

中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人: 中科沃土基金管理有限公司

基金托管人: 浙商银行股份有限公司

送出日期: 2022 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日至2022年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
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遵规守信情况的说明	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	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	54
7.1 期末基金资产组合情况	54
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	70
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	71
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	71
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	71
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	71
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
7.12 投资组合报告附注	71
§8 基金份额持有人信息	72

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	73
§9 开放式基金份额变动	73
§10 重大事件揭示	73
10.1 基金份额持有人大会决议	73
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	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
10.4 基金投资策略的改变	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
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	74
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
10.8 其他重大事件	75
§11 影响投资者决策的其他重要信息	76
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	76
§12 备查文件目录	76
12.1 备查文件目录	76
12.2 存放地点	76
12.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中科沃土沃嘉混合	
基金主代码	004763	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年12月06日	
基金管理人	中科沃土基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	823,089,525.22份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中科沃土沃嘉混合A	中科沃土沃嘉混合C
下属分级基金的交易代码	004763	004764
报告期末下属分级基金的份额总额	570,363,928.15份	252,725,597.07份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活运用资产配置策略及多种股票市场、债券市场投资策略，充分挖掘潜在的投资机会，追求基金资产长期稳定增值。
投资策略	通过对经济周期及资产价格发展变化的理解，在把握经济周期性波动的基础上，动态评估不同资产类在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置及资产的稳健增长。基于稳健投资的理念，投资于优选行业中的绩优股票；对于债券投资，采用期限结构策略、信用策略、可转换债券投资策略等；适当参与股指期货、权证、国债期货等金融衍生品的投资，进行分散投资，力求实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数（全价）收益率×50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场

	基金。
--	-----

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中科沃土基金管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	曹萍	朱巍
	联系电话	0757-86208608	0571-87659806
	电子邮箱	caoping@richlandasm.com.cn	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		400-018-3610	95527
传真		0757-86208604	0571-88268688
注册地址		佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号千灯湖创投小镇核心区（自编号）十三座（B4）	杭州市萧山区鸿宁路1788号
办公地址		佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号千灯湖创投小镇核心区（自编号）十三座（B4）	杭州市延安路368号
邮政编码		528200	310006
法定代表人		智会杰	张荣森（代为履行法定代表人职责）

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.richlandasm.com.cn
基金中期报告备置地点	佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号千灯湖创投小镇核心区（自编号）十三座（B4）

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中科沃土基金管理有限公司	佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号 千灯湖创投小镇核心区（自编号） 十 三座（B4）

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日-2022年06月30日)	
	中科沃土沃嘉混合 A	中科沃土沃嘉混合 C
本期已实现收益	11,135,543.32	4,521,634.00
本期利润	5,166,937.41	1,936,611.91
加权平均基金份额本期利润	0.0091	0.0077
本期加权平均净值利润率	0.74%	0.64%
本期基金份额净值增长率	0.74%	0.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	139,032,489.40	54,308,211.90
期末可供分配基金份额利润	0.2438	0.2149
期末基金资产净值	709,396,417.55	307,033,808.97
期末基金份额净值	1.2438	1.2149
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	24.38%	21.49%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，

无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中科沃土沃嘉混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.14%	0.17%	4.69%	0.53%	-2.55%	-0.36%
过去三个月	2.40%	0.22%	3.25%	0.71%	-0.85%	-0.49%
过去六个月	0.74%	0.23%	-4.42%	0.73%	5.16%	-0.50%
过去一年	4.04%	0.20%	-6.16%	0.62%	10.20%	-0.42%
过去三年	45.20%	0.91%	10.38%	0.63%	34.82%	0.28%
自基金合同生效起至今	24.38%	0.82%	9.84%	0.65%	14.54%	0.17%

中科沃土沃嘉混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.12%	0.17%	4.69%	0.53%	-2.57%	-0.36%
过去三个月	2.34%	0.22%	3.25%	0.71%	-0.91%	-0.49%
过去六个月	0.64%	0.23%	-4.42%	0.73%	5.06%	-0.50%
过去一年	3.81%	0.20%	-6.16%	0.62%	9.97%	-0.42%
过去三年	41.66%	0.91%	10.38%	0.63%	31.28%	0.28%
自基金合同生效起至今	21.49%	0.82%	9.84%	0.65%	11.65%	0.17%

注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

中科沃土沃嘉混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年12月06日-2022年06月30日)



中科沃土沃嘉混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年12月06日-2022年06月30日)



注：本基金合同于 2017 年 12 月 6 日生效, 按基金合同和招募说明书的约定, 本基金的建仓期为六个月, 建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中科沃土基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2015]1937号文批准，于2015年9月6日正式成立，注册资本2.42亿元，是国内第100家公募基金管理公司，也是一家拥有PE背景的公募基金管理公司。中科沃土带着中科招商、粤科金融等主要股东强大的精神基因和优秀的文化基因，始终贯彻“持有人利益至上”的首要经营原则，遵循诚信、规范、稳健的经营方针，崇尚价值投资理念和长期、平稳、盈利的投资风格，致力于为持有人提供专业、精品、创新的投资理财服务，创造成长价值，汇聚阳光财富。截至2022年6月30日，中科沃土旗下共管理6只开放式基金：中科沃土货币市场基金、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金和中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孟禄程	基金经理、研究部总经理助理（主持工作）	2019-11-08	-	6年	理学硕士，曾任广东东阳光药业研究院研发工程师，广东中科招商创业投资管理有限公司公募筹备组组员，中科沃土基金管理有限公司研究部研究员、研究部总经理助理（主持工作），现任中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金和中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、研

					究部总经理助理。中国国籍，具有基金从业资格。
李欣桐	固定收益部副总经理（主持工作）、基金经理	2021-04-09	-	8年	国际经济法硕士。曾任粤开证券（原联讯证券）固定收益部交易员、资产管理部投资经理，北京康思资本管理有限公司投资交易部投资总监，现任中科沃土基金管理有限公司固定收益部副总经理（主持工作）、中科沃土货币市场基金、中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金和中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
董清源	固定收益部基金经理	2022-04-29	-	9年	金融学硕士。曾任北京康思资本管理有限公司债券交易员、投资经理、投资总监，首建投信和（北京）资产管理有限公司副总经理，北京康思资本管理有限公司副总经理，现任中科沃土基金管理有限公司中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土货币市场基金、中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金和中科沃土沃祥债券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“任职日期”为公告确定的聘任日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年二季度市场主要指数回调之后进行出现反弹实现上涨，上证指数上涨4.50%，深圳成指上涨6.42%，创业板指上涨5.68%，沪深300上涨6.21%。行业层面，二季度汽车、食品饮料、电力设备、美容护理、商贸零售涨幅居前，房地产、计算机、环保、传媒、银行、农业、医药等依然下跌。7月份市场进入快速上涨后的回调期，经济恢复进度与房地产风险成为市场关注重点，市场风格开始向中小市值转向，面对内外部复杂情况，构建国内国际双循环相互促进的新发展格局成为各行业趋势，也必然带来投资机会。

4月初，资金面超预期宽松，带动短端利率下行，同时受金融数据疲弱，上海等地疫情严重，“宽信用”政策效果未得到验证，机构投资者对于后市货币宽松的预期升温等因素影响，长端收益率下行至2.74%附近。当月中下旬，银行间流动性维持宽松，而货币宽松政策不及预期等诸多因素导致短端表现强于长端，10年活跃国债收益回调至

2.85%附近。进入5月份，资金利率中枢继续下移，银行间流动性维持极度宽松状态，短端资产维持强势，叠加北京疫情及经济电话会议的影响，长端利率下行至2.7%附近。5月末及6月初，因重点城市疫情逐步得到控制，稳增长政策频出，债市重回2.8%以上。6月份公布的金融数据好于预期，资金面因跨季因素向政策资金利率靠拢明显，长端利率进一步受到抑制。整体来看，二季度利率走势主要受疫情及资金面影响。短端利率下行明显，而长端利率整体处于2.74%-2.85%的小区间震荡。

一季度大幅调整之后，因国内疫情风险增加4月份市场再次出现调整，本基金股债均衡配置策略在下跌过程中体现出相对超额收益，疫情逐渐可控、政策发力显现，经济基本面将逐步改善，对权益市场预期得到修正出现较大反弹，二季度本基金仍采用股债均衡配置策略，小幅加仓权益市场，增配方向为医药（血制品、医疗器械、CRO、OTC个股）、仓储、储能，三季度以来增配自主可控方向。固收资产方面，采用久期策略、票息策略及骑乘策略，辅以交易等多种手段，在防范利率回调风险的同时，提高组合的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中科沃土沃嘉混合A基金份额净值为1.2438元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.74%，同期业绩比较基准收益率为-4.42%；截至报告期末中科沃土沃嘉混合C基金份额净值为1.2149元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.64%，同期业绩比较基准收益率为-4.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，宏观经济反弹力度大概率弱于预期，资金面有望延续宽松态势，权益市场仍处于较好的投资窗口，结构性机会较多，债券市场结构性资产荒延续。在此背景下，以十年期国债为代表的长端国债有望获得机构投资者重新定价，收益率有望震荡下行；短端资产则大概率跟随资金面而维持低位震荡。本基金接下来将重点关注增量宏观政策、资金面的边际变化趋势及经济变化趋势，力争通过多种投资策略，提高产品收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规的要求履行估值和净值计算的复核责任。

本基金管理人已制定基金估值和份额计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；设有估值委员会，负责指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运营等方面的专业胜任能力。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟

悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。基金管理人改变估值技术，导致基金净值变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“（三）基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期末进行利润分配，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，本基金不存在连续二十个工作日以上基金份额持有人数量不满二百人或者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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中科沃土基金管理有限公司编制和披露的中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金2022年中期报告中财务指标、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复核，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	269,316.75	73,846,772.13
结算备付金		8,976,572.72	2,652,271.83
存出保证金		38,009.37	27,703.63
交易性金融资产	6.4.7.2	657,534,180.76	585,536,314.12
其中：股票投资		164,914,309.35	174,101,132.72
基金投资		-	-
债券投资		492,619,871.41	411,435,181.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	344,859,095.67	373,750,000.00
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		6,403,910.82	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,289.75	809.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	11,724,833.66
资产总计		1,018,082,375.84	1,047,538,704.47

负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		510,814.30	37,179,798.15
应付赎回款		895.41	3,656.12
应付管理人报酬		660,341.07	652,862.61
应付托管费		123,813.97	122,411.74
应付销售服务费		49,871.12	42,856.51
应付投资顾问费		-	-
应交税费		18,953.64	12,412.98
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	287,459.81	236,694.10
负债合计		1,652,149.32	38,250,692.21
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	823,089,525.22	823,056,036.37
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	193,340,701.30	186,231,975.89
净资产合计		1,016,430,226.52	1,009,288,012.26
负债和净资产总计		1,018,082,375.84	1,047,538,704.47

注：报告截止日2022年6月30日，中科沃土沃嘉混合A基金份额净值1.2438元，基金份额总额570,363,928.15份；中科沃土沃嘉混合C基金份额净值1.2149元，基金份额总额252,725,597.07份。中科沃土沃嘉混合份额总额合计为823,089,525.22份。

6.2 利润表

会计主体：中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年01月01日 至2022年06月30 日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		12,218,397.86	30,913,211.73
1. 利息收入		11,661,137.84	17,062,583.82
其中：存款利息收入	6.4.7.9	235,083.49	214,043.15
债券利息收入		-	6,134,666.92
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		11,426,054.35	10,713,873.75
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		9,110,795.95	13,963,617.56
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,431,820.92	12,755,854.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	10,042,080.43	-80,461.56
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,500,536.44	1,288,224.98
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	-8,553,628.00	-117,295.92
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	92.07	4,306.27
减：二、营业总支出		5,114,848.54	4,523,246.41
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,958,444.68	3,398,987.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	742,208.43	637,310.17
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	298,993.46	1,544.59
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,398.97	75,395.21
其中：卖出回购金融资产支出		1,398.97	75,395.21
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		5,942.85	5,517.47
8. 其他费用	6.4.7.18	107,860.15	404,491.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,103,549.32	26,389,965.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,103,549.32	26,389,965.32
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,103,549.32	26,389,965.32

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	823,056,036.37	-	186,231,975.89	1,009,288,012.26

(基金净值)				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	823,056,036.37	-	186,231,975.89	1,009,288,012.26
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	33,488.85	-	7,108,725.41	7,142,214.26
(一)、综合收益总额	-	-	7,103,549.32	7,103,549.32
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	33,488.85	-	5,176.09	38,664.94
其中：1. 基金申购款	407,410.85	-	79,237.25	486,648.10
2. 基金赎回款	-373,922.00	-	-74,061.16	-447,983.16
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	823,089,525.22	-	193,340,701.30	1,016,430,226.52
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产 (基金净值)	5,059,726.10	-	772,243.30	5,831,969.40
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	5,059,726.10	-	772,243.30	5,831,969.40
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	856,025,637.90	-	167,534,043.80	1,023,559,681.70
(一)、综合收益总额	-	-	26,389,965.32	26,389,965.32
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	856,025,637.90	-	141,144,078.48	997,169,716.38
其中: 1. 基金申购款	859,590,521.79	-	141,722,614.74	1,001,313,136.53
2. 基金赎回款	-3,564,883.89	-	-578,536.26	-4,143,420.15
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	861,085,364.00	-	168,306,287.10	1,029,391,651.10

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

中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]第625号关于准予《中科沃土沃嘉灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由中科沃土基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币205,055,950.09元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2017)验字第61247680_G05号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年12月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为205,162,272.11份基金份额,其中认购资金利息折合106,322.02份基金份额。本基金的基金管理人为中科沃土基金管理有限公司,基金托管人为浙商银行股份有限公司(以下简称“浙商银行”)。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市交易的股票(包括中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票)、权证、股指期货、国债期货、债券(包括但不限于国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票占基金资产的比例为0%-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×50%+中债综合指数(全价)收益率×50%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年中期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022年 6月 30 日的财务状况以及 2022 上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

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

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有

的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

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

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

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

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

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

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

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

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

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

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

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

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

6.4.4.4 费用的确认和计量

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》、《企业会计准则第24号——套期会计》及《企业会计准则第37号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，财政部于2022年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14号)，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

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

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

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息和应收申购款，金额分别为73,846,772.13元、2,652,271.83元、27,703.63元、373,750,000.00元、11,724,833.66元和809.10元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为73,852,846.49元、2,653,325.73元、27,717.27元、373,939,380.01元、0.00元和809.10元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为585,536,314.12元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为597,064,625.87元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和应付交易费用，金额分别为37,179,798.15元、3,656.12元、652,862.61元、122,411.74元、42,856.51元和47,694.10元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-应付交易费用，金额分别为37,179,798.15元、3,656.12元、652,862.61元、122,411.74元、42,856.51元和47,694.10元。

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

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

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

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2022年06月30日	
活期存款	269,316.75	
等于：本金	267,404.29	
加：应计利息	1,912.46	
减：坏账准备	-	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
合计	269,316.75	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2022年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	180,351,078.33	-	164,914,309.35	-15,436,768.98	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	83,588,273.97	2,685,795.07	86,246,695.07	-27,373.97
	银行间市场	400,480,903.44	3,962,276.34	406,373,176.34	1,929,996.56

	合计	484,069,177.41	6,648,071.41	492,619,871.41	1,902,622.59
	资产支持证券	-	-	-	-
	基金	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	664,420,255.74	6,648,071.41	657,534,180.76	-13,534,146.39

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	308,851,303.08	-
银行间市场	36,007,792.59	-
合计	344,859,095.67	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本报告期末本基金无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	69,199.66
其中：交易所市场	61,724.97
银行间市场	7,474.69
应付利息	-
预提费用-审计费	29,752.78
预提费用-信息披露费	179,507.37
预提费用-账户维护费	9,000.00
合计	287,459.81

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 中科沃土沃嘉混合A

金额单位：人民币元

项目 (中科沃土沃嘉混合A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	570,439,264.52	570,439,264.52
本期申购	34,412.42	34,412.42
本期赎回(以“-”号填列)	-109,748.79	-109,748.79
本期末	570,363,928.15	570,363,928.15

6.4.7.7.2 中科沃土沃嘉混合C

金额单位：人民币元

项目 (中科沃土沃嘉混合C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	252,616,771.85	252,616,771.85
本期申购	372,998.43	372,998.43
本期赎回(以“-”号填列)	-264,173.21	-264,173.21
本期末	252,725,597.07	252,725,597.07

注：本期申购含转换转入份(金)额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 中科沃土沃嘉混合A

单位：人民币元

项目 (中科沃土沃嘉混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	132,538,782.34	1,342,317.39	133,881,099.73
本期利润	11,135,543.32	-5,968,605.91	5,166,937.41
本期基金份额交易产生的变动数	-18,397.37	2,849.63	-15,547.74
其中：基金申购款	8,218.44	-472.75	7,745.69
基金赎回款	-26,615.81	3,322.38	-23,293.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	143,655,928.29	-4,623,438.89	139,032,489.40

6.4.7.8.2 中科沃土沃嘉混合C

单位：人民币元

项目 (中科沃土沃嘉混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	51,612,422.93	738,453.23	52,350,876.16
本期利润	4,521,634.00	-2,585,022.09	1,936,611.91
本期基金份额交易产生的变动数	22,863.03	-2,139.20	20,723.83
其中：基金申购款	79,162.06	-7,670.50	71,491.56
基金赎回款	-56,299.03	5,531.30	-50,767.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	56,156,919.96	-1,848,708.06	54,308,211.90

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	131,706.83
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	103,127.94
其他	248.72
合计	235,083.49

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	84,243,153.37
减：卖出股票成本总额	86,433,230.36
减：交易费用	241,743.93
买卖股票差价收入	-2,431,820.92

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	8,601,536.89
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,440,543.54
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	10,042,080.43

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）	496,159,557.73

成交总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	481,833,626.14
减：应计利息总额	12,879,113.16
减：交易费用	6,274.89
买卖债券差价收入	1,440,543.54

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本报告期内本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,500,536.44
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,500,536.44

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-8,553,628.00
——股票投资	-7,426,870.52
——债券投资	-1,126,757.48

——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	-8,553,628.00

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	92.07
合计	92.07

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费-中债登	9,000.00
其他	600.00
账户维护费-上清所	9,000.00
合计	107,860.15

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

本报告期内未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。

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
浙商银行股份有限公司（“浙商银行”）	基金托管人、基金销售机构

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。

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通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无需支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,958,444.68	3,398,987.24
其中：支付销售机构的客户维护费	2,469.14	6,364.16

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

其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	742,208.43	637,310.17

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

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃嘉混合A	中科沃土沃嘉混合C	合计
中科沃土基金管理有限公司	0.00	298,211.31	298,211.31

浙商银行股份有限公司	0.00	45.75	45.75
合计	0.00	298,257.06	298,257.06
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃嘉混合A	中科沃土沃嘉混合C	合计
中科沃土基金管理有限 公司	0.00	4.73	4.73
浙商银行股份有限公司	0.00	62.63	62.63
合计	0.00	67.36	67.36

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

其计算公式为：日销售服务费=前一日C类的基金资产净值 X 0.20%/ 当年天数。

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发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行股份有限公司	269,316.75	131,706.83	20,683,310.14	154,508.50

注：本基金的银行存款由基金托管人浙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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600938	中国海油	2022-04-14	6个月	新股锁定	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688297	中无人机	2022-06-17	6个月	科创板打新限售	32.35	45.88	19,368	626,554.80	888,603.84	-
688400	凌云光	2022-06-27	7个交易日	新股未上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-
301175	中科环保	2022-06-30	6个交易日	新股未上市	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个交易日	新股未上市	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	9个交易日	新股未上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301238	瑞泰新材	2022-06-10	6个月	创业板打新限售	19.18	32.07	3,094	59,342.92	99,224.58	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	8个交易日	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301200	大族数控	2022-02-18	6个月	创业板打新限售	76.56	51.92	686	52,520.16	35,617.12	-

301216	万凯新材	2022-03-21	6个月	创业板打新限售	35.68	29.84	1,073	38,284.64	32,018.32	-
301215	中汽股份	2022-02-28	6个月	创业板打新限售	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.7	-
301109	军信股份	2022-04-06	6个月	创业板打新限售	23.20	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6个月	创业板打新限售	96.66	87.82	324	31,316.40	28,453.68	-
301302	华如科技	2022-06-16	6个月	创业板打新限售	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
301266	宇邦新材	2022-05-30	6个月	创业板打新限售	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-
301175	中科环保	2022-06-30	6个月	创业板打新限售	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40	-
301268	铭利达	2022-03-29	6个月	创业板打新限售	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301139	元道通信	2022-06-	6个月	创业板打	38.46	38.46	566	21,768.3	21,768.3	-

		30		新限售				6	6	
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6个月	创业板打新限售	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301187	欧圣电气	2022-04-13	6个月	创业板打新限售	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	6个月	创业板打新限售	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
301256	华融化学	2022-03-14	6个月	创业板打新限售	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月	创业板打新限售	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	6个月	创业板打新限售	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301120	新特电气	2022-04-11	6个月	创业板打新限售	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月	创业板打新限售	55.57	30.03	529	29,396.53	15,885.87	-

301286	侨源股份	2022-06-06	6个月	创业板打新限售	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301151	冠龙节能	2022-03-30	6个月	创业板打新限售	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301160	翔楼新材	2022-05-25	6个月	创业板打新限售	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-
301248	杰创智能	2022-04-13	6个月	创业板打新限售	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6个月	创业板打新限售	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
001309	德明利	2022-06-23	6个交易日	新股未上市	26.54	26.54	500	13,270.00	13,270.00	-
301298	东利机械	2022-05-27	6个月	创业板打新限售	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301259	艾布鲁	2022-04-18	6个月	创业板打新限售	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301112	信邦智能	2022-06-20	6个月	创业板打新限售	27.53	45.04	266	7,322.98	11,980.64	-

				售						
3011 16	益客 食品	2022 -01- 10	6个 月	创业 板打 新限 售	11.4 0	20.4 6	577	6,57 7.80	11,8 05.4 2	-
3012 20	亚香 股份	2022 -06- 15	6个 月	创业 板打 新限 售	35.9 8	39.1 5	285	10,2 54.3 0	11,1 57.7 5	-
3012 37	和顺 科技	2022 -03- 16	6个 月	创业 板打 新限 售	56.6 9	41.8 6	261	14,7 96.0 9	10,9 25.4 6	-
3011 37	哈焊 华通	2022 -03- 14	6个 月	创业 板打 新限 售	15.3 7	15.9 9	644	9,89 8.28	10,2 97.5 6	-
3011 96	唯科 科技	2022 -01- 04	6个 月	创业 板打 新限 售	64.0 8	37.5 2	271	17,3 65.6 8	10,1 67.9 2	-
3012 22	浙江 恒威	2022 -03- 02	6个 月	创业 板打 新限 售	33.9 8	28.9 6	332	11,2 81.3 6	9,61 4.72	-
3012 88	清研 环境	2022 -04- 14	6个 月	创业 板打 新限 售	19.0 9	19.9 8	452	8,62 8.68	9,03 0.96	-
3011 25	腾亚 精工	2022 -05- 27	6个 月	创业 板打 新限 售	22.4 9	27.4 2	327	7,35 4.23	8,96 6.34	-
3011	西点	2022	6个	创业	22.5	37.7	237	5,34	8,93	-

30	药业	-02-16	月	板打新限售	5	0		4.35	4.90	
301135	瑞德智能	2022-04-01	6个月	创业板打新限售	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301110	青木股份	2022-03-04	6个月	创业板打新限售	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301181	标榜股份	2022-02-11	6个月	创业板打新限售	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6个月	创业板打新限售	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-

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

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场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交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人浙商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于2022年6月30日，本基金持有除国债、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为22.34%。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	155,858,665.76	40,028,000.00
合计	155,858,665.76	40,028,000.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为剩余期限一年以内政策性金融债、短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	34,961,365.38	39,316,000.00
合计	34,961,365.38	39,316,000.00

注：短期同业存单评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	66,760,180.00	749,000.00
AAA以下	40,199,430.14	76,803,181.40
未评级	194,840,230.13	254,539,000.00

合计	301,799,840.27	332,091,181.40
----	----------------	----------------

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年0 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	269,316.75	-	-	-	269,316.75
结算备付金	8,974,542.32	-	-	2,030.40	8,976,572.72
存出保证金	38,009.37	-	-	-	38,009.37
交易性金融资产	211,532,946.21	228,470,253.97	52,616,671.23	164,914,309.35	657,534,180.76
买入返售金融资产	344,859,095.67	-	-	-	344,859,095.67
应收清算款	-	-	-	6,403,910.82	6,403,910.82
应收申购款	-	-	-	1,289.75	1,289.75
资产总计	565,673,910.32	228,470,253.97	52,616,671.23	171,321,540.32	1,018,082,375.84
负债					
应付清算款	-	-	-	510,814.30	510,814.30
应付赎回款	-	-	-	895.41	895.41
应付管理人报酬	-	-	-	660,341.07	660,341.07
应付托管费	-	-	-	123,813.97	123,813.97
应付销售服务费	-	-	-	49,871.12	49,871.12
应交税	-	-	-	18,953.64	18,953.64

费					
其他负债	-	-	-	287,459.81	287,459.81
负债总计	-	-	-	1,652,149.32	1,652,149.32
利率敏感度缺口	565,673,910.32	228,470,253.97	52,616,671.23	169,669,391.00	1,016,430,226.52
上年度末 2021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	73,846,772.13	-	-	-	73,846,772.13
结算备付金	2,652,271.83	-	-	-	2,652,271.83
存出保证金	27,703.63	-	-	-	27,703.63
交易性金融资产	156,597,500.00	171,764,681.40	83,073,000.00	174,101,132.72	585,536,314.12
买入返售金融资产	373,750,000.00	-	-	-	373,750,000.00
应收利息	-	-	-	11,724,833.66	11,724,833.66
应收申购款	-	-	-	809.10	809.10
资产总计	606,874,247.59	171,764,681.40	83,073,000.00	185,826,775.48	1,047,538,704.47
负债					
应付证券清算款	-	-	-	37,179,798.15	37,179,798.15
应付赎回款	-	-	-	3,656.12	3,656.12
应付管理人报酬	-	-	-	652,862.61	652,862.61
应付托管费	-	-	-	122,411.74	122,411.74
应付销售服务	-	-	-	42,856.51	42,856.51

费					
应付交易费用	-	-	-	47,694.10	47,694.10
应交税费	-	-	-	12,412.98	12,412.98
其他负债	-	-	-	189,000.00	189,000.00
负债总计	-	-	-	38,250,692.21	38,250,692.21
利率敏感度缺口	606,874,247.59	171,764,681.40	83,073,000.00	147,576,083.27	1,009,288,012.26

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他变量不变，只有利率变动通过债券公允价值变动对基金资产净值产生影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	1. 利率上升25个基点	-3,133,883.14	-2,860,660.07
2. 利率下降25个基点	3,133,883.14	2,860,660.07	

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的股票价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	164,914,309.35	16.22	174,101,132.72	17.25
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	164,914,309.35	16.22	174,101,132.72	17.25

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	4,483,535.53	8,179,302.30
	业绩比较基准下降5%	-4,483,535.53	-8,179,302.30

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值

所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	160,995,720.33	169,024,395.83
第二层次	493,640,136.25	411,362,729.35
第三层次	2,898,324.18	5,149,188.94
合计	657,534,180.76	585,536,314.12

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	164,914,309.35	16.20
	其中：股票	164,914,309.35	16.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	492,619,871.41	48.39
	其中：债券	492,619,871.41	48.39
	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	344,859,095.67	33.87
	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	9,245,889.47	0.91
8	其他各项资产	6,443,209.94	0.63
9	合计	1,018,082,375.84	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	852,889.00	0.08
B	采矿业	5,969,484.89	0.59
C	制造业	98,304,491.79	9.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,177,365.27	0.41
E	建筑业	3,060,966.64	0.30
F	批发和零售业	637,591.50	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	4,485,542.00	0.44

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,322,401.83	0.52
J	金融业	32,024,239.78	3.15
K	房地产业	2,818,779.00	0.28
L	租赁和商务服务业	2,648,636.06	0.26
M	科学研究和技术服务业	2,378,131.25	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	305,055.82	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	78,165.00	0.01
Q	卫生和社会工作	1,657,081.52	0.16
R	文化、体育和娱乐业	193,488.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	164,914,309.35	16.22

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	4,800	9,816,000.00	0.97
2	300750	宁德时代	8,500	4,539,000.00	0.45
3	600036	招商银行	96,000	4,051,200.00	0.40
4	601318	中国平安	86,054	4,017,861.26	0.40
5	000858	五粮液	15,100	3,049,143.00	0.30
6	601166	兴业银行	120,000	2,388,000.00	0.23
7	000333	美的集团	37,700	2,276,703.00	0.22
8	300059	东方财富	88,000	2,235,200.00	0.22
9	600900	长江电力	89,700	2,073,864.00	0.20

10	601888	中国中免	8,900	2,073,077.00	0.20
11	300633	开立医疗	68,000	2,042,040.00	0.20
12	002594	比亚迪	6,000	2,000,940.00	0.20
13	600309	万华化学	20,300	1,968,897.00	0.19
14	600030	中信证券	77,050	1,668,903.00	0.16
15	000403	派林生物	71,000	1,559,160.00	0.15
16	600887	伊利股份	39,600	1,542,420.00	0.15
17	000568	泸州老窖	6,100	1,503,894.00	0.15
18	300294	博雅生物	41,300	1,484,735.00	0.15
19	002475	立讯精密	43,400	1,466,486.00	0.14
20	603259	药明康德	14,000	1,455,860.00	0.14
21	002415	海康威视	37,900	1,371,980.00	0.13
22	600276	恒瑞医药	36,440	1,351,559.60	0.13
23	600938	中国海油	84,005	1,332,320.89	0.13
24	600438	通威股份	21,900	1,310,934.00	0.13
25	600809	山西汾酒	3,980	1,292,704.00	0.13
26	000001	平安银行	84,800	1,270,304.00	0.12
27	300760	迈瑞医疗	4,000	1,252,800.00	0.12
28	000651	格力电器	35,800	1,207,176.00	0.12
29	601398	工商银行	249,000	1,187,730.00	0.12
30	002812	恩捷股份	4,600	1,152,070.00	0.11
31	300122	智飞生物	10,300	1,143,403.00	0.11
32	002142	宁波银行	31,030	1,111,184.30	0.11
33	601899	紫金矿业	117,100	1,092,543.00	0.11
34	002129	TCL中环	18,400	1,083,576.00	0.11
35	603288	海天味业	11,560	1,044,561.60	0.10
36	000002	万科A	50,000	1,025,000.00	0.10
37	002466	天齐锂业	8,200	1,023,360.00	0.10
38	601328	交通银行	195,000	971,100.00	0.10
39	600048	保利发展	55,300	965,538.00	0.09
40	000792	盐湖股份	32,000	958,720.00	0.09

41	300015	爱尔眼科	21,255	951,586.35	0.09
42	002460	赣锋锂业	6,300	936,810.00	0.09
43	300124	汇川技术	14,050	925,473.50	0.09
44	002304	洋河股份	4,900	897,435.00	0.09
45	601088	中国神华	26,800	892,440.00	0.09
46	688297	中无人机	19,368	888,603.84	0.09
47	002352	顺丰控股	15,900	887,379.00	0.09
48	601668	中国建筑	164,700	876,204.00	0.09
49	300014	亿纬锂能	8,900	867,750.00	0.09
50	600436	片仔癀	2,400	856,152.00	0.08
51	600690	海尔智家	30,800	845,768.00	0.08
52	300274	阳光电源	8,300	815,475.00	0.08
53	603799	华友钴业	8,070	771,653.40	0.08
54	601288	农业银行	249,600	753,792.00	0.07
55	600406	国电南瑞	27,000	729,000.00	0.07
56	601816	京沪高铁	142,700	716,354.00	0.07
57	601012	隆基绿能	10,744	715,872.72	0.07
58	002271	东方雨虹	13,900	715,433.00	0.07
59	603501	韦尔股份	4,100	709,423.00	0.07
60	000625	长安汽车	40,118	694,843.76	0.07
61	002241	歌尔股份	20,400	685,440.00	0.07
62	600585	海螺水泥	19,300	680,904.00	0.07
63	600161	天坛生物	28,000	679,840.00	0.07
64	600837	海通证券	69,300	679,833.00	0.07
65	600104	上汽集团	38,000	676,780.00	0.07
66	601919	中远海控	48,400	672,760.00	0.07
67	000063	中兴通讯	26,200	668,886.00	0.07
68	600000	浦发银行	83,300	667,233.00	0.07
69	601225	陕西煤业	31,500	667,170.00	0.07
70	000725	京东方 A	167,600	660,344.00	0.06
71	600111	北方稀土	18,700	657,492.00	0.06

72	600016	民生银行	176,300	655,836.00	0.06
73	603986	兆易创新	4,600	654,166.00	0.06
74	002049	紫光国微	3,400	645,048.00	0.06
75	300142	沃森生物	12,700	614,553.00	0.06
76	002230	科大讯飞	14,900	614,178.00	0.06
77	600919	江苏银行	84,600	602,352.00	0.06
78	002459	晶澳科技	7,500	591,750.00	0.06
79	601688	华泰证券	41,500	589,300.00	0.06
80	002371	北方华创	2,100	581,952.00	0.06
81	601601	中国太保	24,400	574,132.00	0.06
82	300450	先导智能	8,900	562,302.00	0.06
83	002027	分众传媒	82,200	553,206.00	0.05
84	002714	牧原股份	10,000	552,700.00	0.05
85	601169	北京银行	116,600	529,364.00	0.05
86	600745	闻泰科技	6,200	527,682.00	0.05
87	601985	中国核电	76,400	524,104.00	0.05
88	600660	福耀玻璃	12,000	501,720.00	0.05
89	600019	宝钢股份	82,400	496,048.00	0.05
90	601211	国泰君安	32,500	494,000.00	0.05
91	600893	航发动力	10,800	491,508.00	0.05
92	601669	中国电建	62,100	488,727.00	0.05
93	688981	中芯国际	10,800	487,836.00	0.05
94	601988	中国银行	149,300	486,718.00	0.05
95	000338	潍柴动力	38,600	481,342.00	0.05
96	300347	泰格医药	4,200	480,690.00	0.05
97	601009	南京银行	46,000	479,320.00	0.05
98	000100	TCL科技	99,400	476,126.00	0.05
99	601658	邮储银行	88,000	474,320.00	0.05
100	000661	长春高新	2,000	466,840.00	0.05
101	601229	上海银行	70,700	463,085.00	0.05
102	600050	中国联通	132,300	457,758.00	0.05

103	601766	中国中车	87,400	454,480.00	0.04
104	002179	中航光电	7,140	452,104.80	0.04
105	300628	亿联网络	5,900	449,285.00	0.04
106	601390	中国中铁	73,100	448,834.00	0.04
107	688599	天合光能	6,700	437,175.00	0.04
108	600010	包钢股份	185,300	435,455.00	0.04
109	600588	用友网络	20,000	434,200.00	0.04
110	600028	中国石化	105,000	428,400.00	0.04
111	600905	三峡能源	67,763	426,229.27	0.04
112	300896	爱美客	700	420,007.00	0.04
113	002410	广联达	7,700	419,188.00	0.04
114	601628	中国人寿	13,300	413,364.00	0.04
115	600570	恒生电子	9,440	411,017.60	0.04
116	600958	东方证券	40,000	408,400.00	0.04
117	002050	三花智控	14,700	403,956.00	0.04
118	000895	双汇发展	13,700	401,410.00	0.04
119	600009	上海机场	7,000	396,900.00	0.04
120	002311	海大集团	6,600	396,066.00	0.04
121	000776	广发证券	21,000	392,700.00	0.04
122	300496	中科创达	3,000	391,440.00	0.04
123	300782	卓胜微	2,880	388,800.00	0.04
124	600426	华鲁恒升	13,300	388,360.00	0.04
125	600346	恒力石化	17,100	380,304.00	0.04
126	600196	复星医药	8,500	374,765.00	0.04
127	600460	士兰微	7,200	374,400.00	0.04
128	600703	三安光电	15,000	368,700.00	0.04
129	600926	杭州银行	24,600	368,508.00	0.04
130	601857	中国石油	68,900	365,170.00	0.04
131	601818	光大银行	117,700	354,277.00	0.03
132	300316	晶盛机电	5,200	351,468.00	0.03
133	600741	华域汽车	14,800	340,400.00	0.03

134	600176	中国巨石	19,500	339,495.00	0.03
135	002493	荣盛石化	22,000	338,580.00	0.03
136	001979	招商蛇口	25,000	335,750.00	0.03
137	002709	天赐材料	5,400	335,124.00	0.03
138	601989	中国重工	90,100	334,271.00	0.03
139	002001	新和成	14,400	328,464.00	0.03
140	603019	中科曙光	11,200	325,024.00	0.03
141	601633	长城汽车	8,700	322,248.00	0.03
142	603993	洛阳钼业	55,900	320,307.00	0.03
143	601138	工业富联	32,300	317,832.00	0.03
144	600999	招商证券	22,000	317,020.00	0.03
145	688111	金山办公	1,600	315,392.00	0.03
146	000768	中航西飞	10,400	315,016.00	0.03
147	600763	通策医疗	1,800	313,992.00	0.03
148	000963	华东医药	6,900	311,604.00	0.03
149	601877	正泰电器	8,700	311,286.00	0.03
150	601838	成都银行	18,400	305,072.00	0.03
151	600600	青岛啤酒	2,900	301,368.00	0.03
152	300498	温氏股份	14,100	300,189.00	0.03
153	300759	康龙化成	3,150	299,943.00	0.03
154	002291	星期六	15,000	296,400.00	0.03
155	000786	北新建材	8,500	294,270.00	0.03
156	601600	中国铝业	61,900	294,025.00	0.03
157	002202	金风科技	19,800	293,040.00	0.03
158	601111	中国国航	25,200	292,572.00	0.03
159	002821	凯莱英	1,000	289,000.00	0.03
160	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.03
161	601006	大秦铁路	43,000	283,370.00	0.03
162	600188	兖矿能源	7,100	280,308.00	0.03
163	300408	三环集团	9,300	279,930.00	0.03
164	600760	中航沈飞	4,600	278,070.00	0.03

165	600989	宝丰能源	18,800	275,420.00	0.03
166	600150	中国船舶	14,500	275,210.00	0.03
167	600085	同仁堂	5,200	274,976.00	0.03
168	600795	国电电力	70,200	274,482.00	0.03
169	601377	兴业证券	38,500	271,425.00	0.03
170	601238	广汽集团	17,700	269,748.00	0.03
171	003816	中国广核	95,600	267,680.00	0.03
172	601066	中信建投	9,200	265,972.00	0.03
173	603369	今世缘	5,200	265,200.00	0.03
174	600029	南方航空	35,900	262,429.00	0.03
175	000166	申万宏源	61,000	261,690.00	0.03
176	601186	中国铁建	33,000	260,700.00	0.03
177	601800	中国交建	27,800	257,984.00	0.03
178	601939	建设银行	41,700	252,702.00	0.02
179	000596	古井贡酒	1,000	249,660.00	0.02
180	601868	中国能建	105,100	249,087.00	0.02
181	600886	国投电力	23,400	245,700.00	0.02
182	300751	迈为股份	500	245,450.00	0.02
183	000301	东方盛虹	14,500	245,195.00	0.02
184	600011	华能国际	34,700	244,288.00	0.02
185	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.02
186	600584	长电科技	8,900	240,300.00	0.02
187	600547	山东黄金	12,900	239,424.00	0.02
188	002930	宏川智慧	12,100	239,217.00	0.02
189	600132	重庆啤酒	1,600	234,560.00	0.02
190	688005	容百科技	1,800	232,992.00	0.02
191	603486	科沃斯	1,900	231,591.00	0.02
192	002236	大华股份	14,100	231,522.00	0.02
193	600115	中国东航	41,600	228,384.00	0.02
194	601100	恒立液压	3,700	228,364.00	0.02
195	600015	华夏银行	43,700	227,677.00	0.02

196	600383	金地集团	16,800	225,792.00	0.02
197	603392	万泰生物	1,450	225,185.00	0.02
198	000938	紫光股份	11,500	223,100.00	0.02
199	002555	三七互娱	10,500	222,915.00	0.02
200	601788	光大证券	13,900	219,064.00	0.02
201	300661	圣邦股份	1,200	218,424.00	0.02
202	601901	方正证券	32,500	218,075.00	0.02
203	000157	中联重科	35,300	217,448.00	0.02
204	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.02
205	300595	欧普康视	3,800	217,322.00	0.02
206	600352	浙江龙盛	21,200	215,816.00	0.02
207	601336	新华保险	6,600	212,454.00	0.02
208	000977	浪潮信息	8,000	211,840.00	0.02
209	603833	欧派家居	1,400	210,952.00	0.02
210	688012	中微公司	1,800	210,150.00	0.02
211	000425	徐工机械	38,900	209,671.00	0.02
212	603517	绝味食品	3,600	208,152.00	0.02
213	688008	澜起科技	3,400	205,972.00	0.02
214	002008	大族激光	6,200	205,406.00	0.02
215	601799	星宇股份	1,200	205,200.00	0.02
216	300003	乐普医疗	10,900	202,413.00	0.02
217	600031	三一重工	10,600	202,036.00	0.02
218	002736	国信证券	20,700	198,099.00	0.02
219	002007	华兰生物	8,600	196,080.00	0.02
220	002841	视源股份	2,600	195,832.00	0.02
221	002252	上海莱士	32,900	195,097.00	0.02
222	300413	芒果超媒	5,800	193,488.00	0.02
223	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.02
224	300529	健帆生物	3,800	193,382.00	0.02
225	000069	华侨城 A	29,200	189,508.00	0.02
226	002120	韵达股份	11,000	187,660.00	0.02

227	002601	龙佰集团	9,300	186,465.00	0.02
228	603806	福斯特	2,840	186,076.80	0.02
229	688396	华润微	3,100	183,117.00	0.02
230	603882	金域医学	2,200	181,610.00	0.02
231	601618	中国中冶	50,500	176,750.00	0.02
232	301263	泰恩康	5,000	173,800.00	0.02
233	002602	世纪华通	35,200	169,664.00	0.02
234	601117	中国化学	18,000	169,380.00	0.02
235	000066	中国长城	15,600	168,792.00	0.02
236	000703	恒逸石化	15,900	167,109.00	0.02
237	601728	中国电信	44,073	164,392.29	0.02
238	600332	白云山	5,200	164,268.00	0.02
239	300999	金龙鱼	3,000	162,060.00	0.02
240	000708	中信特钢	8,000	161,200.00	0.02
241	600183	生益科技	9,300	158,007.00	0.02
242	601021	春秋航空	2,700	157,545.00	0.02
243	601865	福莱特	4,100	156,210.00	0.02
244	300033	同花顺	1,600	153,840.00	0.02
245	603260	合盛硅业	1,300	153,348.00	0.02
246	000876	新希望	10,000	153,000.00	0.02
247	600489	中金黄金	20,700	152,973.00	0.02
248	688036	传音控股	1,700	151,691.00	0.01
249	603899	晨光股份	2,700	151,416.00	0.01
250	300433	蓝思科技	13,600	150,552.00	0.01
251	600845	宝信软件	2,750	150,150.00	0.01
252	002916	深南电路	1,600	149,936.00	0.01
253	600362	江西铜业	8,400	149,772.00	0.01
254	300223	北京君正	1,400	148,750.00	0.01
255	002938	鹏鼎控股	4,900	148,029.00	0.01
256	002920	德赛西威	1,000	148,000.00	0.01
257	600018	上港集团	25,000	145,750.00	0.01

258	002675	东诚药业	10,000	135,000.00	0.01
259	601898	中煤能源	12,800	132,864.00	0.01
260	300318	博晖创新	20,000	130,800.00	0.01
261	002568	百润股份	4,340	130,373.60	0.01
262	603659	璞泰来	1,500	126,600.00	0.01
263	601319	中国人保	25,000	126,500.00	0.01
264	601878	浙商证券	11,100	126,318.00	0.01
265	603185	上机数控	800	124,792.00	0.01
266	688169	石头科技	200	123,340.00	0.01
267	002414	高德红外	9,520	122,522.40	0.01
268	601966	玲珑轮胎	4,800	121,776.00	0.01
269	600941	中国移动	2,000	121,000.00	0.01
270	688126	沪硅产业	5,200	119,496.00	0.01
271	601216	君正集团	24,100	117,608.00	0.01
272	600061	国投资本	18,372	116,845.92	0.01
273	002791	坚朗五金	900	116,748.00	0.01
274	603290	斯达半导	300	115,770.00	0.01
275	601998	中信银行	24,200	114,950.00	0.01
276	688363	华熙生物	800	113,744.00	0.01
277	002294	信立泰	4,000	112,400.00	0.01
278	688561	奇安信	2,000	111,600.00	0.01
279	600219	南山铝业	30,000	110,700.00	0.01
280	600089	特变电工	4,000	109,560.00	0.01
281	600606	绿地控股	27,535	109,038.60	0.01
282	300957	贝泰妮	500	108,765.00	0.01
283	603195	公牛集团	700	107,037.00	0.01
284	600655	豫园股份	11,300	106,672.00	0.01
285	000408	藏格矿业	3,200	105,408.00	0.01
286	603160	汇顶科技	1,700	105,281.00	0.01
287	300454	深信服	1,000	103,780.00	0.01
288	601995	中金公司	2,300	102,327.00	0.01

289	002212	天融信	10,000	101,500.00	0.01
290	002600	领益智造	20,100	100,902.00	0.01
291	600025	华能水电	14,200	99,258.00	0.01
292	301238	瑞泰新材	3,094	99,224.58	0.01
293	688248	南网科技	3,963	91,624.56	0.01
294	601881	中国银河	9,300	89,931.00	0.01
295	000538	云南白药	1,460	88,169.40	0.01
296	300979	华利集团	1,200	87,696.00	0.01
297	600358	国旅联合	12,000	86,880.00	0.01
298	300763	锦浪科技	400	85,200.00	0.01
299	002064	华峰化学	9,900	83,556.00	0.01
300	002607	中公教育	13,500	78,165.00	0.01
301	300866	安克创新	1,100	72,952.00	0.01
302	601808	中海油服	4,700	65,565.00	0.01
303	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
304	002032	苏泊尔	1,100	61,974.00	0.01
305	000800	一汽解放	6,600	61,644.00	0.01
306	000877	天山股份	5,000	61,500.00	0.01
307	601236	红塔证券	6,510	59,436.30	0.01
308	603087	甘李药业	1,200	57,564.00	0.01
309	605499	东鹏饮料	300	51,258.00	0.01
310	601825	沪农商行	8,000	50,160.00	0.00
311	300919	中伟股份	400	49,560.00	0.00
312	600185	格力地产	7,800	49,218.00	0.00
313	600918	中泰证券	6,100	46,665.00	0.00
314	301050	雷电微力	419	42,553.64	0.00
315	301200	大族数控	753	39,235.12	0.00
316	301219	腾远钴业	440	39,181.36	0.00
317	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
318	000513	丽珠集团	1,000	36,210.00	0.00
319	601698	中国卫通	3,200	36,192.00	0.00

320	002648	卫星化学	1,399	36,164.15	0.00
321	301216	万凯新材	1,128	33,753.57	0.00
322	301187	欧圣电气	1,376	32,975.04	0.00
323	301302	华如科技	551	31,505.62	0.00
324	301215	中汽股份	4,821	30,849.09	0.00
325	301109	军信股份	1,875	30,299.13	0.00
326	601155	新城控股	1,100	27,973.00	0.00
327	301181	标榜股份	864	27,352.40	0.00
328	301069	凯盛新材	586	27,020.46	0.00
329	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.00
330	301268	铭利达	707	24,886.07	0.00
331	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
332	688065	凯赛生物	200	22,360.00	0.00
333	301102	兆讯传媒	714	22,353.06	0.00
334	001289	龙源电力	1,000	21,760.00	0.00
335	603051	鹿山新材	272	21,488.00	0.00
336	001308	康冠科技	667	19,456.39	0.00
337	301127	天源环保	1,743	19,399.59	0.00
338	301166	优宁维	328	19,306.08	0.00
339	301091	深城交	702	19,164.60	0.00
340	301123	奕东电子	751	19,140.09	0.00
341	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
342	002074	国轩高科	400	18,240.00	0.00
343	300834	星辉环材	590	17,731.73	0.00
344	301286	侨源股份	839	16,772.11	0.00
345	301093	华兰股份	488	16,538.32	0.00
346	301103	何氏眼科	515	16,506.62	0.00
347	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
348	301048	金鹰重工	1,424	15,678.24	0.00
349	001317	三羊马	300	15,222.00	0.00
350	301190	善水科技	641	15,210.93	0.00

351	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
352	300982	苏文电能	317	14,886.32	0.00
353	301100	风光股份	685	14,782.30	0.00
354	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
355	301118	恒光股份	342	14,716.26	0.00
356	301189	奥尼电子	435	14,489.85	0.00
357	300601	康泰生物	320	14,457.60	0.00
358	301130	西点药业	370	14,254.90	0.00
359	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
360	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
361	301088	戎美股份	736	13,733.76	0.00
362	301116	益客食品	664	13,615.02	0.00
363	001309	德明利	500	13,270.00	0.00
364	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
365	301078	孩子王	851	12,475.66	0.00
366	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
367	301112	信邦智能	266	11,980.64	0.00
368	301196	唯科科技	305	11,455.16	0.00
369	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
370	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
371	301108	洁雅股份	280	11,079.60	0.00
372	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
373	301185	鸥玛软件	578	10,687.22	0.00
374	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
375	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
376	605289	罗曼股份	474	9,375.72	0.00
377	301198	喜悦智行	407	9,177.85	0.00
378	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
379	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
380	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
381	300596	利安隆	200	8,822.00	0.00

382	301110	青木股份	213	8,526.00	0.00
383	300985	致远新能	295	8,466.50	0.00
384	603150	万朗磁塑	250	7,442.50	0.00
385	301072	中捷精工	202	6,470.06	0.00
386	300207	欣旺达	200	6,320.00	0.00
387	300998	宁波方正	201	6,080.25	0.00
388	301079	邵阳液压	196	4,860.80	0.00
389	301007	德迈仕	303	4,566.21	0.00
390	301033	迈普医学	108	4,547.88	0.00
391	688285	高铁电气	159	1,353.09	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	300750	宁德时代	6,419,634.00	0.64
2	002291	星期六	1,916,915.00	0.19
3	300760	迈瑞医疗	1,623,985.00	0.16
4	300633	开立医疗	1,593,569.00	0.16
5	300122	智飞生物	1,558,531.00	0.15
6	300294	博雅生物	1,523,303.00	0.15
7	000403	派林生物	1,497,632.00	0.15
8	600938	中国海油	1,296,054.00	0.13
9	000002	万科A	1,241,864.00	0.12
10	000963	华东医药	1,177,757.00	0.12
11	601318	中国平安	1,177,588.00	0.12
12	000001	平安银行	1,161,699.00	0.12
13	600161	天坛生物	1,028,126.00	0.10
14	000792	盐湖股份	1,026,040.00	0.10
15	600438	通威股份	957,549.00	0.09

16	002001	新 和 成	855,389.80	0.08
17	300015	爱尔眼科	818,596.00	0.08
18	002821	凯莱英	789,203.00	0.08
19	688220	翱捷科技	782,881.32	0.08
20	002930	宏川智慧	779,412.00	0.08

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	002930	宏川智慧	3,202,063.18	0.32
2	300750	宁德时代	2,331,039.00	0.23
3	688348	昱能科技	2,107,025.44	0.21
4	002291	星期六	1,778,628.00	0.18
5	601012	隆基股份	1,585,379.00	0.16
6	601728	中国电信	1,532,324.00	0.15
7	000002	万 科 A	1,390,502.00	0.14
8	000963	华东医药	1,179,301.00	0.12
9	002987	京北方	1,153,441.20	0.11
10	000858	五 粮 液	1,112,137.00	0.11
11	601318	中国平安	1,089,291.00	0.11
12	688223	晶科能源	1,040,928.20	0.10
13	000001	平安银行	981,161.00	0.10
14	301238	瑞泰新材	974,330.00	0.10
15	300122	智飞生物	962,184.00	0.10
16	600905	三峡能源	960,400.00	0.10
17	300294	博雅生物	907,212.00	0.09

18	688120	华海清科	880,341.63	0.09
19	002594	比亚迪	867,219.00	0.09
20	300015	爱尔眼科	854,610.00	0.08

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	84,673,277.51
卖出股票收入（成交）总额	84,243,153.37

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	265,580,619.17	26.13
	其中：政策性金融债	265,580,619.17	26.13
4	企业债券	86,246,695.07	8.49
5	企业短期融资券	85,118,276.72	8.37
6	中期票据	20,712,915.07	2.04
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	34,961,365.38	3.44
9	其他	-	-
10	合计	492,619,871.41	48.47

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	220201	22国开01	700,000	70,740,389.04	6.96
2	210205	21国开05	500,000	52,616,671.23	5.18
3	210203	21国开03	500,000	51,492,465.75	5.07
4	220403	22农发03	500,000	50,402,589.04	4.96

5	188793	21中林01	470,000	46,047,264.93	4.53
---	--------	--------	---------	---------------	------

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 国家开发银行，于2022年3月21日被中国银行保险监督管理委员会因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为罚款440万元。

7.12.2 本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	38,009.37
2	应收清算款	6,403,910.82
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	1,289.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,443,209.94

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
中科 沃土 沃嘉 混合A	204	2,795,901.61	568,954,615.88	99.75%	1,409,312.27	0.25%
中科 沃土 沃嘉 混合C	360	702,015.55	252,030,075.52	99.72%	695,521.55	0.28%
合计	564	1,459,378.59	820,984,691.40	99.74%	2,104,833.82	0.26%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

截止本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本开放式基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中科沃土沃嘉混合A	中科沃土沃嘉混合C
基金合同生效日(2017年12月06日)基金份额总额	32,667,493.83	172,494,778.28
本报告期期初基金份额总额	570,439,264.52	252,616,771.85
本报告期基金总申购份额	34,412.42	372,998.43
减：本报告期基金总赎回份额	109,748.79	264,173.21
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	570,363,928.15	252,725,597.07

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	1	53,766,658.03	35.08%	39,321.76	35.08%	-
长江证券	2	99,512,168.30	64.92%	72,773.64	64.92%	-

注：1、交易席位选择标准：

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

2、交易席位选择流程：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华创证券	73,528.80	0.12%	1,963,150,000.00	35.64%	-	-	-	-
长江证券	63,097,984.96	99.88%	3,545,470,000.00	64.36%	-	-	-	-

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	中科沃土基金管理有限公司关于新增申万宏源西部证券为旗下部分基金销售机构的公告	证券日报及基金管理人网站	2022-03-18
2	中科沃土基金管理有限公司关于新增中植基金为旗下部分基金销售机构的公告	证券日报及基金管理人网站	2022-03-18
3	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金2022年第一季度报告	证券日报及基金管理人网站	2022-04-22
4	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券日报及基金管理人网站	2022-04-30
5	中科沃土基金管理有限公司关于代为履行基金经理职责	证券日报及基金管理人网站	2022-05-07
6	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新（A类份额）	证券日报及基金管理人网站	2022-05-10
7	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新（C类份额）	证券日报及基金管理人网站	2022-05-10
8	中科沃土基金管理有限公司关于新增泰信财富基金为旗下部分基金销售机构的公告	证券日报及基金管理人网站	2022-06-24

9	中科沃土基金管理有限公司关于新增福克斯（北京）基金为旗下部分基金销售机构的公告	证券日报及基金管理人网站	2022-06-28
---	---	--------------	------------

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220101-20220630	206,973,253.90	-	-	206,973,253.90	25.15%
	2	20220101-20220630	206,866,013.62	-	-	206,866,013.62	25.13%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p>							

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

12.2 存放地点

基金管理人处。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中科沃土基金管理有限公司

二〇二二年八月三十一日