利润	2,668,370.97	2,351,134.21
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1173	0.0909
4. 期末基金资产净值	76,426,945.80	80,347,902.73
5. 期末基金份额净值	3.2620	3.2229

(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) 本报告所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的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A级净值表现

阶段	净值增长率①	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	4.05%	0.77%	1.15%	0.47%	2.90%	0.30%
过去六个月	9.76%	0.94%	-2.68%	0.61%	12.44%	0.33%
过去一年	46.17%	1.30%	-2.28%	0.70%	48.45%	0.60%
自基金合同生效起至今	226.20%	1.33%	36.90%	0.77%	189.30%	0.56%

中科沃土沃瑞C级净值表现

阶段	净值增长率①	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	4.31%	0.77%	1.15%	0.47%	3.16%	0.30%

月						
过去六个月	9.58%	0.95%	-2.68%	0.61%	12.26%	0.34%
过去一年	45.69%	1.30%	-2.28%	0.70%	47.97%	0.60%
自基金合同生效起至今	222.29%	1.33%	36.90%	0.77%	185.39%	0.56%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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





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

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林皓	基金经理	2019-11-08	-	5 年	学硕士。曾任中科沃土基金管理有限公司研究部研究员，现任中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾沃瑞基金四季度操作，产品整体保持中等仓位，在结构上围绕新能源、消费、半导体、金融进行配置，对部分消费电子相关公司进行了增持。

2022年投资策略展望：

宏观经济趋势：21年12月的中央经济工作会议指出22年经济工作要“稳字当头、稳中求进”，同时要求各地区各部门要担负起稳定宏观经济的责任，政策发力适当靠前。预计后续国内流动性保持宽松，结构性机会不断呈现。我们对权益市场保持中性偏乐观的看法。与此同时，也需要防范海外流动性收紧的阶段性风险。

展望22年，我们主要看好以下几个方面的机会：新能源产业链中的结构性机会（电动车的智能化，汽车芯片的国产化，光伏等）；消费电子的创新（VR/AR的硬件，折叠屏手机，智能家居等）；PPI下行中游制造的机会；CPI传导提价消费行业的机会；金融行业阶段性价值重估的机会等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中科沃土沃瑞A级基金份额净值为3.2620元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.05%，同期业绩比较基准收益率为1.15%；截至报告期末中科沃土沃瑞C级基金份额净值为3.2229元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.31%，同期业绩比较基准收益率为1.15%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，无相关预警说明。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	109,862,372.58	64.13
	其中：股票	109,862,372.58	64.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	321,000.00	0.19
	其中：债券	321,000.00	0.19
	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	30,000,000.00	17.51
	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	30,403,985.21	17.75
8	其他资产	717,840.39	0.42
9	合计	171,305,198.18	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	93,172,414.36	59.43
D	电力、热力、燃气及水生 生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	127,280.00	0.08
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	924,138.78	0.59
J	金融业	15,521,490.00	9.90
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	70,157.16	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	24,860.00	0.02
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	17,318.48	0.01
S	综合	-	-
	合计	109,862,372.58	70.08

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688008	澜起科技	99,000	8,303,130.00	5.30
2	002241	歌尔股份	90,000	4,869,000.00	3.11
3	002850	科达利	29,995	4,809,398.30	3.07
4	002597	金禾实业	90,000	4,621,500.00	2.95
5	603986	兆易创新	25,000	4,396,250.00	2.80
6	300709	精研科技	72,000	4,316,400.00	2.75
7	688598	金博股份	12,000	4,260,480.00	2.72
8	603198	迎驾贡酒	60,000	4,167,000.00	2.66
9	300073	当升科技	45,900	3,987,333.00	2.54
10	601166	兴业银行	190,000	3,617,600.00	2.31

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净
----	------	---------	--------

			值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	321,000.00	0.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	321,000.00	0.20

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	3,210	321,000.00	0.20

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					27,780.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

本报告期末本基金未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	378,952.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-641.99
5	应收申购款	339,529.90
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	717,840.39

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	中科沃土沃瑞A级	中科沃土沃瑞C级
报告期期初基金份额总额	22,836,313.90	42,669,809.76

报告期期间基金总申购份额	5,224,229.24	17,633,981.61
减：报告期期间基金总赎回份额	4,631,163.30	35,373,679.06
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	23,429,379.84	24,930,112.31

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

截止本报告批出日，本基金成立已满三年。本基金发起式份额持有期限满足发起式份额持有3年的承诺。

§ 9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 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

2022年01月23日