

# 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 2019 年半年度报告

2019 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 26 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18

<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	50
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>51</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	54
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>56</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.....	56

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>57</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	中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	中科沃土沃鑫成长混合发起
基金主代码	003125
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 10 月 25 日
基金管理人	中科沃土基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	106,162,639.11 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中科沃土基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	曹萍	郭明
	联系电话	020-37128608	010-66105799
	电子邮箱	caoping@richlandasm.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-018-3610	95588
传真		020-23388997	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-5668	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广东省广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心21楼01单元自编06-08号	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		510620	100140
法定代表人		朱为绎	陈四清

注：本基金管理人于 2019 年 7 月 19 日公告，自 2019 年 7 月 18 日起公司法定代表人已变更为程文卫先生。

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	590,148.53
本期利润	3,777,453.50
加权平均基金份额本期利润	0.0991
本期加权平均净值利润率	11.60%
本期基金份额净值增长率	7.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	-14,573,968.09
期末可供分配基金份额利润	-0.1373
期末基金资产净值	91,588,671.02
期末基金份额净值	0.8627
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-13.73%

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

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

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

#### 3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.66%	1.04%	2.84%	0.58%	1.82%	0.46%
过去三个月	-2.74%	1.81%	-0.72%	0.75%	-2.02%	1.06%
过去六个月	7.06%	1.68%	13.65%	0.77%	-6.59%	0.91%

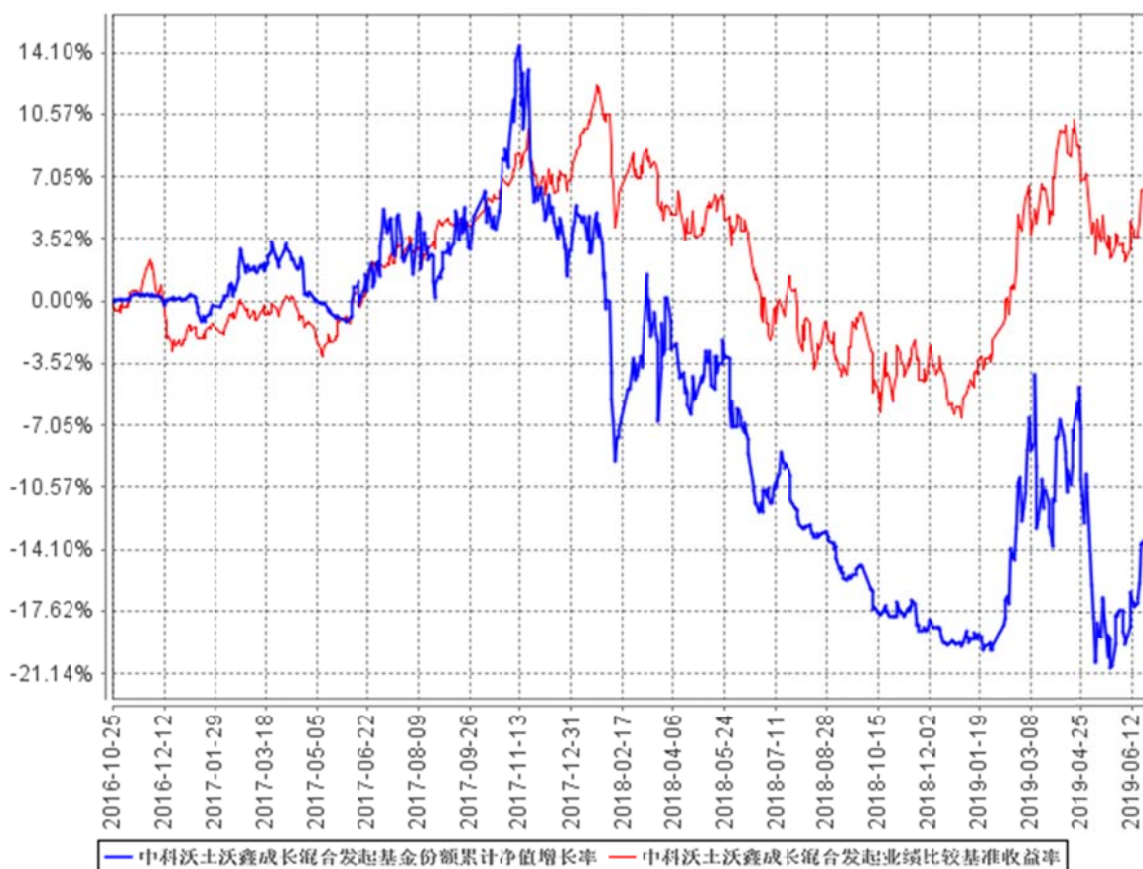


过去一年	-3.39%	1.21%	5.89%	0.75%	-9.28%	0.46%
自基金合同生效起至今	-13.73%	1.03%	6.19%	0.57%	-19.92%	0.46%

注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

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



注：本基金合同于 2016 年 10 月 25 日生效，按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

## § 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 2019 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和 中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李昱	副总经理兼任权益投资部总经理、基金经理	2016 年 10 月 25 日	2019 年 5 月 8 日	23 年	管理学硕士。曾任广发证券股份有限公司环市东营业部业务经理、投资理财部投资经理、资产管理部投资经理，新华基金管理有限公司专户管理部副总监、专户管理部负责人、基金管理部基金经理、基金管理部副总监，中科沃土基金管理有限公司副总经理兼任权益投资部总经理、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金和 中科沃土

					沃安债券型证券投资基金基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
乐瑞祺	总经理助理、基金经理	2019年5月8日	-	14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，现任中科沃土基金管理有限公司总经理助理、中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金、中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式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基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
宋佳蕾	基金经理助理	2017年12月15日	2019年2月1日	6年	会计学硕士。曾任安信证券股份有限公司分析师，中科沃土基金管理有限公司专户投资经理、研究部行业研究员，现任中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理助理。中国国籍，具有基金从业资格。

注：1. 此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，李昱的“任职日期”为基金合同生效之日，乐瑞祺、宋佳蕾的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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

上半年特别是 1 季度，宏观环境整体处于财政政策，货币政策双宽松状态，导致年初出现了股债齐涨的局面，股票市场的上涨绝大部分原因是 2018 年市场大幅下跌的一种估值修复，债券市场的上涨则主要源于流动性的宽松。

在上半年的操作中，我们提高了组合股票的仓位水平，组合更为均衡，估值更为合理，组合稳定性也得到了较大幅度的提高。在接下来的操作中，我们仍将侧重于精选优质公司，摒弃仓位大幅变动的操作，我们希望通过持有权益市场上的优质标的，为投资者创造价值。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.8627 元；本报告期基金份额净值增长率为 7.06%，业绩比较基准收益率为 13.65%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，贸易战仍将出现反复，中美关系的博弈将是一种常态，逆全球化的贸易战将会

对全球经济造成不利影响，在全球经济出现放缓迹象的同时，各大央行放松货币政策似乎成了一种潮流，在这样的背景下，我们认为国内下半年仍有放松货币政策的必要，但是鉴于房住不炒的前提，采用何种方式的放松成为人们更为关心的问题。

鉴于目前股票市场的估值水平，我们认为市场下跌空间有限，精选优质公司，分享公司的业绩增长仍然是我们组合的策略核心。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 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，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本托管人依法对中科沃土基金管理有限公司编制和披露的中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,432,453.73	14,885,406.96
结算备付金		269,638.31	287,550.59
存出保证金		80,713.58	52,952.06
交易性金融资产	6.4.7.2	85,518,033.94	2,141,999.33
其中：股票投资		85,518,033.94	2,141,999.33
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	10,000,000.00
应收证券清算款		669,866.40	-
应收利息	6.4.7.5	2,123.13	12,937.37
应收股利		-	-
应收申购款		99.85	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		91,972,928.94	27,380,846.31
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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		-	-
应付赎回款		851.54	-
应付管理人报酬		66,105.02	34,296.32
应付托管费		11,017.49	5,716.05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	139,117.52	301,675.24

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	167,166.35	275,000.00
负债合计		384,257.92	616,687.61
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	106,162,639.11	33,214,590.25
未分配利润	6.4.7.10	-14,573,968.09	-6,450,431.55
所有者权益合计		91,588,671.02	26,764,158.70
负债和所有者权益总计		91,972,928.94	27,380,846.31

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8627 元，基金份额总额 106162639.11 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		4,771,275.55	-3,504,947.38
1.利息收入		89,675.21	45,888.07
其中：存款利息收入	6.4.7.11	35,886.10	37,967.52
债券利息收入		20,887.71	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		32,901.40	7,920.55
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,492,633.68	-3,784,351.27
其中：股票投资收益	6.4.7.12	910,120.82	-3,921,410.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	11,351.39	-
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	571,161.47	137,058.77
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,187,304.97	225,471.51
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	1,661.69	8,044.31
<b>减：二、费用</b>		993,822.05	1,202,749.54



1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	239,723.52	261,646.63
2. 托管费	6.4.10.2.2	39,953.94	43,607.81
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	698,253.18	757,412.24
5. 利息支出		3,072.66	-
其中：卖出回购金融资产支出		3,072.66	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	12,818.75	140,082.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		3,777,453.50	-4,707,696.92
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		3,777,453.50	-4,707,696.92

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	33,214,590.25	-6,450,431.55	26,764,158.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,777,453.50	3,777,453.50
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）	72,948,048.86	-11,900,990.04	61,047,058.82
其中：1.基金申购款	74,561,775.86	-12,098,910.41	62,462,865.45
2.基金赎回款	-1,613,727.00	197,920.37	-1,415,806.63
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	106,162,639.11	-14,573,968.09	91,588,671.02



“基金合同”)发起募集。本基金募集资金经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审验,并由其出具《验证报告》(安永华明(2016)验字第 61247680\_G06 号)。经向中国证监会备案,本基金基金合同于 2016 年 10 月 25 日正式生效。本基金的基金管理人为中科沃土基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

#### **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颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税〔2008〕1号)、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2012〕85号)、《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税〔2015〕101号)、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36号)、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》(财税〔2016〕46号)、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》(财税〔2016〕70号)、《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税〔2016〕140号)及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收企业所得税。

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

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

### 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 2019年6月30日
活期存款	5,432,453.73
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:	5,432,453.73

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	82,438,806.10	85,518,033.94	3,079,227.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	82,438,806.10	85,518,033.94	3,079,227.84

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融工具。

### 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

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	1,965.53
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	121.30
应收债券利息	-

应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	36.30
合计	2,123.13

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	139,117.52
银行间市场应付交易费用	-
合计	139,117.52

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	167,166.35
-	-
合计	167,166.35

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	33,214,590.25	33,214,590.25
本期申购	74,561,775.86	74,561,775.86
本期赎回(以“-”号填列)	-1,613,727.00	-1,613,727.00
- 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	106,162,639.11	106,162,639.11

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,708,307.72	-1,742,123.83	-6,450,431.55
本期利润	590,148.53	3,187,304.97	3,777,453.50
本期基金份额交易产生的变动数	-9,773,235.17	-2,127,754.87	-11,900,990.04
其中：基金申购款	-9,931,845.87	-2,167,064.54	-12,098,910.41
基金赎回款	158,610.70	39,309.67	197,920.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,891,394.36	-682,573.73	-14,573,968.09

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	24,399.53
定期存款利息收入	6,045.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,851.26
其他	590.31
合计	35,886.10

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	234,483,333.61
减：卖出股票成本总额	233,573,212.79
买卖股票差价收入	910,120.82

### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,297,947.38
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	10,045,741.60
减：应收利息总额	240,854.39
买卖债券差价收入	11,351.39

#### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	571,161.47
基金投资产生的股利收益	-
合计	571,161.47

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	3,187,304.97
——股票投资	3,187,304.97
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-



2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	3,187,304.97

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	1,661.69
基金转换费收入	-
合计	1,661.69

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	698,253.18
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	698,253.18

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	12,166.35
信息披露费	-
银行汇划费	652.40
其他	-
合计	12,818.75

### 6.4.7.21 分部报告

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

### 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，基金发起人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广东中科科创创业投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
广东省粤科金融集团有限公司	基金管理人的股东
广东中广投资管理有限公司	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 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

注：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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

### 6.4.10.1.4 权证交易

注：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

注：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 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	239,723.52	261,646.63
其中：支付销售机构的客户维护费	85,007.06	115,627.86

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	39,953.94	43,607.81

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

### 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

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

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2016 年 10 月 25 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	4,975,124.38	4,975,124.38
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	4,975,124.38	4,975,124.38
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	4.69%	14.56%

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例
广东中科科创 创业投资管理 有限责任公司	2,976,293.76	2.80%	2,976,293.76	8.96%

广东省粤科金融集团有限公司	1,000,000.00	0.94%	1,000,000.00	3.01%
广东中广投资管理有限公司	197,642.23	0.19%	197,642.23	0.60%

注：关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
中国工商银行股份有限公司	5,432,453.73	24,399.53	23,227,600.85	32,439.50

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

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2019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

注：截至本报告期末2019年6月30日止，本基金无因认购新发/增发而持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截至本报告期末2019年6月30日止，本基金未持有暂时停牌流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019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 2019 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。

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

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，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。

本基金本报告期末未持有债券。

##### 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 金融资产和金融负债的到期期限分析

### 6.4.13.3.2 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 2019 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	5,432,453.73	-	-	-	5,432,453.73
结算备付金	269,638.31	-	-	-	269,638.31
存出保证金	80,713.58	-	-	-	80,713.58
交易性金融资产	-	-	-	85,518,033.94	85,518,033.94
应收证券清算款	-	-	-	669,866.40	669,866.40
应收利息	-	-	-	2,123.13	2,123.13
应收申购款	-	-	-	99.85	99.85
资产总计	5,782,805.62	-	-	86,190,123.32	91,972,928.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	851.54	851.54
应付管理人报酬	-	-	-	66,105.02	66,105.02
应付托管费	-	-	-	11,017.49	11,017.49

应付交易费用	-	-	-	139,117.52	139,117.52
其他负债	-	-	-	167,166.35	167,166.35
负债总计	-	-	-	384,257.92	384,257.92
利率敏感度缺口	5,782,805.62	-	-	-85,805,865.40	91,588,671.02
上年度末 2018 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	14,885,406.96	-	-	-	14,885,406.96
结算备付金	287,550.59	-	-	-	287,550.59
存出保证金	52,952.06	-	-	-	52,952.06
交易性金融资产	-	-	-	2,141,999.33	2,141,999.33
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
应收利息	-	-	-	12,937.37	12,937.37
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	25,225,909.61	-	-	2,154,936.70	27,380,846.31
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	34,296.32	34,296.32
应付托管费	-	-	-	5,716.05	5,716.05
应付交易费用	-	-	-	301,675.24	301,675.24
其他负债	-	-	-	275,000.00	275,000.00
负债总计	-	-	-	616,687.61	616,687.61
利率敏感度缺口	25,225,909.61	-	-	1,538,249.09	26,764,158.70

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

注：截至 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券，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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	85,518,033.94	93.37	2,141,999.33	8.00
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	85,518,033.94	93.37	2,141,999.33	8.00

### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	1,497,070.68	481,107.78
	业绩比较基准下降 5%	-1,497,070.68	-481,107.78

### 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

##### (1) 不以公允价值计量的金融工具

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

##### (2) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参考最近一期年报。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于属于第一层级的余额为 85,518,033.94 元，无属于第二层级和第三层级的余额。(2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 2,141,999.33 元，无属于第二层级和第三层级的余额。)

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	85,518,033.94	92.98
	其中：股票	85,518,033.94	92.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	5,702,092.04	6.20
8	其他各项资产	752,802.96	0.82
9	合计	91,972,928.94	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	1,201,057.00	1.31
C	制造业	35,784,012.00	39.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,872,200.00	2.04

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,569,339.00	3.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	834,680.00	0.91
J	金融业	37,142,432.94	40.55
K	房地产业	2,259,783.00	2.47
L	租赁和商务服务业	2,854,530.00	3.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	85,518,033.94	93.37

### 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	601318	中国平安	90,754	8,041,711.94	8.78
2	600519	贵州茅台	8,000	7,872,000.00	8.59
3	600036	招商银行	170,900	6,148,982.00	6.71
4	600887	伊利股份	133,300	4,453,553.00	4.86
5	601601	中国太保	111,800	4,081,818.00	4.46
6	600585	海螺水泥	95,700	3,971,550.00	4.34
7	601166	兴业银行	206,600	3,778,714.00	4.13
8	600276	恒瑞医药	52,100	3,438,600.00	3.75
9	600030	中信证券	127,600	3,038,156.00	3.32
10	601888	中国国旅	32,200	2,854,530.00	3.12
11	600009	上海机场	34,000	2,848,520.00	3.11
12	600809	山西汾酒	39,900	2,755,095.00	3.01

13	600801	华新水泥	116,200	2,353,050.00	2.57
14	600309	万华化学	52,500	2,246,475.00	2.45
15	000651	格力电器	40,800	2,244,000.00	2.45
16	601688	华泰证券	100,500	2,243,160.00	2.45
17	601668	中国建筑	325,600	1,872,200.00	2.04
18	601211	国泰君安	78,700	1,444,145.00	1.58
19	600486	扬农化工	24,800	1,356,560.00	1.48
20	600048	保利地产	101,800	1,298,968.00	1.42
21	601766	中国中车	140,000	1,132,600.00	1.24
22	600104	上汽集团	44,200	1,127,100.00	1.23
23	600690	青岛海尔	60,100	1,039,129.00	1.13
24	601818	光大银行	256,200	976,122.00	1.07
25	600340	华夏幸福	29,500	960,815.00	1.05
26	600019	宝钢股份	145,600	946,400.00	1.03
27	601998	中信银行	156,400	933,708.00	1.02
28	600000	浦发银行	79,600	929,728.00	1.02
29	601328	交通银行	148,500	908,820.00	0.99
30	601989	中国重工	152,500	847,900.00	0.93
31	600050	中国联通	135,500	834,680.00	0.91
32	601939	建设银行	108,900	810,216.00	0.88
33	601628	中国人寿	26,800	758,976.00	0.83
34	601336	新华保险	13,200	726,396.00	0.79
35	601006	大秦铁路	89,100	720,819.00	0.79
36	600016	民生银行	100,000	635,000.00	0.69
37	601088	中国神华	31,100	633,818.00	0.69
38	601988	中国银行	159,000	594,660.00	0.65
39	601169	北京银行	100,000	591,000.00	0.65
40	600028	中国石化	103,700	567,239.00	0.62
41	601288	农业银行	139,200	501,120.00	0.55

## 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	601318	中国平安	9,828,271.00	36.72
2	600519	贵州茅台	8,973,807.98	33.53
3	600036	招商银行	6,132,822.83	22.91
4	002157	正邦科技	5,808,897.00	21.70
5	300498	温氏股份	5,198,519.00	19.42
6	002124	天邦股份	4,987,450.50	18.63
7	002792	通宇通讯	4,657,815.00	17.40
8	601166	兴业银行	4,640,431.00	17.34
9	002714	牧原股份	4,562,322.50	17.05
10	601688	华泰证券	4,404,329.00	16.46
11	600030	中信证券	4,373,132.67	16.34
12	600887	伊利股份	4,227,387.01	15.79
13	002567	唐人神	4,150,307.50	15.51
14	601601	中国太保	3,966,773.00	14.82
15	600585	海螺水泥	3,802,023.84	14.21
16	002463	沪电股份	3,509,708.00	13.11
17	300136	信维通信	3,470,900.00	12.97
18	000651	格力电器	3,458,478.00	12.92
19	600009	上海机场	3,457,480.00	12.92
20	600570	恒生电子	3,370,919.00	12.59
21	600309	万华化学	3,353,160.00	12.53
22	600276	恒瑞医药	3,319,693.00	12.40
23	300134	大富科技	3,309,773.00	12.37
24	300450	先导智能	3,279,052.60	12.25
25	002796	世嘉科技	3,257,319.00	12.17
26	601066	中信建投	2,910,922.43	10.88
27	600809	山西汾酒	2,731,404.00	10.21
28	600048	保利地产	2,711,522.00	10.13
29	002384	东山精密	2,698,661.86	10.08
30	600728	佳都科技	2,641,381.00	9.87
31	300122	智飞生物	2,620,384.76	9.79
32	002100	天康生物	2,605,520.00	9.74
33	601888	中国国旅	2,589,487.48	9.68
34	300166	东方国信	2,493,721.00	9.32
35	601998	中信银行	2,474,798.00	9.25
36	002475	立讯精密	2,411,398.00	9.01

37	601328	交通银行	2,396,384.00	8.95
38	600016	民生银行	2,390,044.00	8.93
39	002230	科大讯飞	2,369,054.00	8.85
40	601766	中国中车	2,313,252.00	8.64
41	601211	国泰君安	2,289,493.00	8.55
42	600801	华新水泥	2,281,571.40	8.52
43	300322	硕贝德	2,231,745.00	8.34
44	002241	歌尔股份	2,207,769.00	8.25
45	603027	千禾味业	2,192,277.46	8.19
46	601818	光大银行	2,128,963.00	7.95
47	600340	华夏幸福	2,125,015.00	7.94
48	002458	益生股份	2,094,694.00	7.83
49	601939	建设银行	2,070,527.00	7.74
50	002841	视源股份	1,986,033.00	7.42
51	002234	民和股份	1,912,676.00	7.15
52	601668	中国建筑	1,888,696.00	7.06
53	600000	浦发银行	1,872,302.00	7.00
54	600004	白云机场	1,856,149.00	6.94
55	600845	宝信软件	1,784,281.50	6.67
56	601288	农业银行	1,780,235.00	6.65
57	600588	用友网络	1,736,949.40	6.49
58	002456	欧菲光	1,728,070.00	6.46
59	002925	盈趣科技	1,706,458.00	6.38
60	300394	天孚通信	1,693,567.80	6.33
61	603019	中科曙光	1,678,982.00	6.27
62	300373	扬杰科技	1,634,950.00	6.11
63	300457	赢合科技	1,603,885.00	5.99
64	000876	新希望	1,566,024.00	5.85
65	300623	捷捷微电	1,518,164.60	5.67
66	603288	海天味业	1,496,143.00	5.59
67	300323	华灿光电	1,442,937.23	5.39
68	600491	龙元建设	1,439,554.00	5.38
69	000858	五粮液	1,436,085.00	5.37
70	600498	烽火通信	1,426,832.00	5.33
71	000002	万科A	1,398,316.00	5.22
72	600486	扬农化工	1,368,985.72	5.11

73	002185	华天科技	1,354,700.00	5.06
74	300348	长亮科技	1,352,875.00	5.05
75	300059	东方财富	1,340,978.00	5.01
76	601901	方正证券	1,320,558.00	4.93
77	002191	劲嘉股份	1,319,650.00	4.93
78	300550	和仁科技	1,269,599.00	4.74
79	000333	美的集团	1,262,782.00	4.72
80	002371	北方华创	1,250,487.00	4.67
81	601988	中国银行	1,223,226.00	4.57
82	600855	航天长峰	1,220,087.00	4.56
83	002142	宁波银行	1,188,500.00	4.44
84	002366	台海核电	1,162,104.00	4.34
85	000603	盛达矿业	1,159,228.19	4.33
86	600325	华发股份	1,144,061.00	4.27
87	000975	银泰资源	1,126,109.00	4.21
88	601169	北京银行	1,122,895.00	4.20
89	600456	宝钛股份	1,121,795.96	4.19
90	300408	三环集团	1,113,223.00	4.16
91	300607	拓斯达	1,100,186.00	4.11
92	600028	中国石化	1,089,891.00	4.07
93	600104	上汽集团	1,089,382.00	4.07
94	000596	古井贡酒	1,082,346.00	4.04
95	300001	特锐德	1,043,141.00	3.90
96	603305	旭升股份	1,040,379.00	3.89
97	000426	兴业矿业	1,036,383.00	3.87
98	601012	隆基股份	1,032,488.00	3.86
99	002916	深南电路	1,004,400.00	3.75
100	002304	洋河股份	1,001,921.00	3.74
101	000860	顺鑫农业	986,892.00	3.69
102	600690	海尔智家	985,804.00	3.68
103	600884	杉杉股份	974,822.00	3.64
104	600999	招商证券	972,382.00	3.63
105	300566	激智科技	969,787.75	3.62
106	600547	山东黄金	942,400.00	3.52
107	002385	大北农	940,827.00	3.52
108	600019	宝钢股份	938,327.00	3.51



109	002439	启明星辰	927,374.00	3.46
110	002281	光迅科技	916,573.27	3.42
111	000601	韶能股份	904,572.00	3.38
112	603369	今世缘	877,547.00	3.28
113	002407	多氟多	868,233.00	3.24
114	603517	绝味食品	863,872.00	3.23
115	002698	博实股份	854,716.00	3.19
116	000568	泸州老窖	851,616.00	3.18
117	300735	光弘科技	850,410.00	3.18
118	002202	金风科技	843,000.00	3.15
119	600050	中国联通	839,050.00	3.13
120	300601	康泰生物	834,766.03	3.12
121	002050	三花智控	831,056.00	3.11
122	300570	太辰光	820,869.00	3.07
123	603363	傲农生物	819,000.00	3.06
124	002557	洽洽食品	816,267.00	3.05
125	000100	TCL 集团	810,000.00	3.03
126	300604	长川科技	808,515.00	3.02
127	000425	徐工机械	806,331.00	3.01
128	600584	长电科技	803,000.00	3.00
129	603659	璞泰来	801,474.00	2.99
130	601989	中国重工	793,012.00	2.96
131	600549	厦门钨业	789,880.00	2.95
132	300672	国科微	789,584.00	2.95
133	002508	老板电器	781,499.00	2.92
134	002851	麦格米特	778,668.80	2.91
135	300098	高新兴	770,785.00	2.88
136	601006	大秦铁路	759,454.00	2.84
137	603690	至纯科技	752,062.00	2.81
138	000550	江铃汽车	739,808.00	2.76
139	000503	国新健康	727,108.00	2.72
140	601628	中国人寿	724,167.00	2.71
141	002709	天赐材料	714,679.00	2.67
142	300142	沃森生物	708,343.00	2.65
143	603866	桃李面包	703,915.00	2.63
144	600093	易见股份	702,469.00	2.62

145	002373	千方科技	702,098.00	2.62
146	300253	卫宁健康	698,281.00	2.61
147	002930	宏川智慧	693,750.00	2.59
148	601336	新华保险	688,731.00	2.57
149	002614	奥佳华	684,663.00	2.56
150	002156	通富微电	677,961.00	2.53
151	600029	南方航空	676,800.00	2.53
152	300433	蓝思科技	648,117.00	2.42
153	600259	广晟有色	632,544.00	2.36
154	603180	金牌厨柜	628,865.00	2.35
155	002747	埃斯顿	627,027.00	2.34
156	000001	平安银行	627,000.00	2.34
157	300226	上海钢联	623,604.00	2.33
158	300531	优博讯	618,033.00	2.31
159	603666	亿嘉和	613,359.00	2.29
160	601088	中国神华	610,199.00	2.28
161	300170	汉得信息	609,824.00	2.28
162	300659	中孚信息	609,292.00	2.28
163	002466	天齐锂业	591,750.00	2.21
164	603579	荣泰健康	591,138.00	2.21
165	002398	建研集团	586,255.55	2.19
166	300316	晶盛机电	586,090.00	2.19
167	300456	耐威科技	580,671.00	2.17
168	002547	春兴精工	567,167.00	2.12
169	600406	国电南瑞	565,415.00	2.11
170	300454	深信服	556,664.00	2.08

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值
----	------	------	----------	-----------

				比例 (%)
1	002157	正邦科技	6,470,225.31	24.17
2	300498	温氏股份	5,442,209.12	20.33
3	002124	天邦股份	5,339,833.73	19.95
4	002792	通宇通讯	4,735,716.13	17.69
5	002714	牧原股份	4,698,312.27	17.55
6	002567	唐人神	4,001,973.25	14.95
7	002463	沪电股份	3,712,157.78	13.87
8	300136	信维通信	3,533,773.15	13.20
9	600570	恒生电子	3,329,130.16	12.44
10	601066	中信建投	3,308,487.52	12.36
11	300134	大富科技	3,126,702.24	11.68
12	002796	世嘉科技	3,109,730.98	11.62
13	300450	先导智能	3,022,149.73	11.29
14	300122	智飞生物	2,787,100.85	10.41
15	002384	东山精密	2,723,824.47	10.18
16	600728	佳都科技	2,723,318.25	10.18
17	002100	天康生物	2,584,139.58	9.66
18	300166	东方国信	2,553,897.18	9.54
19	002475	立讯精密	2,477,864.06	9.26
20	002230	科大讯飞	2,405,645.49	8.99
21	601318	中国平安	2,376,457.93	8.88
22	002241	歌尔股份	2,309,793.44	8.63
23	603027	千禾味业	2,239,935.36	8.37
24	300322	硕贝德	2,223,087.34	8.31
25	601688	华泰证券	2,198,741.29	8.22
26	002841	视源股份	1,980,544.47	7.40
27	600004	白云机场	1,927,938.21	7.20
28	600588	用友网络	1,880,392.09	7.03
29	000876	新希望	1,804,793.90	6.74
30	603019	中科曙光	1,798,082.33	6.72
31	002458	益生股份	1,791,150.72	6.69
32	600016	民生银行	1,771,770.00	6.62
33	002456	欧菲光	1,767,013.09	6.60
34	002925	盈趣科技	1,738,638.26	6.50
35	600845	宝信软件	1,735,785.50	6.49
36	300373	扬杰科技	1,688,691.98	6.31
37	300394	天孚通信	1,673,932.16	6.25

38	603288	海天味业	1,672,547.78	6.25
39	002234	民和股份	1,644,266.24	6.14
40	300623	捷捷微电	1,602,755.53	5.99
41	600030	中信证券	1,589,914.77	5.94
42	601998	中信银行	1,553,600.00	5.80
43	300457	赢合科技	1,537,008.18	5.74
44	300323	华灿光电	1,535,335.79	5.74
45	300348	长亮科技	1,521,830.38	5.69
46	600519	贵州茅台	1,508,348.57	5.64
47	000858	五粮液	1,483,650.00	5.54
48	600491	龙元建设	1,467,702.00	5.48
49	601328	交通银行	1,466,100.00	5.48
50	600048	保利地产	1,453,501.93	5.43
51	600498	烽火通信	1,439,724.27	5.38
52	000002	万科A	1,422,479.84	5.31
53	002371	北方华创	1,349,219.15	5.04
54	002185	华天科技	1,333,973.87	4.98
55	002191	劲嘉股份	1,319,360.01	4.93
56	000651	格力电器	1,299,840.82	4.86
57	600340	华夏幸福	1,292,073.00	4.83
58	300059	东方财富	1,291,752.34	4.83
59	600855	航天长峰	1,274,905.27	4.76
60	601939	建设银行	1,270,644.29	4.75
61	601901	方正证券	1,260,069.45	4.71
62	000333	美的集团	1,246,914.57	4.66
63	601288	农业银行	1,224,600.00	4.58
64	002142	宁波银行	1,222,650.00	4.57
65	600325	华发股份	1,195,925.68	4.47
66	002366	台海核电	1,191,002.28	4.45
67	601766	中国中车	1,190,232.00	4.45
68	300607	拓斯达	1,156,025.80	4.32
69	000603	盛达矿业	1,153,891.17	4.31
70	300408	三环集团	1,153,035.48	4.31
71	600456	宝钛股份	1,153,018.77	4.31
72	300550	和仁科技	1,146,922.50	4.29
73	603305	旭升股份	1,095,837.02	4.09
74	601818	光大银行	1,091,170.00	4.08
75	000975	银泰资源	1,067,766.65	3.99

76	000596	古井贡酒	1,020,396.40	3.81
77	000860	顺鑫农业	1,010,066.49	3.77
78	002304	洋河股份	1,008,618.68	3.77
79	002281	光迅科技	1,004,529.36	3.75
80	601012	隆基股份	1,002,752.17	3.75
81	002698	博实股份	996,136.16	3.72
82	000426	兴业矿业	995,470.56	3.72
83	600309	万华化学	980,413.54	3.66
84	600884	杉杉股份	972,553.75	3.63
85	300566	激智科技	966,145.79	3.61
86	300001	特锐德	947,542.17	3.54
87	600547	山东黄金	930,656.01	3.48
88	600000	浦发银行	928,050.00	3.47
89	000601	韶能股份	920,579.56	3.44
90	600999	招商证券	915,041.56	3.42
91	603363	傲农生物	909,503.00	3.40
92	600093	易见股份	900,000.00	3.36
93	603369	今世缘	894,920.52	3.34
94	601211	国泰君安	894,468.67	3.34
95	300601	康泰生物	884,267.00	3.30
96	601166	兴业银行	879,586.84	3.29
97	000503	国新健康	871,500.00	3.26
98	603517	绝味食品	868,929.07	3.25
99	002916	深南电路	865,282.00	3.23
100	000425	徐工机械	852,482.17	3.19
101	000550	江铃汽车	846,362.09	3.16
102	603659	璞泰来	844,106.64	3.15
103	000063	中兴通讯	837,462.08	3.13
104	002385	大北农	830,207.00	3.10
105	002439	启明星辰	828,188.33	3.09
106	002851	麦格米特	822,830.50	3.07
107	002050	三花智控	813,344.51	3.04
108	000100	TCL 集团	813,053.00	3.04
109	300570	太辰光	812,802.94	3.04
110	000568	泸州老窖	811,457.00	3.03
111	600549	厦门钨业	797,443.31	2.98
112	300098	高新兴	792,290.80	2.96
113	002557	洽洽食品	783,910.85	2.93

114	300604	长川科技	759,422.45	2.84
115	002202	金风科技	758,017.48	2.83
116	002407	多氟多	736,511.00	2.75
117	002373	千方科技	723,501.26	2.70
118	600009	上海机场	722,736.47	2.70
119	002508	老板电器	720,883.57	2.69
120	600584	长电科技	720,072.63	2.69
121	002614	奥佳华	711,911.00	2.66
122	600259	广晟有色	708,547.80	2.65
123	002398	建研集团	704,405.15	2.63
124	603866	桃李面包	703,048.72	2.63
125	002930	宏川智慧	690,627.65	2.58
126	600029	南方航空	685,600.00	2.56
127	002747	埃斯顿	685,421.02	2.56
128	603666	亿嘉和	675,717.08	2.52
129	603690	至纯科技	672,306.78	2.51
130	300735	光弘科技	672,000.00	2.51
131	300672	国科微	663,512.42	2.48
132	300531	优博讯	637,752.32	2.38
133	002709	天赐材料	635,722.65	2.38
134	002156	通富微电	631,570.70	2.36
135	601988	中国银行	627,468.74	2.34
136	603180	金牌厨柜	624,053.00	2.33
137	300433	蓝思科技	622,930.00	2.33
138	300253	卫宁健康	622,109.52	2.32
139	300142	沃森生物	611,663.00	2.29
140	300226	上海钢联	604,338.00	2.26
141	300456	耐威科技	600,797.82	2.24
142	300316	晶盛机电	598,208.60	2.24
143	002466	天齐锂业	594,872.13	2.22
144	000001	平安银行	586,592.00	2.19
145	600406	国电南瑞	580,055.84	2.17
146	603579	荣泰健康	556,763.25	2.08
147	600353	旭光股份	548,983.24	2.05
148	600028	中国石化	545,000.00	2.04
149	002547	春兴精工	541,600.00	2.02
150	300399	京天利	538,838.95	2.01
151	601169	北京银行	537,168.00	2.01

152	300170	汉得信息	536,743.86	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	313,761,942.43
卖出股票收入（成交）总额	234,483,333.61

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：（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

### 7.10.1 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

注：（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

本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	80,713.58
2	应收证券清算款	669,866.40
3	应收股利	-
4	应收利息	2,123.13
5	应收申购款	99.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-



9	合计	752,802.96
---	----	------------

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末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

注：本基金本报告期末未存在流通受限的股票。

## § 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

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
783	135,584.47	9,149,060.37	8.62%	97,013,578.74	91.38%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	957,540.44	0.9020%

### 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有 资金	4,975,124.38	4.69	4,975,124.38	4.69	3年
基金管理人高级 管理人员	296,700.87	0.28	296,700.87	0.28	3年
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	4,173,935.99	3.93	4,173,935.99	3.93	3年
其他	1,634,982.83	1.54	1,634,982.83	1.54	3年
合计	11,080,744.07	10.44	11,080,744.07	10.44	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2016 年 10 月 25 日 ）基金份额总额	213,733,032.47
本报告期期初基金份额总额	33,214,590.25
本报告期期间基金总申购份额	74,561,775.86
减：本报告期期间基金总赎回份额	1,613,727.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	106,162,639.11

## § 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

本基金管理人于 2019 年 4 月 23 日发布公告，胡冬辉女士自 4 月 19 日起担任公司董事长，朱为绎先生自 4 月 19 日起不再担任公司董事长。本基金管理人于 5 月 30 日发布公告，李昱女士自 5 月 28 日起不再担任公司副总经理。

本报告期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	股票交易	应支付该券商的佣金
------	------	-----------

	交易单元数量	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	备注
华泰证券	2	174,381,329.83	31.81%	127,525.75	30.72%	-
国金证券	2	119,116,780.10	21.73%	87,109.88	20.98%	-
兴业证券	2	114,836,580.80	20.95%	83,979.49	20.23%	-
银河证券	2	70,931,325.16	12.94%	66,058.83	15.91%	-
国信证券	2	54,033,190.56	9.86%	39,514.40	9.52%	-
长江证券	1	12,865,536.59	2.35%	9,408.57	2.27%	-
太平洋证券	1	2,076,293.00	0.38%	1,518.36	0.37%	-
东莞证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

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

2、交易席位选择流程：

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

### 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
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	4,914.80	0.03%	20,700,000.00	14.15%	-	-
兴业证券	18,658,108.60	99.97%	125,600,000.00	85.85%	-	-
银河证券	1,512.73	0.01%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中科沃土基金管理有限公司关于旗下基金 2018 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 1 月 2 日
2	中科沃土基金管理有限公司关于基金经理助理离任的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 2 月 1 日
3	中科沃土基金管理有限公司关于在广州农商行开通旗下部分基金转换业务的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 3 月 8 日
4	中科沃土基金管理有限公司关于旗下基金开通转换业务的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 3 月 26 日
5	中科沃土基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 4 月 1 日
6	中科沃土基金管理有限公司关于新增基煜基金为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 4 月 19 日
7	中科沃土基金管理有限公司关于新增泰诚财富为旗下部分基金销	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 4 月 26 日

	售机构的公告		
8	关于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变更公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 5 月 8 日
9	中科沃土基金管理有限公司关于新增汇成基金为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 5 月 16 日
10	中科沃土基金管理有限公司关于新增唐鼎耀华为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 5 月 24 日
11	中科沃土基金管理有限公司关于新增利得基金为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 6 月 4 日
12	中科沃土基金管理有限公司关于新增阳光人寿为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 6 月 6 日
13	中科沃土基金管理有限公司关于新增诺亚正行为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 6 月 12 日
14	中科沃土基金管理有限公司关于新增前海财厚为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 6 月 14 日
15	中科沃土基金管理有限公司关于旗下基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 6 月 26 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	20190613-20190630	-	26,495,242.68	-	26,495,242.68	24.96%
	2	20190619-20190630	-	35,936,471.51	-	35,936,471.51	33.85%
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。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鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的文件；
2. 《中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；
3. 《中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
5. 基金托管人业务资格批件、营业执照；
6. 关于申请募集注册中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金之法律意见书；
7. 中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中科沃土基金管理有限公司

2019 年 8 月 26 日