

中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：中科沃土基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
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.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
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.....	71
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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	71
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
7.12 投资组合报告附注.....	72
§8 基金份额持有人信息.....	74
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	74
§9 开放式基金份额变动.....	75
§10 重大事件揭示.....	76
10.1 基金份额持有人大会决议.....	76
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.....	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76
10.4 基金投资策略的改变.....	76
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	76
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.....	76
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
10.8 其他重大事件.....	77
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	79
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.....	79

§12 备查文件目录	80
12.1 备查文件目录.....	80
12.2 存放地点.....	80
12.3 查阅方式.....	80

§ 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 6 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	861,085,364.00 份	
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	860,238,100.34 份	847,263.66 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。	
	中科沃土沃嘉混合 A	中科沃土沃嘉混合 C

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中科沃土基金管理有限公司	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	020-37128608	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		020-23388997	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		广东省广州市天河区珠江西路	杭州市延安路 368 号

	5号广州国际金融中心21楼01 单元自编 06-08 号	
邮政编码	510620	310006
法定代表人	智会杰	沈仁康

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	广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 21 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中科沃土基金管理有限公司	广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 2107

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	中科沃土沃嘉混合 A	中科沃土沃嘉混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	26,399,357.45	107,903.79
本期利润	26,346,188.29	43,777.03
加权平均基金份额本期利润	0.0360	0.0323
本期加权平均净值利润率	3.07%	2.81%
本期基金份额净值增长率	2.85%	2.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	161,082,416.23	136,962.93
期末可供分配基金份额利润	0.1873	0.1617
期末基金资产净值	1,028,400,071.45	991,579.65
期末基金份额净值	1.1955	1.1703
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	19.55%	17.03%

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	0.66%	0.14%	-1.03%	0.40%	1.69%	-0.26%
过去三个月	2.95%	0.17%	1.96%	0.49%	0.99%	-0.32%
过去六个月	2.85%	0.34%	0.45%	0.66%	2.40%	-0.32%
过去一年	9.44%	0.95%	12.63%	0.66%	-3.19%	0.29%

过去三年	33.04%	0.96%	26.66%	0.67%	6.38%	0.29%
自基金合同生效起至今	19.55%	0.92%	18.01%	0.66%	1.54%	0.26%

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	0.64%	0.14%	-1.03%	0.40%	1.67%	-0.26%
过去三个月	2.93%	0.17%	1.96%	0.49%	0.97%	-0.32%
过去六个月	2.84%	0.34%	0.45%	0.66%	2.39%	-0.32%
过去一年	9.33%	0.95%	12.63%	0.66%	-3.30%	0.29%
过去三年	30.42%	0.96%	26.66%	0.67%	3.76%	0.29%
自基金合同生效起至今	17.03%	0.92%	18.01%	0.66%	-0.98%	0.26%

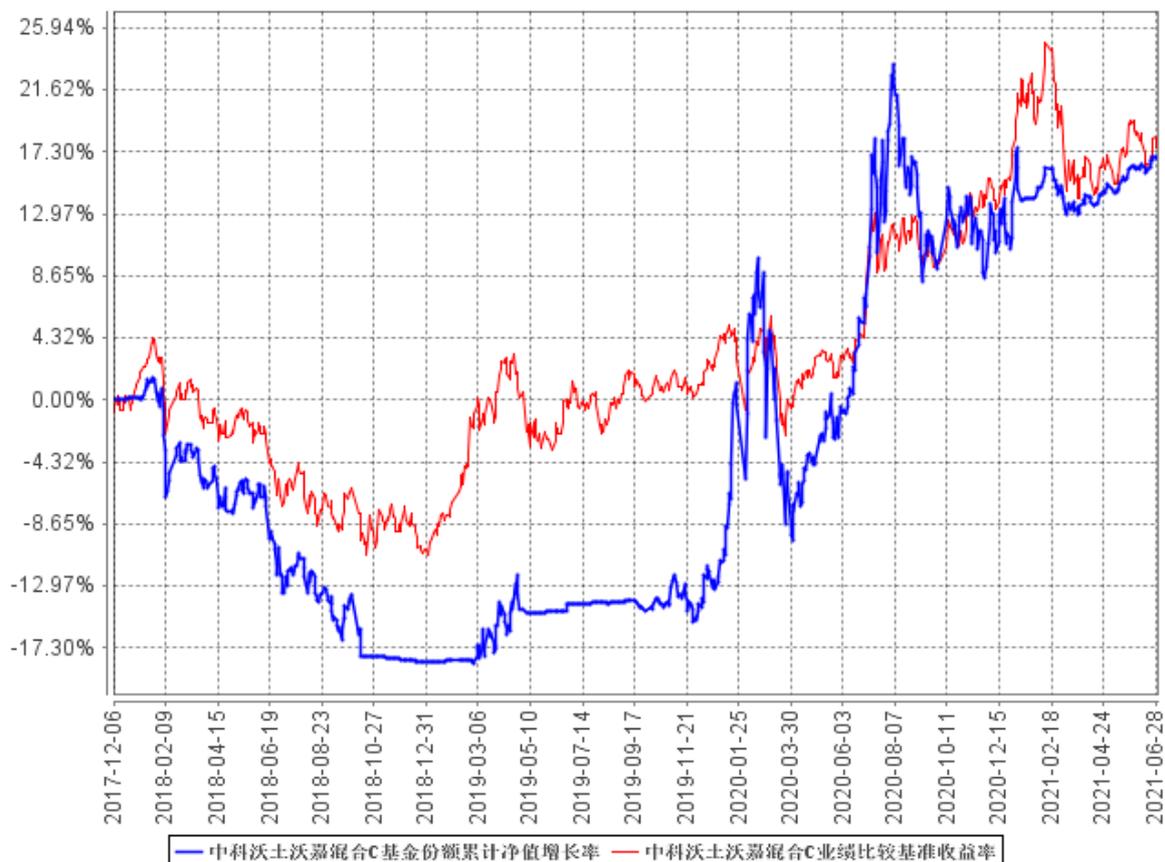
注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



注：本基金合同于 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”的首要经营准则，遵循诚信、规范、稳健的经营方针，崇尚价值投资理念和长期、平稳、盈利的投资风格，致力于为持有人提供专业、精品、创新的投资理财服务，创造成长价值，汇聚阳光财富。截至 2021 年 6 月 30 日，中科沃土旗下共管理 7 只开放式基金：中科沃土货币市场基金、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金、中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金和中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孟禄程	基金经理、研究部总经理助理	2019 年 11 月 8 日	-	5 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，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。
马洪娟	固定收益部副总经理、基金经理	2021 年 2 月 5 日	2021 年 4 月 27 日	10 年	金融学博士。曾任金鹰基金管理有限公司研究员、基金经理，现任中科沃土基金管理有限公司固定收益部副总经理、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。
李欣桐	固定收益部副 总经理、 基金经 理	2021 年 4 月 9 日	-	7 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、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。

注：1. 此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，孟禄程、马洪娟、李欣桐的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期内，不存在本基金的基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

优质个股估值处于历史相对高位，叠加市场流动性收紧预期，2 月份下跌风险得到部分释放，二季度适当增配权益市场，寻找中期业绩高成长方向比如 CRO、有色、新能板块等，整体净值保持稳定上涨回测幅度较小，后续仍将保持资产均衡配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中科沃土沃嘉混合 A 基金份额净值为 1.1955 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.85%；截至本报告期末中科沃土沃嘉混合 C 基金份额净值为 1.1703 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.84%；同期业绩比较基准收益率为 0.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内疫苗进度加速，但经济复苏仍需流动性保驾护航，中国产业竞争优势在疫情之下凸显出来，保持对国内权益市场长期乐观观点，交易阶段性存在拥挤导致市场波动幅度加大。

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，本基金托管人在对中科沃土沃嘉灵活配置混合型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，中科沃土沃嘉灵活配置混合型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嘉灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、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。本报告期内，中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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 2021 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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	20,683,310.14	911,521.01
结算备付金		4,172,439.93	90,721.53
存出保证金		88,761.47	23,407.64
交易性金融资产	6.4.7.2	610,158,566.84	4,937,290.00
其中：股票投资		178,865,227.54	4,935,590.00
基金投资		-	-
债券投资		431,293,339.30	1,700.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	388,100,000.00	-
应收证券清算款		581,294.88	-
应收利息	6.4.7.5	6,559,276.92	301.69
应收股利		-	-
应收申购款		129.98	4,485.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,030,343,780.16	5,967,727.77
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		6,734.66	67,605.03
应付管理人报酬		673,393.00	3,995.09
应付托管费		126,261.18	749.08
应付销售服务费		207.22	403.04
应付交易费用	6.4.7.7	32,832.96	20,999.05
应交税费		12,449.86	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	100,250.18	42,007.08
负债合计		952,129.06	135,758.37
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	861,085,364.00	5,059,726.10
未分配利润	6.4.7.10	168,306,287.10	772,243.30
所有者权益合计		1,029,391,651.10	5,831,969.40
负债和所有者权益总计		1,030,343,780.16	5,967,727.77

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，中科沃土沃嘉混合 A 基金份额净值 1.1955 元，基金份额总额 860,238,100.34 份；中科沃土沃嘉混合 C 基金份额净值 1.1703 元，基金份额总额 847,263.66 份。中科沃土沃嘉混合份额总额合计为 861,085,364.00 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		30,913,211.73	2,003,053.35
1.利息收入		17,062,583.82	30,524.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	214,043.15	16,430.16
债券利息收入		6,134,666.92	3.33
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		10,713,873.75	14,090.66
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		13,963,617.56	1,386,306.70
其中：股票投资收益	6.4.7.12	12,755,854.14	1,353,780.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-80,461.56	2,353.74
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,288,224.98	30,172.87
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-117,295.92	472,176.08
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	4,306.27	114,046.42
减：二、费用		4,523,246.41	250,353.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,398,987.24	53,137.27
2. 托管费	6.4.10.2.2	637,310.17	9,963.23
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,544.59	7,674.19
4. 交易费用	6.4.7.19	298,019.99	155,660.72
5. 利息支出		75,395.21	-
其中：卖出回购金融资产支出		75,395.21	-
6. 税金及附加		5,517.47	-
7. 其他费用	6.4.7.20	106,471.74	23,918.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,389,965.32	1,752,699.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,389,965.32	1,752,699.40

6.3 所有者权益（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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,059,726.10	772,243.30	5,831,969.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	26,389,965.32	26,389,965.32
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）	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
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）	861,085,364.00	168,306,287.10	1,029,391,651.10
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,569,011.13	-839,618.89	6,729,392.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,752,699.40	1,752,699.40
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）	2,351,798.83	-116,786.05	2,235,012.78
其中：1.基金申购款	31,258,151.05	792,462.83	32,050,613.88
2.基金赎回款	-28,906,352.22	-909,248.88	-29,815,601.10
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）	9,920,809.96	796,294.46	10,717,104.42

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：

<u> 智会杰 </u>	<u> 智会杰 </u>	<u> 李峰 </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

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《样本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。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%。

本财务报表由本基金的基金管理人中科沃土基金管理有限公司于 2021 年 8 月 31 日批准报出。

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》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关

规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 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 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税

的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	20,683,310.14
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：	20,683,310.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	179,033,632.43	178,865,227.54	-168,404.89
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	79,119,339.30	-413,657.28
	银行间市场	351,545,118.57	628,881.43
	合计	431,293,339.30	215,224.15
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	610,111,747.58	610,158,566.84	46,819.26

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	388,100,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	388,100,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	4,115.26
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	3,772.88
应收债券利息	5,935,602.95
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	615,745.83
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	40.00
合计	6,559,276.92

6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	25,091.60
银行间市场应付交易费用	7,741.36
合计	32,832.96

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8.79
应付证券出借违约金	-
预提费用	100,241.39
合计	100,250.18

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中科沃土沃嘉混合 A	
项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,040,214.66	3,040,214.66
本期申购	858,834,079.79	858,834,079.79
本期赎回(以“-”号填列)	-1,636,194.11	-1,636,194.11
- 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	860,238,100.34	860,238,100.34

金额单位：人民币元

中科沃土沃嘉混合 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,019,511.44	2,019,511.44
本期申购	756,442.00	756,442.00
本期赎回(以“-”号填列)	-1,928,689.78	-1,928,689.78
- 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	847,263.66	847,263.66

注：本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中科沃土沃嘉混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	354,972.35	138,671.78	493,644.13
本期利润	26,399,357.45	-53,169.16	26,346,188.29
本期基金份额交易产生的变动数	134,328,086.43	6,994,052.26	141,322,138.69
其中：基金申购款	134,602,699.27	7,013,684.15	141,616,383.42
基金赎回款	-274,612.84	-19,631.89	-294,244.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	161,082,416.23	7,079,554.88	168,161,971.11

单位：人民币元

中科沃土沃嘉混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	187,157.30	91,441.87	278,599.17
本期利润	107,903.79	-64,126.76	43,777.03
本期基金份额交易产生的变动数	-158,098.16	-19,962.05	-178,060.21
其中：基金申购款	101,493.00	4,738.32	106,231.32
基金赎回款	-259,591.16	-24,700.37	-284,291.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	136,962.93	7,353.06	144,315.99

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	154,508.50
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	58,941.76
其他	592.89
合计	214,043.15

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	52,682,773.07
减：卖出股票成本总额	39,926,918.93
买卖股票差价收入	12,755,854.14

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,254,482,269.91

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,232,538,539.26
减：应收利息总额	22,024,192.21
买卖债券差价收入	-80,461.56

6.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期内本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,288,224.98
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	1,288,224.98

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-117,295.92
——股票投资	-332,520.07
——债券投资	215,224.15
——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	-117,295.92

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,306.27
基金转换费收入	-
合计	4,306.27

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	285,544.99
银行间市场交易费用	12,475.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	298,019.99

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	28,349.39
信息披露费	53,892.00
证券出借违约金	-
其他	10,000.00
银行汇划费	530.35
账户维护费	13,700.00
合计	106,471.74

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 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
----	--------------------------------	-------------------------------------

当期发生的基金应支付的管理费	3,398,987.24	53,137.27
其中：支付销售机构的客户维护费	6,364.16	23,646.78

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇到法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	637,310.17	9,963.23

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金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前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇到法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃嘉混合 A	中科沃土沃嘉混合 C	合计
中科沃土基金管理有限公司	-	4.73	4.73

浙商银行股份有限公司	-	62.63	62.63
合计	-	67.36	67.36
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃嘉混合 A	中科沃土沃嘉混合 C	合计
中科沃土基金管理有限 公司	-	9.68	9.68
浙商银行股份有限公司	-	520.49	520.49
合计	-	530.17	530.17

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。C 类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月首日起 5 个工作日内向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

本基金本报告期内未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金本报告期内未与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末无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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行股份有限公司	20,683,310.14	154,508.50	1,152,811.21	14,625.80

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

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月	新股流通	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-

		日	月 9 日	受限						
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
600905	三峡能源	2021 年 6 月 2 日	2021 年 12 月 10 日	新股流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688276	百克生物	2021 年 6 月 17 日	2021 年 12 月 27 日	新股流通受限	36.35	79.48	3,486	126,716.10	277,067.28	-
688076	诺泰生物	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股流通受限	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股流通受限	47.33	251.96	678	32,089.74	170,828.88	-
688613	奥精医疗	2021 年 5 月 13 日	2021 年 11 月 22 日	新股流通受限	16.43	63.50	2,617	42,997.31	166,179.50	-
688319	欧林生物	2021 年 5 月 31 日	2021 年 12 月 8 日	新股流通受限	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月	新股流通	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-

		日	月 26 日	受限						
688355	明志 科技	2021 年 4 月 30 日	2021 年 11 月 12 日	新股 流通 受限	17.65	23.80	2,710	47,831.50	64,498.00	-
300981	中红 医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股 流通 受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
688616	西力 科技	2021 年 3 月 10 日	2021 年 9 月 22 日	新股 流通 受限	7.35	13.78	3,918	28,797.30	53,990.04	-
300973	立高 食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股 流通 受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
688395	正弦 电气	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股 流通 受限	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99	-
688367	工大 高科	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 28 日	新股 流通 受限	11.53	17.94	1,717	19,797.01	30,802.98	-
300953	震裕 科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股 流通 受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
301009	可靠 股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股 流通 受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301015	百洋 医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股 流通 受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
300982	苏文 电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股 流通 受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林 精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 27 日	新股 流通	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-

		日	月 15 日	受限						
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
301013	C 利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月	新股流通	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-

		日	月 29 日	受限						
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股 流通 受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股 流通 受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股 流通 受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股 流通 受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股 流通 受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新股 流通 受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股 流通 受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股 流通 受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股 流通 受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股 流通 受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10	新股 流通	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-

		日	月 13 日	受限						
300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新股 流通 受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股 流通 受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股 流通 受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股 流通 受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股 流通 受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股 流通 受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股 流通 受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股 流通 受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位： 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123117	健帆转债	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 12 日	新债未上市	100.00	100.00	45	4,500.00	4,500.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021年6月16日	临时停牌	5.59	2021年7月6日	6.15	31,900	209,965.80	178,321.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 7.69%(2020 年 12 月 31 日：0.03%)。

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 2021 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	70,358,000.00
合计	70,358,000.00

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国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日
AAA	-
AAA 以下	79,119,339.30
未评级	281,816,000.00

合计	360,935,339.30
----	----------------

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在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券。

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，监察风控部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年6	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-------------------	-------	-------	-------	-----	----

月 30 日					
资产					
银行存款	20,683,310.14	-	-	-	20,683,310.14
结算备付金	4,172,439.93	-	-	-	4,172,439.93
存出保证金	88,761.47	-	-	-	88,761.47
交易性金融资产	70,358,000.00	259,679,750.00	101,255,589.30	178,865,227.54	610,158,566.84
买入返售金融资产	8,000,000.00	-	-	-	8,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	581,294.88	581,294.88
应收利息	-	-	-	6,559,276.92	6,559,276.92
应收申购款	-	-	-	129.98	129.98
其他资产	-	-	-	-380,100,000.00	380,100,000.00
资产总计	103,302,511.54	259,679,750.00	101,255,589.30	566,105,929.32	1,030,343,780.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,734.66	6,734.66
应付管理人报酬	-	-	-	673,393.00	673,393.00
应付托管费	-	-	-	126,261.18	126,261.18

应付销售服务费	-	-	-	207.22	207.22
应付交易费用	-	-	-	32,832.96	32,832.96
应交税费	-	-	-	12,449.86	12,449.86
其他负债	-	-	-	100,250.18	100,250.18
负债总计	-	-	-	952,129.06	952,129.06
利率敏感度缺口	103,302,511.54	259,679,750.00	101,255,589.30	565,153,800.26	1,029,391,651.10
上年度末 2020年 12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	911,521.01	-	-	-	911,521.01
结算备付金	90,721.53	-	-	-	90,721.53
存出保证金	23,407.64	-	-	-	23,407.64
交易性金融资产	1,700.00	-	-	4,935,590.00	4,937,290.00
应收利息	-	-	-	301.69	301.69
应收申购款	-	-	-	4,485.90	4,485.90
其他	-	-	-	-	-

资产					
资产总计	1,027,350.18	-	-	4,940,377.59	5,967,727.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	67,605.03	67,605.03
应付管理人报酬	-	-	-	3,995.09	3,995.09
应付托管费	-	-	-	749.08	749.08
应付销售服务费	-	-	-	403.04	403.04
应付交易费用	-	-	-	20,999.05	20,999.05
其他负债	-	-	-	42,007.08	42,007.08
负债总计	-	-	-	135,758.37	135,758.37
利率敏感度缺口	1,027,350.18	-	-	4,804,619.22	5,831,969.40

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 利率上升 25 个基点	1,525,400.28	0.00
	2. 利率下降 25 个基点	-1,525,400.28	0.00

注：2020 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.03%

因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	178,865,227.54	17.38	4,935,590.00	84.63
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	431,293,339.30	41.90	1,700.00	0.03
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	610,158,566.84	59.27	4,937,290.00	84.66

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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	业绩比较基准变动+5%	9,712,862.85	229,411.59
业绩比较基准变动-5%	-9,712,862.85	-229,411.59	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 171,725,498.89 元，属于第二层次的余额为 438,433,067.95 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 4,935,590.00 元，属于第二层次的余额为 1,700.00 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	178,865,227.54	17.36
	其中：股票	178,865,227.54	17.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	431,293,339.30	41.86
	其中：债券	431,293,339.30	41.86
	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	388,100,000.00	37.67
	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	24,855,750.07	2.41
8	其他各项资产	7,229,463.25	0.70
9	合计	1,030,343,780.16	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,962,292.28	0.19
B	采矿业	4,002,701.00	0.39
C	制造业	97,952,920.96	9.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,746,101.21	0.75
E	建筑业	2,368,268.73	0.23
F	批发和零售业	1,175,068.02	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	4,759,764.00	0.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,702,988.04	0.55
J	金融业	39,855,928.70	3.87
K	房地产业	3,581,083.00	0.35
L	租赁和商务服务业	3,357,491.00	0.33
M	科学研究和技术服务业	2,035,520.40	0.20

N	水利、环境和公共设施管理业	30,146.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	138,683.00	0.01
Q	卫生和社会工作	3,415,124.60	0.33
R	文化、体育和娱乐业	781,146.00	0.08
S	综合	-	-
	合计	178,865,227.54	17.38

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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,300	8,843,810.00	0.86
2	601318	中国平安	90,254	5,801,527.12	0.56
3	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.50
4	600036	招商银行	94,600	5,126,374.00	0.50
5	000858	五粮液	17,200	5,123,708.00	0.50
6	000333	美的集团	44,900	3,204,513.00	0.31
7	600276	恒瑞医药	41,040	2,789,488.80	0.27
8	601166	兴业银行	122,400	2,515,320.00	0.24
9	300059	东方财富	76,680	2,514,337.20	0.24
10	601888	中国中免	8,300	2,490,830.00	0.24
11	601012	隆基股份	25,760	2,288,518.40	0.22
12	002594	比亚迪	8,800	2,208,800.00	0.21
13	002415	海康威视	33,000	2,128,500.00	0.21
14	600887	伊利股份	54,500	2,007,235.00	0.19
15	000651	格力电器	37,900	1,974,590.00	0.19
16	600030	中信证券	74,800	1,865,512.00	0.18
17	603259	药明康德	11,560	1,810,180.40	0.18
18	000001	平安银行	79,500	1,798,290.00	0.17
19	002475	立讯精密	39,000	1,794,000.00	0.17
20	600031	三一重工	58,500	1,700,595.00	0.17
21	000568	泸州老窖	6,700	1,580,798.00	0.15
22	600309	万华化学	14,000	1,523,480.00	0.15
23	000725	京东方 A	242,000	1,510,080.00	0.15

24	603288	海天味业	11,700	1,508,715.00	0.15
25	600900	长江电力	71,000	1,465,440.00	0.14
26	601398	工商银行	274,200	1,417,614.00	0.14
27	002714	牧原股份	23,100	1,404,942.00	0.14
28	000002	万 科 A	56,200	1,338,122.00	0.13
29	600809	山西汾酒	2,900	1,299,200.00	0.13
30	601899	紫金矿业	132,000	1,279,080.00	0.12
31	603501	韦尔股份	3,900	1,255,800.00	0.12
32	601919	中远海控	40,400	1,233,816.00	0.12
33	600570	恒生电子	13,000	1,212,250.00	0.12
34	300015	爱尔眼科	16,855	1,196,367.90	0.12
35	600438	通威股份	27,500	1,189,925.00	0.12
36	002304	洋河股份	5,700	1,181,040.00	0.11
37	600436	片仔癀	2,500	1,120,750.00	0.11
38	002352	顺丰控股	16,500	1,117,050.00	0.11
39	300124	汇川技术	14,850	1,102,761.00	0.11
40	300122	智飞生物	5,900	1,101,707.00	0.11
41	601328	交通银行	216,900	1,062,810.00	0.10
42	002230	科大讯飞	15,400	1,040,732.00	0.10
43	000661	长春高新	2,500	967,500.00	0.09
44	002142	宁波银行	24,400	950,868.00	0.09
45	300014	亿纬锂能	9,000	935,370.00	0.09
46	002241	歌尔股份	21,800	931,732.00	0.09
47	600000	浦发银行	92,200	922,000.00	0.09
48	603986	兆易创新	4,900	920,710.00	0.09
49	601668	中国建筑	194,500	904,425.00	0.09
50	300347	泰格医药	4,659	900,584.70	0.09
51	002027	分众传媒	92,100	866,661.00	0.08
52	600763	通策医疗	2,100	863,100.00	0.08
53	600690	海尔智家	32,500	842,075.00	0.08
54	601601	中国太保	29,000	840,130.00	0.08
55	600196	复星医药	11,300	815,069.00	0.08
56	600585	海螺水泥	19,500	800,475.00	0.08
57	002460	赣锋锂业	6,500	787,085.00	0.08
58	000338	潍柴动力	43,600	779,132.00	0.08
59	601688	华泰证券	48,500	766,300.00	0.07
60	000063	中兴通讯	23,000	764,290.00	0.07
61	002271	东方雨虹	13,700	757,884.00	0.07
62	600016	民生银行	170,100	750,141.00	0.07

63	002812	恩捷股份	3,200	749,120.00	0.07
64	000100	TCL 科技	96,200	735,930.00	0.07
65	600048	保利地产	61,100	735,644.00	0.07
66	600837	海通证券	63,700	732,550.00	0.07
67	603658	安图生物	9,620	728,907.40	0.07
68	002007	华兰生物	19,200	704,256.00	0.07
69	300633	开立医疗	22,000	694,760.00	0.07
70	002049	紫光国微	4,500	693,855.00	0.07
71	601288	农业银行	222,500	674,175.00	0.07
72	600660	福耀玻璃	11,900	664,615.00	0.06
73	601766	中国中车	106,600	648,128.00	0.06
74	600104	上汽集团	29,400	645,918.00	0.06
75	300003	乐普医疗	20,100	645,612.00	0.06
76	601211	国泰君安	37,400	641,036.00	0.06
77	002129	中环股份	16,500	636,900.00	0.06
78	601229	上海银行	77,600	636,320.00	0.06
79	600999	招商证券	33,100	629,562.00	0.06
80	603799	华友钴业	5,500	628,100.00	0.06
81	600703	三安光电	19,500	624,975.00	0.06
82	002311	海大集团	7,500	612,000.00	0.06
83	600919	江苏银行	85,700	608,470.00	0.06
84	601088	中国神华	31,000	605,120.00	0.06
85	002410	广联达	8,746	596,477.20	0.06
86	601169	北京银行	117,700	573,199.00	0.06
87	600893	航发动力	10,500	558,495.00	0.05
88	002371	北方华创	2,000	554,760.00	0.05
89	000625	长安汽车	20,900	549,252.00	0.05
90	300498	温氏股份	38,000	546,060.00	0.05
91	600588	用友网络	16,000	532,160.00	0.05
92	600406	国电南瑞	22,800	529,872.00	0.05
93	300601	康泰生物	3,500	521,500.00	0.05
94	601988	中国银行	168,200	518,056.00	0.05
95	600019	宝钢股份	66,800	510,352.00	0.05
96	000538	云南白药	4,300	497,596.00	0.05
97	600028	中国石化	111,000	483,960.00	0.05
98	600346	恒力石化	18,200	477,568.00	0.05
99	601628	中国人寿	14,000	474,460.00	0.05
100	002179	中航光电	6,000	474,120.00	0.05
101	002050	三花智控	19,500	467,610.00	0.05

102	601818	光大银行	123,500	466,830.00	0.05
103	601633	长城汽车	10,500	457,695.00	0.04
104	002821	凯莱英	1,200	447,120.00	0.04
105	300413	芒果超媒	6,500	445,900.00	0.04
106	601009	南京银行	41,700	438,684.00	0.04
107	600745	闻泰科技	4,500	436,050.00	0.04
108	601377	兴业证券	44,300	427,938.00	0.04
109	601390	中国中铁	80,800	423,392.00	0.04
110	000768	中航西飞	16,000	420,480.00	0.04
111	601857	中国石油	77,500	409,975.00	0.04
112	600009	上海机场	8,500	409,105.00	0.04
113	300408	三环集团	9,500	402,990.00	0.04
114	002001	新和成	13,800	395,784.00	0.04
115	600584	长电科技	10,500	395,640.00	0.04
116	600111	北方稀土	19,100	395,370.00	0.04
117	002493	荣盛石化	22,500	388,575.00	0.04
118	600760	中航沈飞	6,300	379,890.00	0.04
119	603993	洛阳钼业	71,000	366,360.00	0.04
120	600741	华域汽车	13,927	365,862.29	0.04
121	601006	大秦铁路	54,500	358,610.00	0.03
122	000786	北新建材	9,000	353,250.00	0.03
123	601939	建设银行	53,100	353,115.00	0.03
124	601877	正泰电器	10,500	350,490.00	0.03
125	000166	申万宏源	74,400	348,192.00	0.03
126	601225	陕西煤业	29,200	346,020.00	0.03
127	600958	东方证券	34,300	342,657.00	0.03
128	600926	杭州银行	23,000	339,250.00	0.03
129	002841	视源股份	2,700	335,583.00	0.03
130	600600	青岛啤酒	2,900	335,385.00	0.03
131	688012	中微公司	2,000	331,840.00	0.03
132	600010	宝钢股份	214,000	331,700.00	0.03
133	600176	中国巨石	21,260	329,742.60	0.03
134	002202	金风科技	27,000	328,320.00	0.03
135	002236	大华股份	15,500	327,050.00	0.03
136	603369	今世缘	6,000	324,960.00	0.03
137	601155	新城控股	7,800	324,480.00	0.03
138	600050	中国联通	75,000	324,000.00	0.03
139	300433	蓝思科技	11,000	323,510.00	0.03
140	002008	大族激光	8,000	323,120.00	0.03

141	600352	浙江龙盛	23,500	322,890.00	0.03
142	601336	新华保险	7,000	321,370.00	0.03
143	000157	中联重科	34,500	318,780.00	0.03
144	601186	中国铁建	42,500	315,775.00	0.03
145	601901	方正证券	33,500	313,560.00	0.03
146	002601	龙麟佰利	9,000	311,220.00	0.03
147	300529	健帆生物	3,600	310,896.00	0.03
148	600426	华鲁恒升	10,000	309,500.00	0.03
149	000876	新希望	20,900	306,603.00	0.03
150	601989	中国重工	74,400	306,528.00	0.03
151	601100	恒立液压	3,500	300,720.00	0.03
152	000895	双汇发展	9,400	298,920.00	0.03
153	603160	汇顶科技	2,300	298,149.00	0.03
154	603899	晨光文具	3,500	295,960.00	0.03
155	600015	华夏银行	47,600	294,644.00	0.03
156	000963	华东医药	6,400	294,464.00	0.03
157	002555	三七互娱	12,200	293,044.00	0.03
158	001979	招商蛇口	26,400	289,080.00	0.03
159	601111	中国国航	37,000	287,860.00	0.03
160	600547	山东黄金	14,900	286,378.00	0.03
161	601600	中国铝业	53,700	284,610.00	0.03
162	000938	紫光股份	13,000	284,440.00	0.03
163	000425	徐工机械	44,500	283,465.00	0.03
164	601669	中国电建	72,500	280,575.00	0.03
165	000066	中国长城	19,000	277,400.00	0.03
166	688276	百克生物	3,486	277,067.28	0.03
167	600161	天坛生物	8,000	274,000.00	0.03
168	601066	中信建投	8,700	273,441.00	0.03
169	601658	邮储银行	54,400	273,088.00	0.03
170	002624	完美世界	11,400	272,574.00	0.03
171	688036	传音控股	1,300	272,350.00	0.03
172	600183	生益科技	11,500	269,215.00	0.03
173	000596	古井贡酒	1,100	263,450.00	0.03
174	002736	国信证券	24,100	259,075.00	0.03
175	600109	国金证券	20,200	256,338.00	0.02
176	601788	光大证券	14,200	254,038.00	0.02
177	688169	石头科技	200	252,200.00	0.02
178	600383	金地集团	24,500	250,880.00	0.02
179	688008	澜起科技	4,000	249,520.00	0.02

180	600029	南方航空	41,000	246,820.00	0.02
181	600362	江西铜业	11,000	246,180.00	0.02
182	002600	领益智造	26,600	244,454.00	0.02
183	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.02
184	003816	中国广核	90,300	241,101.00	0.02
185	300136	信维通信	7,800	240,864.00	0.02
186	603019	中科曙光	8,600	237,446.00	0.02
187	688111	金山办公	600	236,880.00	0.02
188	000783	长江证券	31,900	233,508.00	0.02
189	002384	东山精密	11,200	233,408.00	0.02
190	000860	顺鑫农业	5,500	231,990.00	0.02
191	002044	美年健康	25,400	231,394.00	0.02
192	300033	同花顺	2,000	225,560.00	0.02
193	300676	华大基因	1,900	225,340.00	0.02
194	600795	国电电力	92,400	224,532.00	0.02
195	002414	高德红外	8,120	223,949.60	0.02
196	603882	金城医学	1,400	223,678.00	0.02
197	002938	鹏鼎控股	6,200	222,456.00	0.02
198	002916	深南电路	2,000	222,260.00	0.02
199	300144	宋城演艺	13,000	218,400.00	0.02
200	000069	华侨城 A	29,200	217,248.00	0.02
201	601800	中国交建	33,500	217,080.00	0.02
202	603833	欧派家居	1,500	212,940.00	0.02
203	600872	中炬高新	5,000	210,100.00	0.02
204	601108	财通证券	20,000	209,800.00	0.02
205	002508	老板电器	4,500	209,250.00	0.02
206	600115	中国东航	41,000	208,280.00	0.02
207	601138	工业富联	16,500	204,765.00	0.02
208	300628	亿联网络	2,400	201,120.00	0.02
209	601838	成都银行	15,900	200,976.00	0.02
210	601985	中国核电	39,700	200,882.00	0.02
211	000703	恒逸石化	16,500	197,175.00	0.02
212	601555	东吴证券	23,400	195,156.00	0.02
213	300558	贝达药业	1,800	194,832.00	0.02
214	600522	中天科技	19,200	192,000.00	0.02
215	600085	同仁堂	4,700	191,995.00	0.02
216	603659	璞泰来	1,400	191,240.00	0.02
217	601618	中国中冶	64,000	190,720.00	0.02
218	002456	欧菲光	21,200	188,256.00	0.02

219	002252	上海莱士	25,000	187,250.00	0.02
220	600332	白云山	5,500	186,175.00	0.02
221	601878	浙商证券	14,200	185,736.00	0.02
222	002463	沪电股份	12,000	185,640.00	0.02
223	600886	国投电力	19,300	185,473.00	0.02
224	600011	华能国际	43,000	181,460.00	0.02
225	603392	万泰生物	700	181,426.00	0.02
226	601799	星宇股份	800	180,576.00	0.02
227	000708	中信特钢	8,600	179,224.00	0.02
228	002024	苏宁易购	31,900	178,321.00	0.02
229	600061	国投资本	20,672	175,505.28	0.02
230	000728	国元证券	22,000	175,340.00	0.02
231	601816	京沪高铁	32,500	171,925.00	0.02
232	600705	中航资本	44,300	171,441.00	0.02
233	300957	贝泰妮	678	170,828.88	0.02
234	601021	春秋航空	3,000	170,700.00	0.02
235	601933	永辉超市	36,000	170,280.00	0.02
236	301013	C利和兴	4,704	168,966.51	0.02
237	000977	浪潮信息	6,000	168,780.00	0.02
238	603517	绝味食品	2,000	168,580.00	0.02
239	300142	沃森生物	2,700	166,590.00	0.02
240	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.02
241	600845	宝信软件	3,250	165,425.00	0.02
242	002602	世纪华通	25,500	163,710.00	0.02
243	600606	绿地控股	29,600	161,320.00	0.02
244	600118	中国卫星	5,500	160,930.00	0.02
245	600018	上港集团	33,500	159,795.00	0.02
246	600132	重庆啤酒	800	158,360.00	0.02
247	000656	金科股份	27,100	156,909.00	0.02
248	600655	豫园股份	13,500	156,465.00	0.02
249	002157	正邦科技	12,500	149,375.00	0.01
250	600489	中金黄金	17,200	148,264.00	0.01
251	601727	上海电气	34,500	146,280.00	0.01
252	600143	金发科技	7,000	146,020.00	0.01
253	601881	中国银河	13,500	145,530.00	0.01
254	300294	博雅生物	4,000	144,600.00	0.01
255	688009	中国通号	24,000	136,560.00	0.01
256	688396	华润微	1,500	136,530.00	0.01
257	002120	韵达股份	10,000	135,300.00	0.01

258	601162	天风证券	27,500	133,650.00	0.01
259	601990	南京证券	12,400	130,448.00	0.01
260	603939	益丰药房	2,300	129,007.00	0.01
261	002607	中公教育	6,100	127,429.00	0.01
262	002673	西部证券	15,300	126,225.00	0.01
263	601995	中金公司	2,000	123,000.00	0.01
264	601998	中信银行	23,900	121,890.00	0.01
265	300450	先导智能	2,000	120,280.00	0.01
266	601872	招商轮船	25,800	119,196.00	0.01
267	601231	环旭电子	7,000	117,670.00	0.01
268	603338	浙江鼎力	2,000	117,380.00	0.01
269	002739	万达电影	7,400	116,846.00	0.01
270	603233	大参林	2,280	116,530.80	0.01
271	600150	中国船舶	7,000	115,570.00	0.01
272	600233	圆通速递	11,500	115,115.00	0.01
273	600848	上海临港	6,000	107,400.00	0.01
274	603516	淳中科技	5,000	106,500.00	0.01
275	601607	上海医药	5,000	105,650.00	0.01
276	600482	中国动力	6,000	104,520.00	0.01
277	600521	华海药业	5,000	104,400.00	0.01
278	601319	中国人保	17,500	103,775.00	0.01
279	688126	沪硅产业	3,500	102,130.00	0.01
280	603195	公牛集团	500	101,000.00	0.01
281	002153	石基信息	4,200	98,742.00	0.01
282	002558	巨人网络	7,400	98,420.00	0.01
283	601238	广汽集团	7,500	97,125.00	0.01
284	002032	苏泊尔	1,500	95,685.00	0.01
285	600025	华能水电	16,500	95,535.00	0.01
286	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.01
287	002773	康弘药业	4,000	92,520.00	0.01
288	002939	长城证券	7,800	86,814.00	0.01
289	600079	人福医药	3,000	84,810.00	0.01
290	601236	红塔证券	6,200	84,072.00	0.01
291	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
292	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
293	300274	阳光电源	700	80,542.00	0.01
294	601216	君正集团	15,300	77,877.00	0.01
295	601808	中海油服	5,400	77,544.00	0.01
296	603806	福斯特	700	73,591.00	0.01

297	601698	中国卫通	4,500	72,855.00	0.01
298	600918	中泰证券	6,500	70,330.00	0.01
299	600989	宝丰能源	5,000	68,400.00	0.01
300	688117	圣诺生物	1,400	67,760.00	0.01
301	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
302	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.01
303	603087	甘李药业	600	63,948.00	0.01
304	603520	司太立	1,000	61,650.00	0.01
305	002422	科伦药业	3,000	59,850.00	0.01
306	300832	新产业	970	59,752.00	0.01
307	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
308	601077	渝农商行	14,000	55,860.00	0.01
309	688363	华熙生物	200	55,572.00	0.01
310	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.01
311	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
312	688616	西力科技	3,918	53,990.04	0.01
313	601696	中银证券	2,600	53,534.00	0.01
314	301002	崧盛股份	701	52,531.62	0.01
315	002675	东诚药业	2,400	50,568.00	0.00
316	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
317	300596	利安隆	1,000	43,330.00	0.00
318	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
319	300595	欧普康视	400	41,420.00	0.00
320	688575	亚辉龙	900	39,960.00	0.00
321	300677	英科医疗	300	37,440.00	0.00
322	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.00
323	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
324	300273	和佳医疗	5,000	32,150.00	0.00
325	002987	京北方	1,000	31,950.00	0.00
326	002945	华林证券	2,300	31,786.00	0.00
327	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.00
328	600299	安迪苏	2,500	29,900.00	0.00
329	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
330	002930	宏川智慧	1,600	26,192.00	0.00
331	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
332	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
333	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
334	002923	润都股份	900	21,780.00	0.00
335	002390	信邦制药	2,000	20,960.00	0.00

336	300562	乐心医疗	1,400	20,790.00	0.00
337	000800	一汽解放	1,700	18,394.00	0.00
338	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
339	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
340	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
341	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
342	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
343	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
344	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
345	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
346	605098	行动教育	200	11,254.00	0.00
347	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
348	688677	海泰新光	100	10,950.00	0.00
349	605289	罗曼股份	379	10,930.36	0.00
350	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
351	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
352	002449	国星光电	1,000	10,100.00	0.00
353	000513	丽珠集团	200	10,004.00	0.00
354	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
355	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
356	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
357	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
358	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
359	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
360	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
361	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
362	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
363	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
364	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
365	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
366	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
367	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
368	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
369	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
370	300857	协创数据	200	5,584.00	0.00
371	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
372	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
373	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
374	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00

375	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
376	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
377	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
378	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
379	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
380	300687	赛意信息	160	3,419.20	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	600519	贵州茅台	9,532,142.91	163.45
2	601318	中国平安	8,531,526.90	146.29
3	000001	平安银行	6,072,465.00	104.12
4	600905	三峡能源	5,842,099.90	100.17
5	000858	五粮液	5,254,887.00	90.10
6	600036	招商银行	4,847,698.37	83.12
7	000333	美的集团	4,457,589.54	76.43
8	600276	恒瑞医药	3,745,842.80	64.23
9	601166	兴业银行	2,811,596.00	48.21
10	000651	格力电器	2,706,805.00	46.41
11	601888	中国中免	2,663,882.68	45.68
12	600031	三一重工	2,282,081.00	39.13
13	600030	中信证券	2,257,208.00	38.70
14	600887	伊利股份	2,249,030.00	38.56
15	300059	东方财富	2,199,966.00	37.72
16	002475	立讯精密	2,066,573.08	35.44
17	002415	海康威视	2,017,433.86	34.59
18	002594	比亚迪	1,997,902.00	34.26
19	601012	隆基股份	1,959,355.00	33.60
20	603288	海天味业	1,763,424.32	30.24
21	000002	万科 A	1,716,270.00	29.43
22	000568	泸州老窖	1,706,318.82	29.26
23	603259	药明康德	1,696,214.60	29.08
24	002352	顺丰控股	1,603,605.00	27.50

25	600309	万华化学	1,560,108.00	26.75
26	600900	长江电力	1,551,434.00	26.60
27	601398	工商银行	1,497,132.00	25.67
28	002304	洋河股份	1,481,360.00	25.40
29	002714	牧原股份	1,476,007.24	25.31
30	000725	京东方 A	1,467,972.00	25.17
31	300122	智飞生物	1,330,234.00	22.81
32	601899	紫金矿业	1,309,891.00	22.46
33	601601	中国太保	1,271,392.00	21.80
34	600570	恒生电子	1,265,896.00	21.71
35	601939	建设银行	1,198,092.00	20.54
36	600438	通威股份	1,178,928.00	20.21
37	000661	长春高新	1,132,899.00	19.43
38	600585	海螺水泥	1,128,383.00	19.35
39	600809	山西汾酒	1,127,701.00	19.34
40	601328	交通银行	1,115,265.00	19.12
41	603501	韦尔股份	1,099,273.00	18.85
42	600690	海尔智家	1,028,446.00	17.63
43	300015	爱尔眼科	1,022,834.00	17.54
44	600000	浦发银行	999,448.00	17.14
45	600048	保利地产	994,752.00	17.06
46	002027	分众传媒	978,710.00	16.78
47	601688	华泰证券	959,817.00	16.46
48	002142	宁波银行	949,322.00	16.28
49	300014	亿纬锂能	945,686.00	16.22
50	300124	汇川技术	942,131.44	16.15
51	601668	中国建筑	935,156.00	16.03
52	000100	TCL 科技	916,474.00	15.71
53	002007	华兰生物	913,340.00	15.66
54	600837	海通证券	906,627.00	15.55
55	000338	潍柴动力	905,790.00	15.53
56	600016	民生银行	889,623.00	15.25
57	000063	中兴通讯	847,133.00	14.53
58	600999	招商证券	823,328.00	14.12
59	300498	温氏股份	787,323.00	13.50
60	002460	赣锋锂业	781,345.00	13.40

61	300347	泰格医药	777,627.77	13.33
62	600104	上汽集团	752,529.00	12.90
63	601288	农业银行	749,825.00	12.86
64	600436	片仔癀	742,269.00	12.73
65	300003	乐普医疗	738,801.00	12.67
66	300601	康泰生物	729,669.00	12.51
67	002410	广联达	720,044.14	12.35
68	002230	科大讯飞	719,625.00	12.34
69	601211	国泰君安	717,728.00	12.31
70	688538	和辉光电	715,796.80	12.27
71	600660	福耀玻璃	680,435.10	11.67
72	601229	上海银行	679,000.00	11.64
73	600588	用友网络	677,758.71	11.62
74	600009	上海机场	670,962.00	11.50
75	002271	东方雨虹	669,454.00	11.48
76	601766	中国中车	662,454.00	11.36
77	600346	恒力石化	661,224.00	11.34
78	603658	安图生物	635,890.00	10.90
79	603986	兆易创新	635,583.64	10.90
80	600763	通策医疗	630,355.00	10.81
81	002241	歌尔股份	625,530.00	10.73
82	002821	凯莱英	621,448.96	10.66
83	600893	航发动力	614,681.00	10.54
84	000538	云南白药	594,640.00	10.20
85	601919	中远海控	592,770.00	10.16
86	600919	江苏银行	591,250.00	10.14
87	600111	北方稀土	589,317.00	10.10
88	600196	复星医药	589,258.00	10.10
89	603993	洛阳钼业	583,924.00	10.01
90	688111	金山办公	583,498.00	10.01
91	002812	恩捷股份	581,074.00	9.96
92	601628	中国人寿	577,111.00	9.90
93	600703	三安光电	573,573.00	9.83
94	601169	北京银行	562,606.00	9.65
95	601818	光大银行	561,838.00	9.63
96	600406	国电南瑞	558,448.00	9.58

97	601988	中国银行	553,378.00	9.49
98	002049	紫光国微	537,828.00	9.22
99	601088	中国神华	536,729.28	9.20
100	603799	华友钴业	535,076.00	9.17
101	300633	开立医疗	519,821.00	8.91
102	300413	芒果超媒	510,743.00	8.76
103	002493	荣盛石化	507,143.00	8.70
104	002311	海大集团	491,044.00	8.42
105	000768	中航西飞	488,508.00	8.38
106	600028	中国石化	488,312.00	8.37
107	600019	宝钢股份	487,958.00	8.37
108	601390	中国中铁	486,920.00	8.35
109	600745	闻泰科技	469,357.00	8.05
110	000895	双汇发展	461,920.00	7.92
111	002050	三花智控	446,250.00	7.65
112	000786	北新建材	445,003.78	7.63
113	002129	中环股份	444,410.00	7.62
114	600958	东方证券	439,524.00	7.54
115	000625	长安汽车	439,458.00	7.54
116	000876	新希望	438,035.00	7.51
117	601009	南京银行	435,019.00	7.46
118	000066	中国长城	434,407.00	7.45
119	601336	新华保险	433,491.00	7.43
120	000166	申万宏源	429,448.00	7.36
121	000157	中联重科	427,386.00	7.33
122	601901	方正证券	426,389.00	7.31
123	002001	新和成	425,683.00	7.30
124	600584	长电科技	425,585.00	7.30
125	601633	长城汽车	425,196.00	7.29
126	601377	兴业证券	423,813.00	7.27
127	600741	华域汽车	415,952.17	7.13
128	002179	中航光电	412,276.00	7.07
129	600176	中国巨石	410,044.00	7.03
130	601100	恒立液压	408,529.00	7.00
131	600547	山东黄金	397,836.00	6.82
132	002371	北方华创	397,532.00	6.82

133	002422	科伦药业	389,785.00	6.68
134	688425	铁建重工	388,259.34	6.66
135	002555	三七互娱	387,428.00	6.64
136	601877	正泰电器	386,912.00	6.63
137	002202	金风科技	383,292.00	6.57
138	002236	大华股份	377,144.00	6.47
139	603516	淳中科技	376,312.00	6.45
140	600926	杭州银行	376,116.00	6.45
141	001979	招商蛇口	373,342.00	6.40
142	601857	中国石油	370,326.00	6.35
143	300408	三环集团	369,966.76	6.34
144	600050	中国联通	367,150.00	6.30
145	002841	视源股份	365,311.00	6.26
146	603517	绝味食品	363,855.00	6.24
147	002044	美年健康	362,828.00	6.22
148	300433	蓝思科技	362,545.00	6.22
149	688606	奥泰生物	361,310.01	6.20
150	600109	国金证券	360,175.00	6.18
151	601066	中信建投	360,098.00	6.17
152	000860	顺鑫农业	356,746.00	6.12
153	002736	国信证券	355,600.00	6.10
154	601989	中国重工	355,600.00	6.10
155	601607	上海医药	354,931.00	6.09
156	300630	普利制药	353,791.00	6.07
157	600161	天坛生物	352,588.00	6.05
158	002601	龙佰集团	350,560.87	6.01
159	688008	澜起科技	348,386.45	5.97
160	603160	汇顶科技	347,993.00	5.97
161	601006	大秦铁路	347,928.00	5.97
162	600015	华夏银行	347,814.00	5.96
163	601225	陕西煤业	342,610.00	5.87
164	600760	中航沈飞	342,157.00	5.87
165	002008	大族激光	341,360.00	5.85
166	600426	华鲁恒升	340,543.50	5.84
167	601155	新城控股	339,048.00	5.81
168	600010	宝钢股份	334,000.00	5.73

169	600872	中炬高新	332,580.00	5.70
170	603369	今世缘	332,284.00	5.70
171	300558	贝达药业	330,362.00	5.66
172	601788	光大证券	329,218.00	5.65
173	601186	中国铁建	327,675.00	5.62
174	603899	晨光文具	326,545.00	5.60
175	603019	中科曙光	323,455.00	5.55
176	600352	浙江龙盛	321,527.00	5.51
177	300957	贝泰妮	320,850.07	5.50
178	601658	邮储银行	314,160.00	5.39
179	603659	璞泰来	313,750.80	5.38
180	300463	迈克生物	311,460.00	5.34
181	600600	青岛啤酒	309,431.00	5.31
182	300979	华利集团	307,152.12	5.27
183	688012	中微公司	306,675.39	5.26
184	000783	长江证券	303,494.00	5.20
185	002600	领益智造	301,667.00	5.17
186	002938	鹏鼎控股	301,029.00	5.16
187	003816	中国广核	300,520.00	5.15
188	600183	生益科技	291,906.00	5.01
189	300981	中红医疗	291,685.77	5.00
190	002991	甘源食品	289,703.00	4.97
191	601108	财通证券	288,638.00	4.95
192	002384	东山精密	285,628.00	4.90
193	300529	健帆生物	281,941.00	4.83
194	601111	中国国航	280,334.00	4.81
195	601985	中国核电	279,950.00	4.80
196	688660	电气风电	278,734.72	4.78
197	601555	东吴证券	277,952.00	4.77
198	688083	中望软件	276,468.50	4.74
199	601669	中国电建	272,890.00	4.68
200	002557	洽洽食品	271,780.00	4.66
201	000938	紫光股份	267,256.00	4.58
202	000596	古井贡酒	265,983.00	4.56
203	600383	金地集团	264,911.00	4.54
204	002456	欧菲光	264,316.00	4.53

205	600392	盛和资源	260,227.00	4.46
206	600845	宝信软件	257,678.00	4.42
207	000069	华侨城 A	257,010.00	4.41
208	002024	苏宁易购	256,698.00	4.40
209	300676	华大基因	256,278.00	4.39
210	300136	信维通信	256,188.00	4.39
211	688169	石头科技	256,000.00	4.39
212	300144	宋城演艺	255,325.00	4.38
213	688036	传音控股	253,762.00	4.35
214	002414	高德红外	253,668.00	4.35
215	601878	浙商证券	250,640.00	4.30
216	601138	工业富联	247,259.00	4.24
217	601933	永辉超市	245,448.00	4.21
218	600522	中天科技	245,152.00	4.20
219	002624	完美世界	243,564.00	4.18
220	300033	同花顺	242,217.00	4.15
221	002916	深南电路	241,966.00	4.15
222	002602	世纪华通	238,623.00	4.09
223	600029	南方航空	238,292.00	4.09
224	000425	徐工机械	237,808.00	4.08
225	000708	中信特钢	235,926.00	4.05
226	600795	国电电力	235,872.00	4.04
227	002607	中公教育	232,679.00	3.99
228	601800	中国交建	230,480.00	3.95
229	603882	金域医学	229,477.00	3.93
230	600705	中航产融	225,500.00	3.87
231	603833	欧派家居	224,924.00	3.86
232	601600	中国铝业	224,114.14	3.84
233	600886	国投电力	220,932.00	3.79
234	000703	恒逸石化	213,178.00	3.66
235	000728	国元证券	212,210.00	3.64
236	002157	正邦科技	212,179.00	3.64
237	600061	国投资本	211,167.00	3.62
238	000963	华东医药	209,078.80	3.59
239	600362	江西铜业	204,974.00	3.51
240	002463	沪电股份	204,232.00	3.50

241	002739	万达电影	203,358.00	3.49
242	600066	宇通客车	195,272.00	3.35
243	002399	海普瑞	194,039.00	3.33
244	000656	金科股份	192,808.00	3.31
245	601838	成都银行	192,363.00	3.30
246	600606	绿地控股	190,493.00	3.27
247	300628	亿联网络	188,007.00	3.22
248	600115	中国东航	186,960.00	3.21
249	601727	上海电气	185,817.00	3.19
250	600487	亨通光电	184,170.00	3.16
251	601162	天风证券	181,746.00	3.12
252	002252	上海莱士	180,800.00	3.10
253	600177	雅戈尔	180,591.00	3.10
254	601618	中国中冶	179,584.00	3.08
255	600011	华能国际	178,880.00	3.07
256	601021	春秋航空	176,657.00	3.03
257	600118	中国卫星	175,729.00	3.01
258	601816	京沪高铁	174,460.00	2.99
259	600369	西南证券	171,920.00	2.95
260	002508	老板电器	171,792.00	2.95
261	002120	韵达股份	169,300.00	2.90
262	601198	东兴证券	167,130.00	2.87
263	601799	星宇股份	167,012.00	2.86
264	300294	博雅生物	166,267.00	2.85
265	600637	东方明珠	165,908.00	2.84
266	688561	奇安信	165,668.00	2.84
267	600068	葛洲坝	165,189.00	2.83
268	002673	西部证券	162,129.00	2.78
269	603392	万泰生物	161,475.00	2.77
270	002773	康弘药业	161,312.00	2.77
271	688777	中控技术	160,177.18	2.75
272	600498	烽火通信	159,990.00	2.74
273	688396	华润微	156,672.17	2.69
274	600489	中金黄金	155,437.00	2.67
275	000977	浪潮信息	153,394.00	2.63
276	600332	白云山	152,547.00	2.62

277	603538	美诺华	151,660.00	2.60
278	600004	白云机场	151,404.00	2.60
279	600018	上港集团	147,601.00	2.53
280	000627	天茂集团	147,566.00	2.53
281	601881	中国银河	144,315.00	2.47
282	600143	金发科技	143,940.00	2.47
283	603520	司太立	143,528.00	2.46
284	600390	五矿资本	143,235.00	2.46
285	603939	益丰药房	142,050.00	2.44
286	600655	豫园股份	139,887.00	2.40
287	000961	中南建设	139,608.00	2.39
288	688009	中国通号	137,856.00	2.36
289	000831	五矿稀土	135,190.00	2.32
290	600132	重庆啤酒	134,396.00	2.30
291	002675	东诚药业	134,022.00	2.30
292	688575	亚辉龙	132,798.83	2.28
293	603233	大参林	132,634.00	2.27
294	600976	健民集团	132,193.00	2.27
295	600521	华海药业	131,220.71	2.25
296	605336	帅丰电器	131,013.20	2.25
297	600271	航天信息	130,866.27	2.24
298	600233	圆通速递	130,387.00	2.24
299	601117	中国化学	129,908.00	2.23
300	601998	中信银行	129,299.00	2.22
301	002558	巨人网络	129,285.00	2.22
302	600918	中泰证券	128,754.00	2.21
303	000723	美锦能源	127,368.00	2.18
304	688131	皓元医药	127,055.45	2.18
305	688276	百克生物	126,716.10	2.17
306	601319	中国人保	126,420.00	2.17
307	601990	南京证券	126,356.00	2.17
308	601696	中银证券	125,161.00	2.15
309	603338	浙江鼎力	123,185.00	2.11
310	600998	九州通	123,183.00	2.11
311	600208	新湖中宝	121,581.00	2.08
312	601995	中金公司	121,395.00	2.08

313	002032	苏泊尔	119,860.00	2.06
314	603707	健友股份	119,705.66	2.05
315	601236	红塔证券	119,632.00	2.05
316	600085	同仁堂	117,939.00	2.02
317	000513	丽珠集团	116,827.00	2.00

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	000001	平安银行	4,010,791.00	68.77
2	600905	三峡能源	1,701,981.60	29.18
3	601318	中国平安	1,488,909.00	25.53
4	688538	和辉光电	1,251,772.64	21.46
5	300957	贝泰妮	968,976.54	16.61
6	601939	建设银行	900,372.00	15.44
7	688083	中望软件	779,225.00	13.36
8	300979	华利集团	771,790.62	13.23
9	688425	铁建重工	732,171.35	12.55
10	300981	中红医疗	710,064.00	12.18
11	688131	皓元医药	645,605.05	11.07
12	000651	格力电器	625,303.00	10.72
13	300122	智飞生物	604,651.00	10.37
14	688660	电气风电	597,122.32	10.24
15	688111	金山办公	566,543.50	9.71
16	000547	航天发展	551,577.00	9.46
17	300463	迈克生物	438,160.00	7.51
18	688606	奥泰生物	417,058.10	7.15
19	300601	康泰生物	412,172.00	7.07
20	600519	贵州茅台	410,677.00	7.04
21	603659	璞泰来	400,334.00	6.86
22	300630	普利制药	363,707.00	6.24
23	002422	科伦药业	347,386.00	5.96

24	600392	盛和资源	341,919.00	5.86
25	688161	威高骨科	336,454.79	5.77
26	688690	纳微科技	329,435.10	5.65
27	002821	凯莱英	320,743.61	5.50
28	002304	洋河股份	316,345.00	5.42
29	300633	开立医疗	310,993.00	5.33
30	600588	用友网络	290,497.32	4.98
31	300973	立高食品	289,353.50	4.96
32	601601	中国太保	288,420.00	4.95
33	600111	北方稀土	278,012.00	4.77
34	000066	中国长城	270,114.00	4.63
35	601607	上海医药	270,070.00	4.63
36	002991	甘源食品	264,323.00	4.53
37	300997	欢乐家	255,370.00	4.38
38	300968	格林精密	254,129.40	4.36
39	688575	亚辉龙	250,655.31	4.30
40	600845	宝信软件	249,728.00	4.28
41	603517	绝味食品	245,670.00	4.21
42	002557	洽洽食品	243,977.00	4.18
43	002812	恩捷股份	243,580.00	4.18
44	600529	山东药玻	230,127.00	3.95
45	603516	淳中科技	228,540.00	3.92
46	601888	中国中免	221,823.00	3.80
47	000858	五粮液	219,344.00	3.76
48	301009	可靠股份	217,450.38	3.73
49	600536	中国软件	216,379.00	3.71
50	600276	恒瑞医药	212,367.00	3.64
51	688561	奇安信	211,571.00	3.63
52	002833	弘亚数控	210,742.00	3.61
53	300953	震裕科技	209,034.00	3.58
54	688345	博力威	193,899.54	3.32
55	600177	雅戈尔	190,252.00	3.26
56	600066	宇通客车	187,983.00	3.22
57	688601	力芯微	187,601.94	3.22
58	603538	美诺华	184,850.00	3.17
59	002399	海普瑞	183,737.00	3.15
60	688383	新益昌	182,317.00	3.13
61	000002	万科 A	181,714.00	3.12

62	600487	亨通光电	179,850.00	3.08
63	688621	阳光诺和	179,493.88	3.08
64	600161	天坛生物	178,991.00	3.07
65	600068	葛洲坝	178,755.00	3.07
66	600369	西南证券	176,225.00	3.02
67	688626	翔宇医疗	176,043.85	3.02
68	002946	新乳业	171,739.00	2.94
69	600900	长江电力	171,241.00	2.94
70	600637	东方明珠	169,208.00	2.90
71	301002	崧盛股份	167,300.00	2.87
72	601198	东兴证券	167,081.00	2.86
73	301006	迈拓股份	165,768.01	2.84
74	300003	乐普医疗	163,058.00	2.80
75	301015	百洋医药	161,969.52	2.78
76	600271	航天信息	161,230.00	2.76
77	688777	中控技术	159,411.18	2.73
78	601328	交通银行	158,436.00	2.72
79	600048	保利地产	156,666.00	2.69
80	601117	中国化学	156,410.00	2.68
81	300978	东箭科技	154,900.74	2.66
82	600585	海螺水泥	154,530.00	2.65
83	688016	心脉医疗	152,624.00	2.62
84	300958	建工修复	150,504.38	2.58
85	600498	烽火通信	150,480.00	2.58
86	000627	天茂集团	148,302.00	2.54
87	688667	菱电电控	147,502.50	2.53
88	300961	深水海纳	145,687.42	2.50
89	688269	凯立新材	145,613.82	2.50
90	300498	温氏股份	144,925.00	2.49
91	603156	养元饮品	143,827.00	2.47
92	688216	气派科技	143,194.00	2.46
93	605499	东鹏饮料	142,908.16	2.45
94	603993	洛阳钼业	142,890.00	2.45
95	002497	雅化集团	141,550.00	2.43
96	600390	五矿资本	141,390.00	2.42
97	688630	芯碁微装	140,791.50	2.41
98	600919	江苏银行	138,866.00	2.38
99	688396	华润微	138,294.00	2.37

100	000831	五矿稀土	138,140.00	2.37
101	600976	健民集团	138,047.00	2.37
102	300967	晓鸣股份	137,548.80	2.36
103	300996	普联软件	136,245.10	2.34
104	605336	帅丰电器	135,654.72	2.33
105	688609	九联科技	134,990.24	2.31
106	300962	中金辐照	133,868.62	2.30
107	300955	嘉亨家化	131,810.64	2.26
108	000723	美锦能源	131,681.00	2.26
109	600004	白云机场	130,680.00	2.24
110	300687	赛意信息	130,418.00	2.24
111	600208	新潮中宝	130,415.00	2.24
112	300987	川网传媒	128,547.65	2.20
113	601009	南京银行	126,976.00	2.18
114	300991	创益通	126,253.35	2.16
115	600030	中信证券	126,152.00	2.16
116	688117	圣诺生物	126,092.32	2.16
117	300993	玉马遮阳	125,671.80	2.15
118	000513	丽珠集团	124,475.00	2.13
119	300982	苏文电能	123,249.60	2.11
120	603707	健友股份	122,992.00	2.11
121	601919	中远海控	122,980.00	2.11
122	300975	商络电子	122,964.00	2.11
123	603658	安图生物	121,914.00	2.09
124	300985	致远新能	121,873.50	2.09
125	601688	华泰证券	120,330.00	2.06
126	600837	海通证券	119,772.00	2.05
127	688456	有研粉材	119,677.20	2.05
128	600297	广汇汽车	119,000.00	2.04
129	688316	青云科技	118,126.00	2.03
130	000961	中南建设	117,559.00	2.02
131	688682	霍莱沃	117,285.08	2.01

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	214,189,076.54
卖出股票收入（成交）总额	52,682,773.07

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	352,174,000.00	34.21
	其中：政策性金融债	352,174,000.00	34.21
4	企业债券	79,113,750.00	7.69
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,589.30	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	431,293,339.30	41.90

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	210205	21 国开 05	1,000,000	101,250,000.00	9.84
2	210202	21 国开 02	700,000	70,063,000.00	6.81
3	210203	21 国开 03	600,000	60,174,000.00	5.85
4	155367	19 中林 03	505,000	49,767,750.00	4.83
5	210206	21 国开 06	400,000	40,004,000.00	3.89

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

(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。

7.10.2 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。

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

本报告期末本基金未投资国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库

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	88,761.47
2	应收证券清算款	581,294.88
3	应收股利	-
4	应收利息	6,559,276.92
5	应收申购款	129.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	7,229,463.25

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	0.50	新股中签流通受限

§ 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	264	3,258,477.65	858,437,302.72	99.79%	1,800,797.62	0.21%
中科沃土沃嘉混合 C	394	2,150.42	0.00	0.00%	847,263.66	100.00%
合计	658	1,308,640.37	858,437,302.72	99.69%	2,648,061.28	0.31%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中科沃土沃嘉混合 A	0.00	0.00%
	中科沃土沃嘉混合 C	8.79	0.00%
	合计	8.79	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：截止至本报告期末，本公司高管、投研负责人及本基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	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 6 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	3,040,214.66	2,019,511.44
本报告期基金总申购份额	858,834,079.79	756,442.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,636,194.11	1,928,689.78
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	860,238,100.34	847,263.66

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	255,481,659.99	100.00%	186,833.73	100.00%	-

注：1、交易席位选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；

(4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

(5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；

(6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程：

(1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	79,881,719.75	100.00%	5,217,250,000.00	100.00%	-	-

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	第四季度报告	证券日报及基金管理人网站	2021年1月21日
2	基金经理变更公告	证券日报及基金管理人网站	2021年2月5日
3	基金管理人的法定名称、住所发生变更的公告	证券日报及基金管理人网站	2021年3月6日
4	基金产品资料概要更新	证券日报及基金管理人网站	2021年3月17日
5	基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东事项公告	证券日报及基金管理人网站	2021年3月20日
6	基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	证券日报及基金管理人网站	2021年3月26日
7	年度报告	证券日报及基金管理人网站	2021年3月30日
8	基金经理变更公告	证券日报及基金管理人网站	2021年4月9日

9	基金产品资料概要更新	证券日报及基金管理人网站	2021 年 4 月 10 日
10	招募说明书更新	证券日报及基金管理人网站	2021 年 4 月 10 日
11	基金行业高级管理人员变更公告	证券日报及基金管理人网站	2021 年 4 月 17 日
12	第一季度报告	证券日报及基金管理人网站	2021 年 4 月 21 日
13	基金经理变更公告	证券日报及基金管理人网站	2021 年 4 月 27 日
14	基金产品资料概要更新	证券日报及基金管理人网站	2021 年 4 月 29 日
15	招募说明书	证券日报及基金管理人网站	2021 年 4 月 29 日
16	基金行业高级管理人员变更公告	证券日报及基金管理人网站	2021 年 5 月 22 日
17	其他重大事项公告	证券日报及基金管理人网站	2021 年 5 月 26 日
18	基金募集/申赎/扩募/代销/上市基金场内交易价格波动等风险提示公告	证券日报及基金管理人网站	2021 年 6 月 4 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	20210105-20210111	994,687.84	0.00	0.00	994,687.84	0.12%
产品	1	20210113-20210630	0.00	213,975,707.85	0.00	213,975,707.85	24.85%
产品	2	20210113-20210117 20210122-20210630	0.00	215,075,716.75	0.00	215,075,716.75	24.98%
产品	3	20210112-20210630	0.00	214,692,939.06	0.00	214,692,939.06	24.93%
产品	4	20210112-20210630	0.00	214,692,939.06	0.00	214,692,939.06	24.93%
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

2021 年 8 月 31 日