

# 中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

## 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2020 年 8 月 25 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 市场中性策略执行情况.....	错误！未定义书签。
7.13 投资组合报告附注.....	51
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	错误！未定义书签。
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56

---

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>57</b>
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.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	<b>错误！未定义书签。</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>错误！未定义书签。</b>
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

## § 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	
场内简称	-	
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	9,920,809.96 份	
基金合同存续期	-	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
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
下属分级基金场内简称:	-	-
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	4,456,464.27 份	5,464,345.69 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	广东省珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-5668	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 5 号广州国际金融中心 21 楼 01 单元自编 06-08 号	杭州市延安路 368 号
邮政编码	510620	310006
法定代表人	程文卫	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	<a href="http://www.richlandasm.com.cn">http://www.richlandasm.com.cn</a>
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(2020年1月1日 - 2020年6月30日)	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	773,863.08	506,660.24
本期利润	1,132,427.74	620,271.66
加权平均基金份额本期利润	0.2080	0.0811
本期加权平均净值利润率	20.68%	8.15%
本期基金份额净值增长率	22.30%	22.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末可供分配利润	-99,324.81	-232,562.75
期末可供分配基金份额利润	-0.0223	-0.0426
期末基金资产净值	4,868,080.27	5,849,024.15
期末基金份额净值	1.0924	1.0704
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	9.24%	7.04%

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	9.35%	0.74%	3.37%	0.44%	5.98%	0.30%
过去三个月	18.30%	0.87%	5.96%	0.45%	12.34%	0.42%
过去六个月	22.30%	1.74%	1.22%	0.74%	21.08%	1.00%
过去一年	27.53%	1.24%	5.36%	0.60%	22.17%	0.64%



过去三年	9.24%	0.91%	5.00%	0.66%	4.24%	0.25%
过去五年	9.24%	0.91%	5.00%	0.66%	4.24%	0.25%
自基金合同生效起至今	9.24%	0.91%	5.00%	0.66%	4.24%	0.25%

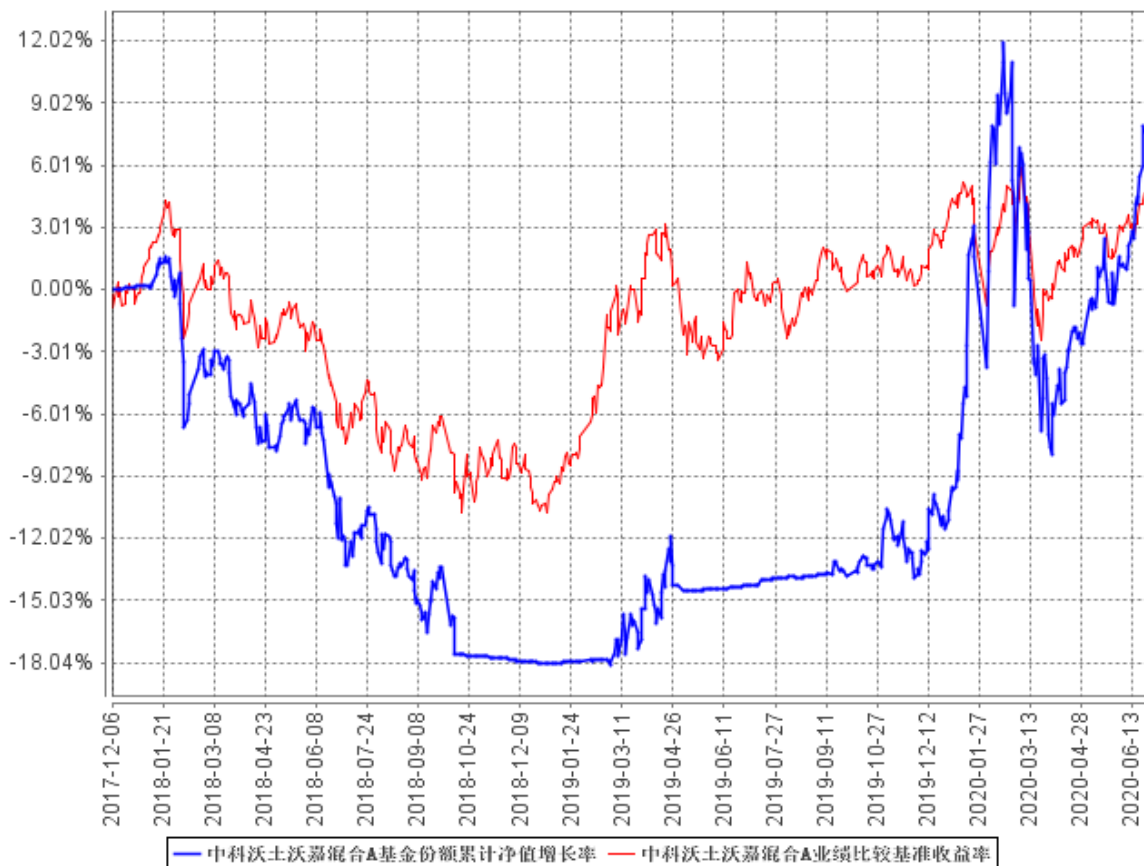
中科沃土沃嘉混合 C

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	9.30%	0.75%	3.37%	0.44%	5.93%	0.31%
过去三个月	18.17%	0.87%	5.96%	0.45%	12.21%	0.42%
过去六个月	22.05%	1.74%	1.22%	0.74%	20.83%	1.00%
过去一年	24.81%	1.24%	5.36%	0.60%	19.45%	0.64%
过去三年	7.04%	0.90%	5.00%	0.66%	2.04%	0.24%
过去五年	7.04%	0.90%	5.00%	0.66%	2.04%	0.24%
自基金合同生效起至今	7.04%	0.90%	5.00%	0.66%	2.04%	0.24%

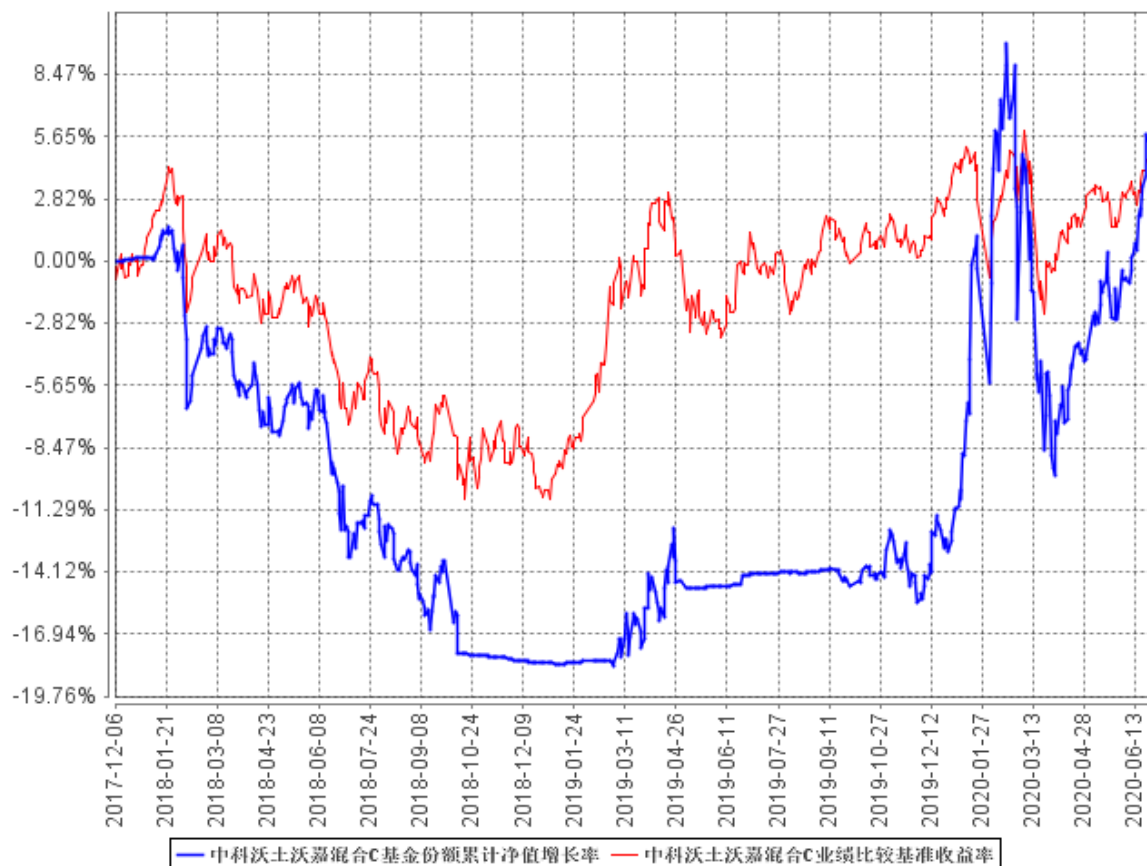
注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

### 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 1.42 亿元，是国内第 101 家公募基金管理公司，也是一家拥有 PE 背景的公募基金管理公司。中科沃土带着中科招商、粤科金融等主要股东强大的精神基因和优秀的文化基因，始终贯彻“持有人利益至上”的首要经营准则，遵循诚信、规范、稳健的经营方针，崇尚价值投资理念和长期、平稳、盈利的投资风格，致力于为持有人提供专业、精品、创新的投资理财服务，创造成长价值，汇聚阳光财富。截至 2020 年 6 月 30 日，中科沃土旗下共管理 8 只开放式基金：中科沃土货币市场基金、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金、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	-	4 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。
乐瑞祺	总经理助理、基金经理	2019 年 4 月 19 日	2020 年 1 月 7 日	15 年	数量经济学硕士，曾任衡泰软件定量分析师、产品经理，博时基金基金经理助理，民生加银基金基金经理、投资部总监、投委

					会委员，方圆 360 资产管理有限公司执行总经理、投资经理，第一创业证券资产管理部投资总监，中科沃土基金管理有限公司总经理助理、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，乐瑞祺、孟禄程的“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

无相关情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 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

海外股市受益于释放流动性救市政策强势反弹、国内疫情可控下经济逐步修复，整个市场风险偏好得到明显修复，目前唯有海外疫情何时控制住这一风险，只对国内出口业务有所压制。国内市场同样受益于流动性宽松，整体风险偏好得到明显的修复，我们延续一季度的思路重点布局

疫情收益的高景气行业。

1) 生物安全建设行业：高端医疗装备、创新药及其产业链（CRO/CDMO）

国外医疗装备企业基于先发优势占据国内医院主流，虽然我国医疗装备技术追赶上却面临进入门槛，本次疫情之中，中国企业充分发挥强大的制造能力为疫情提供了坚定的医疗支持。疫情加速实现高端医疗装备自主可控，增加对创新药及其产业链（CRO/CDMO）的投资。

2) 疫情加速产业转型升级的受益行业：云计算、云游戏、人工智能、物联网、网络安全

疫情催生宅经济、云办公、无接触付款等新模式，加快新技术应用场景的拓展和应用，加速社会云化进度，利好于云计算、云游戏、人工智能、物联网、网络安全发展。

#### 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 1.0924 元，本报告期基金份额净值增长率为 22.30%；截至本报告期末中科沃土沃嘉混合 C 基金份额净值为 1.0704 元，本报告期基金份额净值增长率为 22.05%；同期业绩比较基准收益率为 1.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

疫情冲击之下，全球放水维稳经济引起资本市场风险偏好提升，随着疫情可防可控与疫苗研发推进，经济逐步复苏，生产、投资恢复较快，后续看消费缓慢复苏，但流动性会边际收紧，未来市场波动加大，投资上选择具有长线产业逻辑的方向如 5G 及应用、生物医药、新能源汽车。

#### 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，本基金本报告期末未进行利润分配，符合合同规定。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内，本基金 2020 年 3 月 1 日-2020 年 6 月 30 日期间出现基金资产净值低于五千万元的情形，已向监管部门提交解决方案。

## § 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 2020 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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,152,811.21	1,499,607.64
结算备付金		265,804.25	2,439.19
存出保证金		33,936.72	8,480.40
交易性金融资产	6.4.7.2	7,568,347.42	5,864,388.00
其中：股票投资		7,341,611.42	5,864,388.00
基金投资		-	-
债券投资		226,736.00	-
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	1,500,000.00	-
应收证券清算款		805,093.39	-
应收利息	6.4.7.5	791.97	320.39
应收股利		-	-
应收申购款		97,849.82	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		11,424,634.78	7,375,235.62
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		319,718.83	388,201.25
应付赎回款		162,148.00	100.98
应付管理人报酬		7,158.76	4,703.97
应付托管费		1,342.27	882.03
应付销售服务费		1,017.51	326.68
应付交易费用	6.4.7.7	86,135.22	6,628.47
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	130,009.77	245,000.00
负债合计		707,530.36	645,843.38
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	9,920,809.96	7,569,011.13
未分配利润	6.4.7.10	796,294.46	-839,618.89
所有者权益合计		10,717,104.42	6,729,392.24
负债和所有者权益总计		11,424,634.78	7,375,235.62

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，中科沃土沃嘉混合 A 基金份额净值 1.0924 元，基金份额总额 4,456,464.27 份；中科沃土沃嘉混合 C 基金份额净值 1.0704 元，基金份额总额 5,464,345.69 份。中科沃土沃嘉混合份额总额合计为 9,920,809.96 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		2,003,053.35	658,175.97
1.利息收入		30,524.15	253,039.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	16,430.16	54,487.70
债券利息收入		3.33	130,287.94
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		14,090.66	68,264.23
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,386,306.70	334,330.80
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,353,780.09	340,466.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,353.74	-11,800.00
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	30,172.87	5,663.84
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	472,176.08	55,222.20
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	114,046.42	15,583.10
<b>减：二、费用</b>		250,353.95	175,575.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	53,137.27	97,937.01
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,963.23	18,363.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	7,674.19	3,539.11
4. 交易费用	6.4.7.19	155,660.72	41,874.15
5. 利息支出		-	177.37
其中：卖出回购金融资产支出		-	177.37
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	23,918.54	13,684.82
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,752,699.40	482,600.30
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,752,699.40	482,600.30

### 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：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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）	17,146,057.61	-3,106,338.11	14,039,719.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	482,600.30	482,600.30
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）	39,049,363.71	-5,430,155.17	33,619,208.54
其中：1.基金申购款	50,372,432.80	-7,220,440.95	43,151,991.85
2.基金赎回款	-11,323,069.09	1,790,285.78	-9,532,783.31
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）	56,195,421.32	-8,053,892.98	48,141,528.34

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：

          于建伟  程文卫  李茂            
 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国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。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 2020 年 8 月 28 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 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	1,152,811.21
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：	1,152,811.21

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	6,762,297.23	7,341,611.42	579,314.19
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约				
债券	交易所市场	218,190.64	226,736.00	8,545.36
	银行间市场	-	-	-
	合计	218,190.64	226,736.00	8,545.36
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		6,980,487.87	7,568,347.42	587,859.55

### 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 2020年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,500,000.00	-

#### 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 2020年6月30日
应收活期存款利息	485.55
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	119.10
应收债券利息	167.88
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-



应收出借证券利息	-
其他	19.44
合计	791.97

#### 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 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	86,135.22
银行间市场应付交易费用	-
合计	86,135.22

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	91.23
应付证券出借违约金	-
预提费用	129,918.54
合计	130,009.77

#### 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 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,642,463.89	5,642,463.89
本期申购	8,534,575.88	8,534,575.88
本期赎回(以“-”号填列)	-9,720,575.50	-9,720,575.50
- 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	4,456,464.27	4,456,464.27

金额单位：人民币元

中科沃土沃嘉混合 C		
项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,926,547.24	1,926,547.24
本期申购	22,723,575.17	22,723,575.17
本期赎回(以“-”号填列)	-19,185,776.72	-19,185,776.72
- 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	5,464,345.69	5,464,345.69

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	-876,928.08	274,342.96	-602,585.12
本期利润	773,863.08	358,564.66	1,132,427.74
本期基金份额交易产生的变动数	3,740.19	-121,966.81	-118,226.62
其中：基金申购款	-461,341.78	778,276.12	316,934.34
基金赎回款	465,081.97	-900,242.93	-435,160.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-99,324.81	510,940.81	411,616.00

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	-329,963.65	92,929.88	-237,033.77
本期利润	506,660.24	113,611.42	620,271.66
本期基金份额交易产生的变动数	-409,259.34	410,699.91	1,440.57
其中：基金申购款	-1,609,331.51	2,084,860.00	475,528.49
基金赎回款	1,200,072.17	-1,674,160.09	-474,087.92

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-232,562.75	617,241.21	384,678.46

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	14,625.80
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	1,604.01
其他	200.35
合计	16,430.16

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	59,066,758.54
减：卖出股票成本总额	57,712,978.45
买卖股票差价收入	1,353,780.09

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,755.74
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	8,400.00
减：应收利息总额	2.00
买卖债券差价收入	2,353.74

#### 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 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	30,172.87
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	30,172.87

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	472,176.08
——股票投资	463,630.72
——债券投资	8,545.36
——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	472,176.08

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	114,041.10
基金转换费收入	5.32
合计	114,046.42

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	155,660.72
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	155,660.72

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	14,918.54
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	-
账户维护费	9,000.00
其他	-
合计	23,918.54

## 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	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	基金托管人、基金销售机构

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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	53,137.27	97,937.01
其中：支付销售机构的客户维护费	23,646.78	74.90

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	9,963.23	18,363.21

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

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		
	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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 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	-	1,211.55	1,211.55

浙商银行股份有限公司	-	671.48	671.48
合计	-	1,883.03	1,883.03

注：本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%。

两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$H = E \times \text{基金年销售服务费率} \div \text{当年天数}$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构。若遇到法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

#### 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	1,152,811.21	14,625.80	22,653,961.46	23,913.64
----------------	--------------	-----------	---------------	-----------

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

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.11 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 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。

###### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 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。

###### 6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.12 金融工具风险及管理

##### 6.4.12.1 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。

#### 6.4.12.2 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。

截至 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有国债、央行票据和政策性金融债，其他债券占资产净值比例 2.12%。

##### 6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.12.2.2 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。

##### 6.4.12.2.3 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。

##### 6.4.12.2.4 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 2020 年 6 月 30 日
AAA	-
AAA 以下	226,736.00
未评级	-
合计	226,736.00

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。

#### 6.4.12.2.5 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。

#### 6.4.12.2.6 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。

#### 6.4.12.3 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。

##### 6.4.12.3.1 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 7.4.12 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。

#### 6.4.12.4 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。

##### 6.4.12.4.1 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。

###### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,152,811.21	-	-	-	1,152,811.21
结算备付金	265,804.25	-	-	-	265,804.25
存出保证金	33,936.72	-	-	-	33,936.72
交易性金融资产	226,736.00	-	-	-7,341,611.42	7,568,347.42

买入返售金融资产	1,500,000.00	-	-	-	1,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	805,093.39	805,093.39
应收利息	-	-	-	791.97	791.97
应收申购款	-	-	-	97,849.82	97,849.82
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,179,288.18	-	-	8,245,346.60	11,424,634.78
负债					
应付证券清算款	-	-	-	319,718.83	319,718.83
应付赎回款	-	-	-	162,148.00	162,148.00
应付管理人报酬	-	-	-	7,158.76	7,158.76
应付托管费	-	-	-	1,342.27	1,342.27
应付销售服务费	-	-	-	1,017.51	1,017.51
应付交易费用	-	-	-	86,135.22	86,135.22
其他负债	-	-	-	130,009.77	130,009.77
负债总计	-	-	-	707,530.36	707,530.36
利率敏感度缺口	3,179,288.18	-	-	-7,537,816.24	10,717,104.42
上年度末 2019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	1,499,607.64	-	-	-	1,499,607.64
结算备付金	2,439.19	-	-	-	2,439.19
存出保证金	8,480.40	-	-	-	8,480.40
交易性金融资产	-	-	-	5,864,388.00	5,864,388.00
应收利息	-	-	-	320.39	320.39
资产总计	1,510,527.23	-	-	5,864,708.39	7,375,235.62
负债					
应付证券清算款	-	-	-	388,201.25	388,201.25
应付赎回款	-	-	-	100.98	100.98
应付管理人报酬	-	-	-	4,703.97	4,703.97
应付托管费	-	-	-	882.03	882.03
应付销售服务费	-	-	-	326.68	326.68
应付交易费用	-	-	-	6,628.47	6,628.47

其他负债	-	-	-	245,000.00	245,000.00
负债总计	-	-	-	645,843.38	645,843.38
利率敏感度缺口	1,510,527.23	-	-	-5,218,865.01	6,729,392.24

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。

#### 6.4.12.4.2 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。

#### 6.4.12.4.3 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。

##### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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	7,341,611.42	68.50	5,864,388.00	87.15
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	226,736.00	2.12	-	-
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	7,568,347.42	70.62	5,864,388.00	87.15

##### 6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-		
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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	业绩比较基准上升5%		461,508.21

	业绩比较基准下降 5%	-461, 508. 21	-94, 296. 89
--	-------------	---------------	--------------

### 6.4.13 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 2020 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 7,568,347.42 元，无属于第二或第三层次的余额(2019 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 5,864,388.00 元，无属于第二或第三层次的余额)。

(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 2020 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(2019 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	7,341,611.42	64.26
	其中：股票	7,341,611.42	64.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	226,736.00	1.98
	其中：债券	226,736.00	1.98
	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	1,500,000.00	13.13
	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	1,418,615.46	12.42
8	其他各项资产	937,671.90	8.21
9	合计	11,424,634.78	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,213,722.42	39.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	148,440.00	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	8,325.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,706,431.00	15.92
J	金融业	108,820.00	1.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	623,748.00	5.82



N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	532,125.00	4.97
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,341,611.42	68.50

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000547	航天发展	48,000	656,160.00	6.12
2	002044	美年健康	31,500	453,915.00	4.24
3	600588	用友网络	10,000	441,000.00	4.11
4	300685	艾德生物	5,000	384,800.00	3.59
5	300383	光环新网	14,500	378,015.00	3.53
6	603259	药明康德	3,880	374,808.00	3.50
7	688111	金山办公	1,000	341,580.00	3.19
8	002821	凯莱英	1,400	340,200.00	3.17
9	002624	完美世界	5,300	305,492.00	2.85
10	002773	康弘药业	5,600	277,760.00	2.59
11	688202	美迪西	1,800	248,940.00	2.32
12	000988	华工科技	10,000	244,300.00	2.28
13	300294	博雅生物	6,000	224,940.00	2.10
14	000403	双林生物	2,600	192,738.00	1.80
15	300558	贝达药业	1,300	181,974.00	1.70
16	002001	新和成	6,000	174,600.00	1.63
17	000977	浪潮信息	4,000	156,720.00	1.46
18	002727	一心堂	4,000	148,440.00	1.39
19	002812	恩捷股份	2,200	144,760.00	1.35
20	600309	万华化学	2,800	139,972.00	1.31
21	300331	苏大维格	4,600	139,334.00	1.30
22	002555	三七互娱	2,700	126,360.00	1.18
23	600426	华鲁恒升	6,800	120,224.00	1.12

24	000538	云南白药	1,000	93,810.00	0.88
25	688023	安恒信息	300	92,370.00	0.86
26	688388	嘉元科技	1,500	84,525.00	0.79
27	000100	TCL 科技	13,000	80,600.00	0.75
28	300003	乐普医疗	2,200	80,344.00	0.75
29	300015	爱尔眼科	1,800	78,210.00	0.73
30	002007	华兰生物	1,500	75,165.00	0.70
31	600276	恒瑞医药	800	73,840.00	0.69
32	300832	新产业	400	68,876.00	0.64
33	688015	交控科技	1,500	66,345.00	0.62
34	300059	东方财富	3,000	60,600.00	0.57
35	688016	心脉医疗	167	57,992.42	0.54
36	000651	格力电器	1,000	56,570.00	0.53
37	600030	中信证券	2,000	48,220.00	0.45
38	603658	安图生物	200	32,488.00	0.30
39	300760	迈瑞医疗	100	30,570.00	0.29
40	688139	海尔生物	400	22,424.00	0.21
41	603881	数据港	200	21,614.00	0.20
42	300438	鹏辉能源	500	8,725.00	0.08
43	600754	锦江酒店	300	8,325.00	0.08
44	002294	信立泰	100	2,966.00	0.03

## 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	300463	迈克生物	2,390,820.48	35.53
2	688016	心脉医疗	1,752,148.48	26.04
3	688202	美迪西	1,497,131.29	22.25
4	603233	大参林	1,443,947.00	21.46
5	603883	老百姓	1,272,543.00	18.91
6	688158	优刻得	1,219,059.88	18.12
7	688015	交控科技	1,208,206.95	17.95
8	603939	益丰药房	1,087,294.00	16.16
9	000547	航天发展	1,041,212.99	15.47
10	300003	乐普医疗	1,040,042.00	15.46

11	002773	康弘药业	1,033,884.00	15.36
12	688139	海尔生物	983,280.00	14.61
13	300383	光环新网	914,262.00	13.59
14	688388	嘉元科技	885,834.40	13.16
15	000403	双林生物	884,460.00	13.14
16	300558	贝达药业	873,004.00	12.97
17	688358	祥生医疗	857,532.85	12.74
18	603658	安图生物	835,921.00	12.42
19	688023	安恒信息	814,578.00	12.10
20	688123	聚辰股份	774,559.81	11.51
21	000739	普洛药业	763,178.00	11.34
22	688111	金山办公	760,301.60	11.30
23	300685	艾德生物	716,865.00	10.65
24	688363	华熙生物	682,961.45	10.15
25	688012	中微公司	682,655.70	10.14
26	002821	凯莱英	646,350.00	9.60
27	002880	卫光生物	627,977.00	9.33
28	002511	中顺洁柔	607,246.00	9.02
29	300294	博雅生物	602,234.00	8.95
30	603259	药明康德	565,455.00	8.40
31	688086	紫晶存储	503,979.78	7.49
32	300497	富祥药业	483,756.00	7.19
33	600588	用友网络	471,097.00	7.00
34	002007	华兰生物	465,877.00	6.92
35	688008	澜起科技	462,812.60	6.88
36	688020	方邦股份	444,764.00	6.61
37	300326	凯利泰	438,180.00	6.51
38	688036	传音控股	414,314.49	6.16
39	000988	华工科技	400,665.00	5.95
40	688009	中国通号	400,555.00	5.95
41	688039	当虹科技	393,211.97	5.84
42	002044	美年健康	380,760.00	5.66
43	002223	鱼跃医疗	379,560.00	5.64
44	300639	凯普生物	363,640.00	5.40
45	688037	芯源微	361,575.00	5.37
46	300206	理邦仪器	358,016.00	5.32

47	300026	红日药业	352,870.00	5.24
48	600201	生物股份	352,753.00	5.24
49	688085	三友医疗	342,429.00	5.09
50	002932	明德生物	342,370.00	5.09
51	688399	硕世生物	326,974.00	4.86
52	300273	和佳医疗	322,360.00	4.79
53	002727	一心堂	321,159.00	4.77
54	000977	浪潮信息	319,210.00	4.74
55	002841	视源股份	315,010.00	4.68
56	000538	云南白药	311,603.00	4.63
57	688002	睿创微纳	308,465.42	4.58
58	688159	有方科技	305,872.84	4.55
59	688088	虹软科技	297,168.00	4.42
60	688168	安博通	284,755.00	4.23
61	600567	山鹰纸业	278,800.00	4.14
62	600309	万华化学	273,283.00	4.06
63	688058	宝兰德	270,948.00	4.03
64	600845	宝信软件	266,920.00	3.97
65	002624	完美世界	265,004.00	3.94
66	600276	恒瑞医药	262,230.00	3.90
67	000513	丽珠集团	257,819.00	3.83
68	688100	威胜信息	255,931.00	3.80
69	002078	太阳纸业	253,487.86	3.77
70	002675	东诚药业	252,477.00	3.75
71	002901	大博医疗	250,788.00	3.73
72	300832	新产业	249,608.00	3.71
73	002001	新和成	249,052.00	3.70
74	688099	晶晨股份	245,645.51	3.65
75	300122	智飞生物	240,754.00	3.58
76	600161	天坛生物	233,360.00	3.47
77	688268	华特气体	232,471.27	3.45
78	688001	华兴源创	226,696.00	3.37
79	300725	药石科技	224,436.00	3.34
80	688258	卓易信息	223,050.38	3.31
81	002294	信立泰	222,920.00	3.31
82	600195	中牧股份	216,610.00	3.22

83	300482	万孚生物	214,702.50	3.19
84	300143	盈康生命	214,335.00	3.19
85	688200	华峰测控	213,800.00	3.18
86	688018	乐鑫科技	211,936.76	3.15
87	688116	天奈科技	210,185.00	3.12
88	601688	华泰证券	198,170.00	2.94
89	600158	中体产业	195,800.00	2.91
90	600521	华海药业	193,470.00	2.87
91	688007	光峰科技	193,192.18	2.87
92	688369	致远互联	192,278.00	2.86
93	688101	三达膜	190,400.00	2.83
94	300529	健帆生物	188,636.00	2.80
95	300373	扬杰科技	187,290.00	2.78
96	002317	众生药业	185,586.00	2.76
97	600062	华润双鹤	183,720.00	2.73
98	688299	长阳科技	178,099.00	2.65
99	600754	锦江酒店	176,167.00	2.62
100	300413	芒果超媒	175,708.00	2.61
101	600535	天士力	167,550.00	2.49
102	300760	迈瑞医疗	166,555.00	2.48
103	600570	恒生电子	164,656.00	2.45
104	603881	数据港	162,334.00	2.41
105	688396	华润微	161,212.00	2.40
106	300633	开立医疗	159,282.00	2.37
107	002082	万邦德	158,880.00	2.36
108	688188	柏楚电子	158,620.90	2.36
109	603520	司太立	153,787.00	2.29
110	603214	爱婴室	148,951.00	2.21
111	300701	森霸传感	147,924.00	2.20
112	688118	普元信息	147,212.00	2.19
113	688138	清溢光电	147,131.00	2.19
114	688028	沃尔德	146,280.00	2.17
115	688030	山石网科	144,437.11	2.15
116	300331	苏大维格	138,006.00	2.05
117	002812	恩捷股份	136,845.00	2.03

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	300463	迈克生物	2,473,417.00	36.76
2	688016	心脉医疗	2,163,392.17	32.15
3	603233	大参林	1,474,274.00	21.91
4	688015	交控科技	1,471,055.75	21.86
5	688202	美迪西	1,422,823.81	21.14
6	688139	海尔生物	1,372,799.73	20.40
7	603883	老百姓	1,337,656.00	19.88
8	688358	祥生医疗	1,311,541.97	19.49
9	688158	优刻得	1,155,215.98	17.17
10	603939	益丰药房	1,140,415.00	16.95
11	300003	乐普医疗	925,155.00	13.75
12	688123	聚辰股份	890,499.36	13.23
13	002773	康弘药业	874,733.50	13.00
14	603658	安图生物	860,428.00	12.79
15	688363	华熙生物	812,109.88	12.07
16	688023	安恒信息	791,653.49	11.76
17	000739	普洛药业	790,980.00	11.75
18	688111	金山办公	776,051.40	11.53
19	000403	双林生物	769,741.00	11.44
20	300558	贝达药业	767,028.00	11.40
21	688008	澜起科技	723,268.28	10.75
22	688020	方邦股份	686,260.29	10.20
23	688388	嘉元科技	667,390.64	9.92
24	688012	中微公司	657,523.68	9.77
25	002880	卫光生物	622,760.00	9.25
26	002511	中顺洁柔	597,576.00	8.88
27	688036	传音控股	592,435.00	8.80
28	300383	光环新网	541,670.00	8.05
29	688009	中国通号	451,320.00	6.71
30	300497	富祥药业	450,600.00	6.70

31	688086	紫晶存储	430,413.00	6.40
32	002007	华兰生物	426,537.00	6.34
33	300294	博雅生物	415,611.00	6.18
34	300026	红日药业	407,868.00	6.06
35	688088	虹软科技	404,425.02	6.01
36	300326	凯利泰	402,778.00	5.99
37	300685	艾德生物	401,021.00	5.96
38	300206	理邦仪器	399,332.00	5.93
39	688399	硕世生物	399,054.00	5.93
40	688085	三友医疗	398,387.80	5.92
41	300639	凯普生物	388,284.60	5.77
42	002821	凯莱英	381,429.00	5.67
43	688389	普门科技	379,190.00	5.63
44	688099	晶晨股份	374,733.20	5.57
45	002223	鱼跃医疗	374,003.59	5.56
46	688002	睿创微纳	371,280.79	5.52
47	688018	乐鑫科技	364,076.00	5.41
48	600201	生物股份	344,936.00	5.13
49	000547	航天发展	344,350.00	5.12
50	688039	当虹科技	342,869.00	5.10
51	688037	芯源微	338,923.42	5.04
52	688001	华兴源创	333,030.23	4.95
53	600845	宝信软件	330,846.00	4.92
54	600276	恒瑞医药	323,935.00	4.81
55	002841	视源股份	319,480.00	4.75
56	601688	华泰证券	317,663.00	4.72
57	002932	明德生物	307,525.00	4.57
58	300273	和佳医疗	307,210.00	4.57
59	000513	丽珠集团	299,120.00	4.44
60	600567	山鹰纸业	289,802.00	4.31
61	002675	东诚药业	284,678.00	4.23
62	688058	宝兰德	279,757.00	4.16
63	688116	天奈科技	273,282.31	4.06
64	002078	太阳纸业	263,800.00	3.92
65	002901	大博医疗	258,911.00	3.85
66	000988	华工科技	250,670.00	3.73
67	300122	智飞生物	249,667.00	3.71
68	300725	药石科技	248,409.00	3.69

69	688159	有方科技	247,678.06	3.68
70	603259	药明康德	247,408.76	3.68
71	600161	天坛生物	247,378.00	3.68
72	002294	信立泰	230,851.00	3.43
73	300482	万孚生物	229,177.00	3.41
74	600519	贵州茅台	225,758.00	3.35
75	300143	盈康生命	225,180.00	3.35
76	688299	长阳科技	219,601.00	3.26
77	600195	中牧股份	217,263.00	3.23
78	688188	柏楚电子	216,262.50	3.21
79	688168	安博通	215,254.11	3.20
80	600535	天士力	215,185.00	3.20
81	688369	致远互联	214,582.00	3.19
82	688258	卓易信息	214,524.00	3.19
83	600521	华海药业	213,600.00	3.17
84	688268	华特气体	210,374.14	3.13
85	000538	云南白药	208,490.00	3.10
86	300413	芒果超媒	197,172.00	2.93
87	300529	健帆生物	193,005.70	2.87
88	688100	威胜信息	191,643.00	2.85
89	688006	杭可科技	191,628.68	2.85
90	002317	众生药业	191,470.00	2.85
91	600158	中体产业	191,400.00	2.84
92	300832	新产业	191,318.00	2.84
93	300373	扬杰科技	186,832.00	2.78
94	688022	瀚川智能	184,729.00	2.75
95	688007	光峰科技	181,546.00	2.70
96	600570	恒生电子	177,050.30	2.63
97	002727	一心堂	177,016.00	2.63
98	300633	开立医疗	174,801.00	2.60
99	688101	三达膜	172,245.00	2.56
100	600754	锦江酒店	171,646.00	2.55
101	600062	华润双鹤	168,730.00	2.51
102	600036	招商银行	165,920.00	2.47
103	603214	爱婴室	161,702.00	2.40
104	601318	中国平安	161,301.00	2.40
105	688128	中国电研	160,681.30	2.39
106	600887	伊利股份	159,789.00	2.37



107	603881	数据港	158,660.00	2.36
108	600690	海尔智家	157,890.00	2.35
109	600030	中信证券	157,159.00	2.34
110	688108	赛诺医疗	157,057.84	2.33
111	688166	博瑞医药	155,128.00	2.31
112	000977	浪潮信息	154,520.00	2.30
113	688200	华峰测控	151,672.92	2.25
114	688118	普元信息	149,161.23	2.22
115	002082	万邦德	145,800.00	2.17
116	300701	森霸传感	144,650.00	2.15
117	002551	尚荣医疗	144,250.00	2.14
118	603520	司太立	143,806.00	2.14
119	688068	热景生物	143,390.00	2.13
120	688030	山石网科	142,682.00	2.12
121	601211	国泰君安	142,675.00	2.12
122	600309	万华化学	142,158.00	2.11
123	000425	徐工机械	141,900.00	2.11
124	688138	清溢光电	140,460.00	2.09
125	002822	中装建设	136,442.00	2.03
126	601166	兴业银行	136,024.00	2.02
127	002353	杰瑞股份	135,030.00	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	58,726,571.15
卖出股票收入（成交）总额	59,066,758.54

### 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	226,736.00	2.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	226,736.00	2.12

### 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	128098	康弘转债	1,610	220,087.00	2.05
2	113583	益丰转债	50	6,649.00	0.06

### 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

#### 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	33,936.72
2	应收证券清算款	805,093.39
3	应收股利	-
4	应收利息	791.97
5	应收申购款	97,849.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	937,671.90

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中未存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中科沃土沃嘉混合 A	522	8,537.29	-	-	4,456,464.27	100.00%
中科沃土沃嘉混合 C	973	5,615.98	-	-	5,464,345.69	100.00%
合计	1,495	6,635.99	-	-	9,920,809.96	100.00%

### 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	1,982.49	0.0400%
	中科沃土沃嘉混合 C	3,205.55	0.0600%
	合计	5,188.04	0.1000%

### § 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	5,642,463.89	1,926,547.24
本报告期基金总申购份额	8,534,575.88	22,723,575.17
减：本报告期基金总赎回份额	9,720,575.50	19,185,776.72
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	4,456,464.27	5,464,345.69

## § 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，自 2020 年 1 月 7 日起，乐瑞祺离任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鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理，该事项已于同日通过《中国证券报》和公司官网披露；自同一日期起，乐瑞祺离任中科沃土沃嘉灵活配置型证券投资基金基金经理，该事项已于同日通过《证券日报》和公司官网披露；自同一日期起，乐瑞祺离任中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金基金经理，该事项已于同日通过《证券时报》和公司官网披露；自同一日期，乐瑞祺离任中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金基金经理，该事项已于同日通过《上海证券报》和公司官网披露。

本报告期内，自 2020 年 1 月 20 日起，谢子鹏担任公司非独立董事职务，同日起，朱为绎不再担任公司非独立董事职务，该事项已于同日向广东证监局报备。

自 2020 年 4 月 28 日起，傅军先生离任公司副总经理和首席信息官职务，李峰先生担任公司首席信息官职务。该事项经中科沃土基金管理有限公司第二届董事会第七次会议（2020 年 2 月 24 日）审议通过（有效票 9 票，同意 9 票，反对 0 票，弃权 0 票），公司在 2020 年 4 月 28 日向监管部门报告该项变更，并于 2020 年 4 月 30 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司官网进行信息披露。

自 2020 年 5 月 18 日起，程文卫先生离任公司总经理职务并转任公司常务副总经理职务，于建伟先生担任公司总经理职务。该事项经中科沃土基金管理有限公司第二届董事会第八次会议（2020 年 3 月 11 日）审议通过（有效票 9 票，同意 9 票，反对 0 票，弃权 0 票）。公司在 2020 年 5 月 18 日向监管部门报告该项变更，并于 2020 年 5 月 20 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司官网进行信息披露。

自 2020 年 6 月 22 日起，林峰先生担任公司副总经理职务。该事项经中科沃土基金管理有限公司第二届董事会第九次会议（2020 年 4 月 29 日）审议通过（有效票 9 票，同意 9 票，反对 0 票，弃权 0 票）。公司在 2020 年 6 月 22 日向监管部门报告该项变更，并于 2020 年 6 月 24 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司官网进行信息披露。

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	117,784,214.57	100.00%	86,135.22	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	224,112.93	100.00%	180,800,000.00	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	关于中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金的基金经理变更公告	证券日报及基金管理人网站	2020 年 1 月 7 日
2	中科沃土基金管理有限公司关于新增麟龙投资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	2020 年 4 月 9 日



## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	20200101-20200120	2,485,089.46	-	2,485,089.46	-	-

产品特有风险

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。

### 11.2 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。

### 11.3 存放地点

基金管理人处。

### 11.4 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

2020 年 8 月 28 日