

# 中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资 基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：中科沃土基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 30 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 2021 年 3 月 29 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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为基金财务出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....         | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7         |
| 3.3 其他指标.....                                | 错误！未定义书签。 |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 9         |
| <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.....                 | 11        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 13        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 14        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 14        |
| 4.9 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        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>15</b> |
| 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....      | 15        |
| <b>§6 审计报告</b> .....                         | <b>16</b> |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 错误！未定义书签。 |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 错误！未定义书签。 |
| <b>§7 年度财务报表</b> .....                       | <b>19</b> |
| 7.1 资产负债表.....                               | 19        |
| 7.2 利润表.....                                 | 20        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 21        |
| 7.4 报表附注.....                                | 22        |
| <b>§8 投资组合报告</b> .....                       | <b>47</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 47        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 47        |
| 8.3 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        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 49        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 51        |
| 8.6 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.....      | 51        |

|   |                  |
|---|------------------|
| 8.7 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 ..... | 51               |
| 8.8 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 ..... | 52               |
| 8.9 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 .....    | 52               |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 52               |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 52               |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 52               |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>53</b>        |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 53               |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 53               |
| 9.3 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 .....     | 53               |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>54</b>        |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>55</b>        |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 55               |
| 11.2 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 .....      | 55               |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 55               |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 55               |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 55               |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 55               |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 55               |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 57               |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>             | <b>错误！未定义书签。</b> |
| 12.1 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 .....    | <b>错误！未定义书签。</b> |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | <b>错误！未定义书签。</b> |
| <b>§13 备查文件目录 .....</b>                     | <b>58</b>        |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 58               |
| 13.2 存放地点 .....                             | 59               |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 59               |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                       |
|------------|-----------------------|
| 基金名称       | 中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 中科沃土转型升级混合            |
| 基金主代码      | 005281                |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                |
| 基金合同生效日    | 2018 年 1 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 | 11,321,486.83 份       |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 在严格控制风险的前提下，把握中国经济转型升级过程中所蕴含的投资机会，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。 |
| 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    |      | 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）       | 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   |      | 于建伟  | 陈四清                 |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报  |
| 登载基金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                                 |
|--------|----------------------|--------------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼 |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

#### 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 | 2020 年        | 2019 年        | 2018年1月25日(基金合同生效日)-2018年12月31日 |
|---------------|---------------|---------------|---------------------------------|
| 本期已实现收益       | 11,991,244.72 | 8,227,552.60  | -23,293,683.58                  |
| 本期利润          | 12,597,184.76 | 11,964,376.06 | -25,849,930.99                  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.5043        | 0.1524        | -0.2039                         |
| 本期加权平均净值利润率   | 46.70%        | 17.98%        | -22.41%                         |
| 本期基金份额净值增长率   | 44.11%        | 18.94%        | -22.54%                         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2020 年末       | 2019 年末       | 2018 年末                         |
| 期末可供分配利润      | 3,709,891.79  | -4,998,188.78 | -21,234,231.41                  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.3277        | -0.0815       | -0.2254                         |
| 期末基金资产净值      | 15,031,378.62 | 56,519,566.98 | 72,976,546.81                   |
| 期末基金份额净值      | 1.3277        | 0.9213        | 0.7746                          |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2020 年末       | 2019 年末       | 2018 年末                         |
| 基金份额累计净值增长率   | 32.77%        | -7.87%        | -22.54%                         |

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

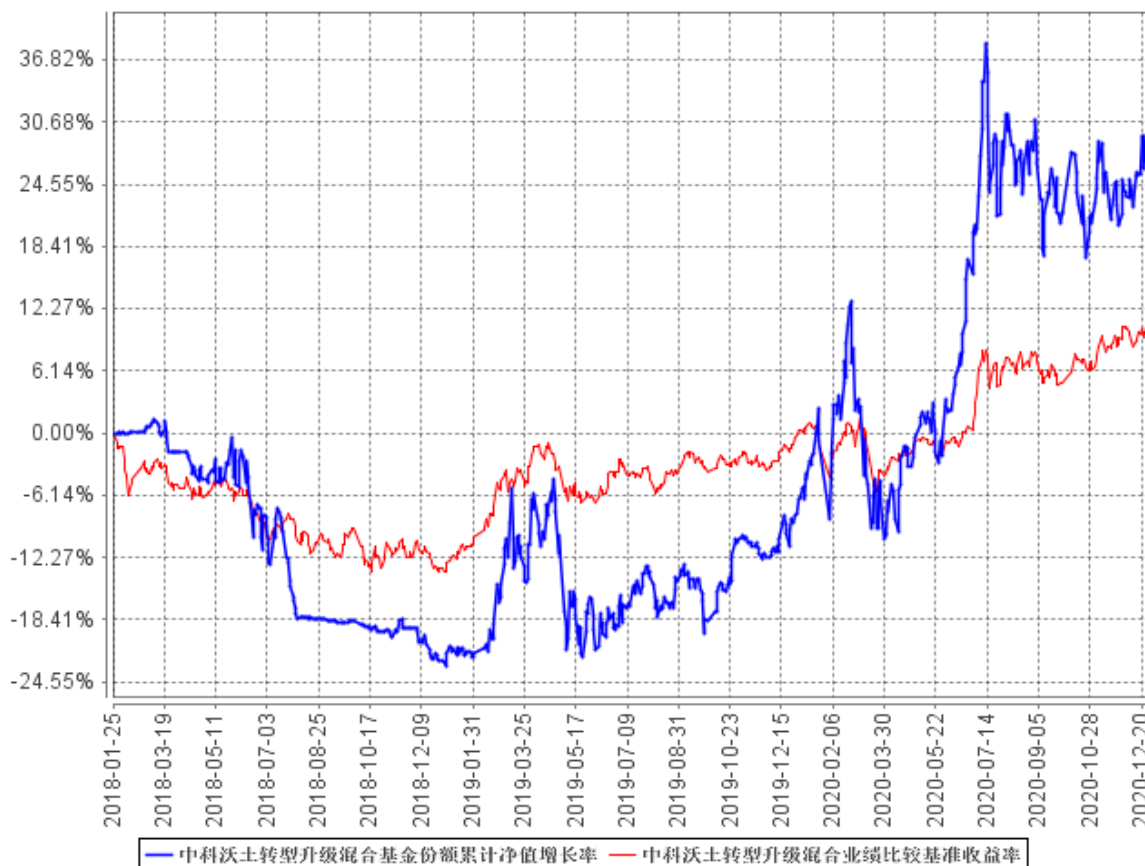
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 9.10%    | 1.61%       | 7.12%      | 0.50%         | 1.98%  | 1.11% |
| 过去六个月      | 10.87%   | 1.83%       | 12.15%     | 0.66%         | -1.28% | 1.17% |
| 过去一年       | 44.11%   | 2.03%       | 13.57%     | 0.70%         | 30.54% | 1.33% |
| 自基金合同生效起至今 | 32.77%   | 1.58%       | 12.40%     | 0.67%         | 20.37% | 0.91% |

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

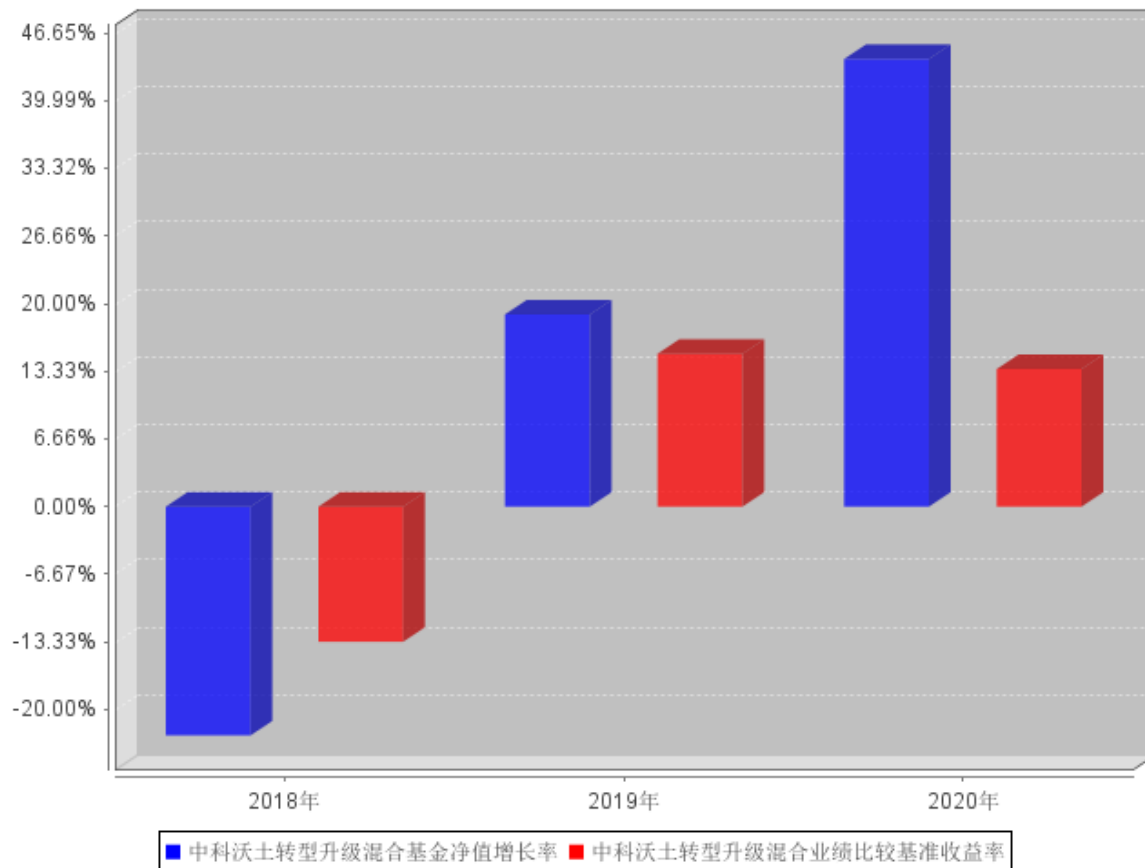
中科沃土转型升级混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中科沃土转型升级混合自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效当年（2018年）按实际存续期计算，未按自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2018年1月25日）至报告期末未进行利润分配。

## § 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 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 12 月 31 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 |        |   |
| 徐力  | 资深研究员、基金经理    | 2019 年 8 月 7 日   | -    | 10 年   | EMBA，工学硕士，具有 13 年实业研发和市场经验，曾任职于华为技术、广船国际和北方烽火，从事证券投资研究工作后历任方正证券、中信建投证券、海通证券和东吴证券研究所首席分析师，赛伯乐投资、江信基金投资研究部研究总监，现任中科沃土基金管理有限公司研究部资深研究员、基金经理。 |
| 孟禄程 | 基金经理、研究部总经理助理 | 2019 年 11 月 20 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长，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。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：1. 此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，徐力、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。

#### 4.2 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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中科沃土基金管理有限公司公平交易管理办法》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、交易执行的内部控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各投资组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统的公平交易功能将自动启用，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序 and 分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常

问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3 日内、5 日内），对我司旗下所有投资组合本年度的同向交易价差情况进行了分析，根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中未出现交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

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

2020 年全年，新冠病毒爆发对经济造成巨大冲击，对生产生活产生长久影响，全球流动性宽松使得权益市场冲击快速修复疫情带来的冲击，伴随着复工复产经济逐步走向复苏权益市场不断创新高。本年度本基金重点布局：1) 疫情导致生产生活方式改变，利好游戏、云办公、消费电子；2) 行业复苏叠加产业升级共振的汽车产业链。展望 2021 年，疫苗接种进展与经济复苏的情况成为影响各国货币政策的重要依据，整体市场较 2020 年波动将加大，但居民加速流向权益市场趋势不变，我们将延续产业升级与景气度持续思路重点布局新能源、传统汽车、5G 及应用（游戏传媒、云计算、消费电子）与生物医药，同时也会适当增加消费行业投资。

#### 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 1.3277 元；本报告期基金份额净值增长率为 44.11%，业绩比较基准收益率为 13.57%。

#### 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 2021 年，疫苗接种进展与经济复苏的情况成为影响各国货币政策的重要依据，整体市场较 2020 年波动将加大，但居民加速流向权益市场趋势不变，市场表现将更加均衡，顺周期、低估值板块阶段性成为增配方向。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规、监管要求的变化和业务发展的实际需要，围绕严守“三条底线”、防控内幕交易等进一步完善公司内部风险控制，强化制度的完善及对制度执行情况的监督检查，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，有效保证了旗下基金运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际，不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，适应公司产品与业务发展的需要，保持公司良好的内控环境。

(2) 严守合规底线、开展合规风险管理工作是监察稽核工作的重中之重。围绕重点开展对全体员工的合规培训教育及考试，建立了基金经理、投资经理上岗前的合规谈话机制，促进公司合规文化建设；不断完善相关机制流程，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易和市场操纵等违法违规行为，完善利益冲突管理相关制度机制。

(3) 坚持规范运作、稳健经营的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统，积极配合各类新产品、新业务、新投资工具的推出和应用，重点加强对高风险业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，加强对投资、交易等业务运作的日常合规检查和反馈提示，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规和基金合同的要求稳健、规范运作。

(4) 对投资交易、销售宣传、人员规范及个人投资申报、运营维稳、反洗钱、IT 治理等方面开展了定期或专项监察检查，推动公司合规、内控体系的健全完善。

(5) 积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关的合规、风控问题提供意见和建议。

(6) 切实把好法律风险和业务风险关；根据公司业务发展的需要，紧贴业务需求，不断提高合同审核效率，有效控制法律风险和业务风险；

(7) 深入贯彻风险为本的监管精神，加强公司洗钱风险管理体系建设，建立优化客户、产品、业务的洗钱风险识别和洗钱风险自评估工作机制，探索实施符合基金业务特征的可疑交易监控模型和方法，开展反洗钱宣传培训、内部审计、信息报送、意见反馈等各项工作。

(8) 紧跟法规变化和业务发展，认真做好公司及旗下各基金的各项信息披露工作，力求信息

披露真实、完整、准确、及时、简明易懂。

(9)不断促进监察稽核自身工具手段和流程的完善,充分法规合规监控与监察稽核的独立性、规范性、针对性与有效性。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,积极健全内部管理制度,不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,努力防范各种风险,切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人已制定基金估值和份额计价的业务管理制度,明确基金估值的程序和技术;设有估值委员会,负责指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运营等方面的专业胜任能力。本基金管理人使用可靠的估值业务系统,估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。基金管理人改变估值技术,导致基金净值变化在 0.25%以上的,对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值价格的最终决策。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 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,本基金本年度未进行利润分配,符合合同规定。

#### 4.9 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,本基金存在连续六十个工作日以上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

报告期内，本基金托管人在对中科沃土转型升级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转型升级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转型升级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。

### 5.3 托管人对本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转型升级灵活配置混合型证券投资基金 2020 年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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2021)第 21282 号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

|                 |   |
|-----------------|---|
| 审计报告标题          | 审计报告  |
| 审计报告收件人         | 中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人  |
| 审计意见            | 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了中科沃土转型升级混合型基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。  |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中科沃土转型升级混合型基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>   |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>中科沃土转型升级混合型基金的基金管理人中科沃土基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估中科沃土转型升级混合型基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算中科沃土转型升级混合型基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> |



|                        |  |
|------------------------|--|
|                        | <p>基金管理人治理层负责监督中科沃土转型升级混合型基金的财务报告过程。</p>   |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中科沃土转型升级混合型基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结</p> |

|           |   |
|-----------|---|
|           | <p>论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中科沃土转型升级混合型基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  |
| 注册会计师的姓名  | 薛竞   周祎   |
| 会计师事务所的地址 | 上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼  |
| 审计报告日期    | 2021 年 3 月 29 日   |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 1,397,192.97                    | 3,479,324.91                     |
| 结算备付金           |            | 28,128.79                       | 5,221,499.98                     |
| 存出保证金           |            | 5,367.36                        | 29,198.12                        |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 13,994,876.65                   | 47,161,601.09                    |
| 其中：股票投资         |            | 13,958,576.65                   | 47,161,601.09                    |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 36,300.00                       | -                                |
| 资产支持证券投资        |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                               | 1,600,000.00                     |
| 应收证券清算款         |            | 1,483,942.05                    | 2,410,975.42                     |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 166.42                          | 1,364.58                         |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 56,888.73                       | 4,384.46                         |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 16,966,562.97                   | 59,908,348.56                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>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          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                               | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                               | 2,399,589.73                     |
| 应付赎回款           |            | 1,771,818.52                    | 489,107.14                       |
| 应付管理人报酬         |            | 20,919.92                       | 71,742.82                        |
| 应付托管费           |            | 3,486.66                        | 11,957.13                        |
| 应付销售服务费         |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 18,200.15                       | 114,310.64                       |
| 应交税费            |            | 0.15                            | -                                |
| 应付利息            |            | -                               | -                                |

|               |          |               |               |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 应付利润          |          | -             | -             |
| 递延所得税负债       |          | -             | -             |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 120,758.95    | 302,074.12    |
| 负债合计          |          | 1,935,184.35  | 3,388,781.58  |
| <b>所有者权益：</b> |          |               |               |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 11,321,486.83 | 61,348,910.07 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 3,709,891.79  | -4,829,343.09 |
| 所有者权益合计       |          | 15,031,378.62 | 56,519,566.98 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 16,966,562.97 | 59,908,348.56 |

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3277 元，基金份额总额 11,321,486.83 份。

## 7.2 利润表

会计主体：中科沃土转型升级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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 12 月 31 日 |
|------------------------|------------|---|--|
| <b>一、收入</b>            |            | 13,454,979.26                             | 14,043,566.49                                  |
| 1. 利息收入                |            | 17,768.01                                 | 240,029.85                                     |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 14,794.71                                 | 114,009.54                                     |
| 债券利息收入                 |            | 3.45                                      | 62,769.41                                      |
| 资产支持证券利息收入             |            | -   | -  |
| 买入返售金融资产收入             |            | 2,969.85                                  | 63,250.90                                      |
| 证券出借利息收入               |            | -   | -  |
| 其他利息收入                 |            | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 12,680,094.72                             | 10,036,292.54                                  |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | 12,514,418.97                             | 9,376,549.63                                   |
| 基金投资收益                 |            | -   | -  |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.13.1 | 258.25                                    | -31,777.98                                     |
| 资产支持证券投资收益             | 7.4.7.13.2 | -   | -  |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.14   | -   | -  |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.15   | -   | -  |
| 股利收益                   | 7.4.7.16   | 165,417.50                                | 691,520.89                                     |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17   | 605,940.04                                | 3,736,823.46                                   |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -   | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.18   | 151,176.49                                | 30,420.64                                      |
| <b>减：二、费用</b>          |            | 857,794.50                                | 2,079,190.43                                   |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 411,957.03                                | 997,448.77                                     |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 68,659.53                                 | 166,241.43                                     |
| 3. 销售服务费               | 7.4.10.2.3 | -   | -  |

|                            |          |               |               |
|----------------------------|----------|---------------|---------------|
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19 | 265,001.99    | 792,564.46    |
| 5. 利息支出                    |          | -             | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -             | -             |
| 6. 税金及附加                   |          | 0.01          | -             |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.20 | 112,175.94    | 122,935.77    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | 12,597,184.76 | 11,964,376.06 |
| 减：所得税费用                    |          | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | 12,597,184.76 | 11,964,376.06 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中科沃土转型升级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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）                        | 61,348,910.07                               | -4,829,343.09 | 56,519,566.98  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 12,597,184.76 | 12,597,184.76  |
| 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）      | -50,027,423.24                              | -4,057,949.88 | -54,085,373.12 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 23,493,510.63                               | 4,551,161.76  | 28,044,672.39  |
| 2. 基金赎回款                               | -73,520,933.87                              | -8,609,111.64 | -82,130,045.51 |
| 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）                        | 11,321,486.83                               | 3,709,891.79  | 15,031,378.62  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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）                        | 94,210,778.22  | -21,234,231.41 | 72,976,546.81  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -              | 11,964,376.06  | 11,964,376.06  |
| 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）      | -32,861,868.15 | 4,440,512.26   | -28,421,355.89 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 2,853,126.95   | -409,128.91    | 2,443,998.04   |
| 2. 基金赎回款                               | -35,714,995.10 | 4,849,641.17   | -30,865,353.93 |
| 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）                        | 61,348,910.07  | -4,829,343.09  | 56,519,566.98  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

|                                |                                |                               |
|--------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|
| <u>          于建伟          </u> | <u>          程文卫          </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                       |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中科沃土转型升级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 1484 号关于准予《中科沃土转型升级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《中科沃土转型升级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 252,803,465.23 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2018)验字第 61247680\_G01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 252,921,526.43 份基金份额，其中认购资金利息折合 118,061.20 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基

金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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的股票（含主板、中小板、创业板、存托凭证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。其中，股票投资比例为基金资产的 0%-95%，其中，投资于转型升级主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中债综合全价(总值)指数收益率×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 3 月 29 日批准报出。

#### 7.4.2 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》、《中科沃土转型升级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 7.4.4 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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2020 年 12 月 31 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

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

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

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

#### (2) 金融负债的分类

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终



止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证

会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 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

产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 1,397,192.97            | 3,479,324.91             |
| 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：            | 1,397,192.97            | 3,479,324.91             |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 |               |              |
|-------------------|-------------------------|---------------|--------------|
|                   | 成本                      | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票                | 12,172,060.56           | 13,958,576.65 | 1,786,516.09 |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                       | -             | -            |

|               |                     |               |               |              |
|---------------|---------------------|---------------|---------------|--------------|
| 债券            | 交易所市场               | 36,300.00     | 36,300.00     | -            |
|               | 银行间市场               | -             | -             | -            |
|               | 合计                  | 36,300.00     | 36,300.00     | -            |
| 资产支持证券        |                     | -             | -             | -            |
| 基金            |                     | -             | -             | -            |
| 其他            |                     | -             | -             | -            |
| 合计            |                     | 12,208,360.56 | 13,994,876.65 | 1,786,516.09 |
| 项目            | 上年度末<br>2019年12月31日 |               |               |              |
|               | 成本                  | 公允价值          | 公允价值变动        |              |
| 股票            |                     | 45,981,025.04 | 47,161,601.09 | 1,180,576.05 |
| 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            |                     | 45,981,025.04 | 47,161,601.09 | 1,180,576.05 |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 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<br>2020年12月31日  |           |
|-------|---------------------|-----------|
|       | 账面余额                | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                   | -         |
| 银行间市场 | -                   | -         |
| 合计    | -                   | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2019年12月31日 |           |
|       | 账面余额                | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 1,600,000.00        | -         |
| 银行间市场 | -                   | -         |
| 合计    | 1,600,000.00        | -         |

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2020年12月31日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息   | 146.58             | 1,240.39            |
| 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  | 13.86              | 109.67              |
| 应收债券利息     | 3.34               | -                   |
| 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         | 2.64               | 14.52               |
| 合计         | 166.42             | 1,364.58            |

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020年12月31日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 18,200.15          | 114,310.64          |
| 银行间市场应付交易费用 | -                  | -                   |
| 合计          | 18,200.15          | 114,310.64          |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020年12月31日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | 758.95             | 1,074.12            |
| 应付证券出借违约金   | -                  | -                   |
| 预提费用        | 120,000.00         | 301,000.00          |

|    |            |            |
|----|------------|------------|
| 合计 | 120,758.95 | 302,074.12 |
|----|------------|------------|

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |                |
|---------------|-----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额           |
| 上年度末          | 61,348,910.07               | 61,348,910.07  |
| 本期申购          | 23,493,510.63               | 23,493,510.63  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -73,520,933.87              | -73,520,933.87 |
| - 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           | 11,321,486.83               | 11,321,486.83  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额

### 7.4.7.10 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           | -4,998,188.78 | 168,845.69    | -4,829,343.09 |
| 本期利润           | 11,991,244.72 | 605,940.04    | 12,597,184.76 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,617,651.75 | -1,440,298.13 | -4,057,949.88 |
| 其中：基金申购款       | 3,947,328.65  | 603,833.11    | 4,551,161.76  |
| 基金赎回款          | -6,564,980.40 | -2,044,131.24 | -8,609,111.64 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 4,375,404.19  | -665,512.40   | 3,709,891.79  |

### 7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 活期存款利息收入 | 12,606.12             | 81,725.65             |
| 定期存款利息收入 | -                     | 23,250.00             |
| 其他存款利息收入 | -                     | -                     |



|           |           |            |
|-----------|-----------|------------|
| 结算备付金利息收入 | 1,806.51  | 8,116.03   |
| 其他        | 382.08    | 917.86     |
| 合计        | 14,794.71 | 114,009.54 |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2020年1月1日至2020<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019<br>年12月31日 |
|------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 112,744,653.57                  | 296,286,039.00                       |
| 减：卖出股票成本总额 | 100,230,234.60                  | 286,909,489.37                       |
| 买卖股票差价收入   | 12,514,418.97                   | 9,376,549.63                         |

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                          | 本期<br>2020年1月1日至2020<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年<br>12月31日 |
|-----------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑<br>付）成交总额   | 1,258.50                        | 7,517,331.03                         |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到<br>期兑付）成本总额 | 1,000.00                        | 7,287,457.98                         |
| 减：应收利息总额                    | 0.25                            | 261,651.03                           |
| 买卖债券差价收入                    | 258.25                          | -31,777.98                           |

##### 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |
|---------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 165,417.50                  | 691,520.89                       |
| 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            | 165,417.50                  | 691,520.89                       |

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |
|------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 605,940.04                  | 3,736,823.46                     |
| ——股票投资                 | 605,940.04                  | 3,723,571.88                     |
| ——债券投资                 | -                           | 13,251.58                        |
| ——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                     | 605,940.04                  | 3,736,823.46                     |

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 150,998.54                  | 30,420.12                        |
| 基金转换费收入 | 175.94                      | 0.52                             |

|    |            |           |
|----|------------|-----------|
| 其他 | 2.01       | -         |
| 合计 | 151,176.49 | 30,420.64 |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
|-----------|--|---|
| 交易所市场交易费用 | 265,001.99                             | 792,564.46                                  |
| 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        | 265,001.99                             | 792,564.46                                  |

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
|---------|--|---|
| 审计费用    | 40,000.00                              | 40,000.00                                   |
| 信息披露费   | 69,000.00                              | 80,000.00                                   |
| 证券出借违约金 | -                                      | -   |
| 银行汇划费   | 3,175.94                               | 2,935.77                                    |
| 其他      | -                                      | -   |
| 合计      | 112,175.94                             | 122,935.77                                  |

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 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。

#### 7.4.8.2 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。

### 7.4.9 关联方关系

| 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 |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） | 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              |
| 广东普瑞投资发展合伙企业（有限合伙）     | 基金管理人的股东              |
| 珠海横琴沃海投资合伙企业（有限合伙）     | 基金管理人的股东              |
| 珠海横琴沃土创业投资有限公司         | 基金管理人的股东              |
| 珠海横琴沃智投资合伙企业（有限合伙）     | 基金管理人的股东              |
| 珠海横琴沃富投资合伙企业（有限合伙）     | 基金管理人的股东              |
| 珠海横琴沃泽投资合伙企业（有限合伙）     | 基金管理人的股东              |
| 广州西拓投资合伙企业（有限合伙）       | 基金管理人的股东              |
| 珠海横琴沃信投资合伙企业（有限合伙）     | 基金管理人的股东              |
| 中科招商投资管理集团股份有限公司       | 基金管理人股东的控股股东          |

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据 2020 年 7 月 17 日《中科沃土基金管理有限公司关于公司股东名称变更的公告》，公司股东名称由“珠海横琴西拓投资合伙企业（有限合伙）”变更为“广州西拓投资合伙企业（有限合伙）”。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

##### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 7.4.10.1.5 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未有应支付关联方的佣金。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 411,957.03                             | 997,448.77                                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 240,190.90                             | 640,188.61                                  |

注：支付基金管理人中科沃土基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 68,659.53                              | 166,241.43                                  |

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

### 7.4.10.3 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的债券(含回购)交易。

### 7.4.10.4 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行证券出借业务。

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未出现基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

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

况。

#### 7.4.10.6 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<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |           | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31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 | 1,397,192.97                | 12,606.12 | 3,479,324.91                     | 81,725.65 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

| 7.4.12.1.2 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<br>(单位：张) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 128142               | 新乳转债 | 2020年12月18日 | 2021年1月19日 | 新债未上市  | 100.00 | 100.00 | 363          | 36,300.00 | 36,300.00 | -  |

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金无转融通业务。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 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。

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发

行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 12 月 31 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 0.24%(2019 年 12 月 31 日：本基金无债券投资)。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公



司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020年12月<br>31日  | 1年以内         | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计            |
|-------------------------|--------------|------|------|---------------|---------------|
| 资产                      |              |      |      |               |               |
| 银行存款                    | 1,397,192.97 | -    | -    | -             | 1,397,192.97  |
| 结算备付金                   | 28,128.79    | -    | -    | -             | 28,128.79     |
| 存出保证金                   | 5,367.36     | -    | -    | -             | 5,367.36      |
| 交易性金融资产                 | 36,300.00    | -    | -    | 13,958,576.65 | 13,994,876.65 |
| 应收证券清算款                 | -            | -    | -    | 1,483,942.05  | 1,483,942.05  |
| 应收利息                    | -            | -    | -    | 166.42        | 166.42        |
| 应收申购款                   | -            | -    | -    | 56,888.73     | 56,888.73     |
| 其他资产                    | -            | -    | -    | -             | -             |
| 资产总计                    | 1,466,989.12 | -    | -    | 15,499,573.85 | 16,966,562.97 |
| 负债                      |              |      |      |               |               |
| 应付赎回款                   | -            | -    | -    | 1,771,818.52  | 1,771,818.52  |
| 应付管理人报酬                 | -            | -    | -    | 20,919.92     | 20,919.92     |
| 应付托管费                   | -            | -    | -    | 3,486.66      | 3,486.66      |
| 应付交易费用                  | -            | -    | -    | 18,200.15     | 18,200.15     |
| 应交税费                    | -            | -    | -    | 0.15          | 0.15          |
| 其他负债                    | -            | -    | -    | 120,758.95    | 120,758.95    |
| 负债总计                    | -            | -    | -    | 1,935,184.35  | 1,935,184.35  |
| 利率敏感度缺口                 | 1,466,989.12 | -    | -    | 13,564,389.50 | 15,031,378.62 |
| 上年度末<br>2019年12月<br>31日 | 1年以内         | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计            |
| 资产                      |              |      |      |               |               |
| 银行存款                    | 3,479,324.91 | -    | -    | -             | 3,479,324.91  |

|          |               |   |   |               |               |
|----------|---------------|---|---|---------------|---------------|
| 结算备付金    | 5,221,499.98  | - | - | -             | 5,221,499.98  |
| 存出保证金    | 29,198.12     | - | - | -             | 29,198.12     |
| 交易性金融资产  | -             | - | - | 47,161,601.09 | 47,161,601.09 |
| 买入返售金融资产 | 1,600,000.00  | - | - | -             | 1,600,000.00  |
| 应收证券清算款  | -             | - | - | 2,410,975.42  | 2,410,975.42  |
| 应收利息     | -             | - | - | 1,364.58      | 1,364.58      |
| 应收申购款    | -             | - | - | 4,384.46      | 4,384.46      |
| 资产总计     | 10,330,023.01 | - | - | 49,578,325.55 | 59,908,348.56 |
| 负债       | -             | - | - | -             | -             |
| 应付证券清算款  | -             | - | - | 2,399,589.73  | 2,399,589.73  |
| 应付赎回款    | -             | - | - | 489,107.14    | 489,107.14    |
| 应付管理人报酬  | -             | - | - | 71,742.82     | 71,742.82     |
| 应付托管费    | -             | - | - | 11,957.13     | 11,957.13     |
| 应付交易费用   | -             | - | - | 114,310.64    | 114,310.64    |
| 其他负债     | -             | - | - | 302,074.12    | 302,074.12    |
| 负债总计     | -             | - | - | 3,388,781.58  | 3,388,781.58  |
| 利率敏感度缺口  | 10,330,023.01 | - | - | 46,189,543.97 | 56,519,566.98 |

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 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 0.24%(2019 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格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除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的

影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-95%，其中，投资于转型升级主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |                       |
|---------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|               | 公允价值                    | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 13,958,576.65           | 92.86                    | 47,161,601.09            | 83.44                 |
| 交易性金融资产-基金投资  | -                       | -                        | -                        | -                     |
| 交易性金融资产-债券投资  | 36,300.00               | 0.24                     | -                        | -                     |
| 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            | 13,994,876.65           | 93.10                    | 47,161,601.09            | 83.44                 |

### 7.4.13.4.3.2 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（2020年12月31日）            | 上年度末（2019年12月31日） |
|                | 1. 业绩比较基准上升 5%       | 783,793.47                  | 2,127,556.14      |
| 2. 业绩比较基准下降 5% | -783,793.47          | -2,127,556.14               |                   |

### 7.4.14 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 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 13,958,576.65 元，属于第二层次的余额为 36,300.00 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 47,155,023.05 元，第二层次 6,578.04 元，无第三层次)。

(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 12 月 31 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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              | 13,958,576.65 | 82.27         |
|    | 其中：股票             | 13,958,576.65 | 82.27         |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 36,300.00     | 0.21          |
|    | 其中：债券             | 36,300.00     | 0.21          |
|    | 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      | 1,425,321.76  | 8.40          |
| 8  | 其他各项资产            | 1,546,364.56  | 9.11          |
| 9  | 合计                | 16,966,562.97 | 100.00        |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -            | -             |
| B  | 采矿业              | -            | -             |
| C  | 制造业              | 9,183,222.30 | 61.09         |
| 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           | -            | -             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 434,877.90   | 2.89          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 4,259,644.45 | 28.34         |
| J  | 金融业              | -            | -             |
| 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       | 80,832.00    | 0.54          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -            | -             |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| 0 | 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            | 13,958,576.65 | 92.86 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本报告期末本基金未持有港股通投资股票。

### 8.3 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  | 688111 | 金山办公  | 3,331  | 1,369,041.00 | 9.11         |
| 2  | 600066 | 宇通客车  | 73,400 | 1,241,928.00 | 8.26         |
| 3  | 002709 | 天赐材料  | 8,500  | 882,300.00   | 5.87         |
| 4  | 300274 | 阳光电源  | 12,049 | 870,901.72   | 5.79         |
| 5  | 688388 | 嘉元科技  | 9,487  | 836,184.18   | 5.56         |
| 6  | 002475 | 立讯精密  | 12,546 | 704,081.52   | 4.68         |
| 7  | 002555 | 三七互娱  | 21,135 | 660,046.05   | 4.39         |
| 8  | 002946 | 新乳业   | 36,800 | 648,048.00   | 4.31         |
| 9  | 600418 | 江淮汽车  | 50,900 | 622,507.00   | 4.14         |
| 10 | 000725 | 京东方 A | 99,700 | 598,200.00   | 3.98         |
| 11 | 002624 | 完美世界  | 20,071 | 592,094.50   | 3.94         |
| 12 | 300136 | 信维通信  | 15,496 | 555,996.48   | 3.70         |
| 13 | 300418 | 昆仑万维  | 25,342 | 505,572.90   | 3.36         |
| 14 | 603444 | 吉比特   | 1,165  | 496,290.00   | 3.30         |
| 15 | 300031 | 宝通科技  | 25,100 | 487,442.00   | 3.24         |
| 16 | 601908 | 京运通   | 47,100 | 484,659.00   | 3.22         |
| 17 | 300192 | 科德教育  | 30,100 | 452,403.00   | 3.01         |
| 18 | 002930 | 宏川智慧  | 22,290 | 434,877.90   | 2.89         |
| 19 | 002074 | 国轩高科  | 9,020  | 352,862.40   | 2.35         |
| 20 | 002434 | 万里扬   | 38,500 | 343,420.00   | 2.28         |
| 21 | 603658 | 安图生物  | 1,300  | 188,734.00   | 1.26         |
| 22 | 600588 | 用友网络  | 3,400  | 149,158.00   | 0.99         |
| 23 | 300463 | 迈克生物  | 2,000  | 93,200.00    | 0.62         |
| 24 | 603259 | 药明康德  | 600    | 80,832.00    | 0.54         |
| 25 | 002821 | 凯莱英   | 200    | 59,828.00    | 0.40         |



|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 26 | 300558 | 贝达药业 | 500   | 53,685.00 | 0.36 |
| 27 | 300633 | 开立医疗 | 2,000 | 51,720.00 | 0.34 |
| 28 | 002415 | 海康威视 | 1,000 | 48,510.00 | 0.32 |
| 29 | 300832 | 新产业  | 200   | 26,412.00 | 0.18 |
| 30 | 300294 | 博雅生物 | 700   | 23,478.00 | 0.16 |
| 31 | 000403 | 双林生物 | 590   | 22,420.00 | 0.15 |
| 32 | 300003 | 乐普医疗 | 800   | 21,744.00 | 0.14 |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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  | 000547 | 航天发展   | 4,746,239.00 | 8.40            |
| 2  | 002850 | 科达利    | 3,627,887.00 | 6.42            |
| 3  | 002174 | 游族网络   | 3,237,145.02 | 5.73            |
| 4  | 300418 | 昆仑万维   | 2,913,085.00 | 5.15            |
| 5  | 002555 | 三七互娱   | 2,884,930.12 | 5.10            |
| 6  | 002624 | 完美世界   | 2,869,583.88 | 5.08            |
| 7  | 688388 | 嘉元科技   | 2,844,517.00 | 5.03            |
| 8  | 300274 | 阳光电源   | 2,207,411.00 | 3.91            |
| 9  | 600580 | 卧龙电驱   | 1,995,559.00 | 3.53            |
| 10 | 000725 | 京东方 A  | 1,948,419.00 | 3.45            |
| 11 | 600066 | 宇通客车   | 1,915,468.16 | 3.39            |
| 12 | 300031 | 宝通科技   | 1,864,657.00 | 3.30            |
| 13 | 300769 | 德方纳米   | 1,853,036.69 | 3.28            |
| 14 | 300750 | 宁德时代   | 1,807,868.00 | 3.20            |
| 15 | 002602 | 世纪华通   | 1,799,559.00 | 3.18            |
| 16 | 688111 | 金山办公   | 1,663,070.36 | 2.94            |
| 17 | 603444 | 吉比特    | 1,659,187.00 | 2.94            |
| 18 | 300132 | 青松股份   | 1,598,845.00 | 2.83            |
| 19 | 603659 | 璞泰来    | 1,594,443.00 | 2.82            |
| 20 | 300463 | 迈克生物   | 1,589,290.00 | 2.81            |
| 21 | 300192 | 科德教育   | 1,498,799.00 | 2.65            |
| 22 | 300413 | 芒果超媒   | 1,491,390.80 | 2.64            |
| 23 | 000100 | TCL 科技 | 1,199,400.00 | 2.12            |

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 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。

### 8.4.2 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  | 688111 | 金山办公   | 6,026,994.40 | 10.66          |
| 2  | 000547 | 航天发展   | 5,952,444.78 | 10.53          |
| 3  | 300274 | 阳光电源   | 5,586,851.05 | 9.88           |
| 4  | 000938 | 紫光股份   | 4,190,601.93 | 7.41           |
| 5  | 002353 | 杰瑞股份   | 3,983,135.89 | 7.05           |
| 6  | 002850 | 科达利    | 3,759,903.31 | 6.65           |
| 7  | 002415 | 海康威视   | 3,689,137.49 | 6.53           |
| 8  | 601633 | 长城汽车   | 3,371,561.67 | 5.97           |
| 9  | 600498 | 烽火通信   | 3,235,076.92 | 5.72           |
| 10 | 002475 | 立讯精密   | 3,079,230.72 | 5.45           |
| 11 | 000063 | 中兴通讯   | 3,060,269.02 | 5.41           |
| 12 | 000100 | TCL 科技 | 2,983,993.32 | 5.28           |
| 13 | 000725 | 京东方 A  | 2,760,859.44 | 4.88           |
| 14 | 002332 | 仙琚制药   | 2,730,160.70 | 4.83           |
| 15 | 000988 | 华工科技   | 2,654,684.10 | 4.70           |
| 16 | 300136 | 信维通信   | 2,596,215.95 | 4.59           |
| 17 | 300463 | 迈克生物   | 2,558,601.52 | 4.53           |
| 18 | 002174 | 游族网络   | 2,480,876.52 | 4.39           |
| 19 | 603160 | 汇顶科技   | 2,282,727.00 | 4.04           |
| 20 | 300418 | 昆仑万维   | 2,216,626.94 | 3.92           |
| 21 | 002555 | 三七互娱   | 2,186,033.89 | 3.87           |
| 22 | 002624 | 完美世界   | 2,087,641.42 | 3.69           |
| 23 | 688388 | 嘉元科技   | 1,913,333.06 | 3.39           |
| 24 | 600580 | 卧龙电驱   | 1,890,754.22 | 3.35           |
| 25 | 300769 | 德方纳米   | 1,821,373.99 | 3.22           |
| 26 | 300413 | 芒果超媒   | 1,793,724.84 | 3.17           |
| 27 | 002518 | 科士达    | 1,739,014.36 | 3.08           |
| 28 | 300750 | 宁德时代   | 1,717,415.48 | 3.04           |
| 29 | 603659 | 璞泰来    | 1,709,980.00 | 3.03           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 30 | 300132 | 青松股份 | 1,504,041.00 | 2.66 |
| 31 | 002602 | 世纪华通 | 1,441,158.00 | 2.55 |
| 32 | 600703 | 三安光电 | 1,415,861.66 | 2.51 |
| 33 | 603444 | 吉比特  | 1,404,362.28 | 2.48 |
| 34 | 600131 | 国网信通 | 1,401,970.76 | 2.48 |
| 35 | 000403 | 双林生物 | 1,228,512.52 | 2.17 |
| 36 | 300192 | 科德教育 | 1,197,947.00 | 2.12 |
| 37 | 300031 | 宝通科技 | 1,186,634.00 | 2.10 |

### 8.4.3 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 | 66,421,270.12  |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 112,744,653.57 |

### 8.5 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） | 36,300.00 | 0.24         |
| 8  | 同业存单      | -         | -            |
| 9  | 其他        | -         | -            |
| 10 | 合计        | 36,300.00 | 0.24         |

### 8.6 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  | 128142 | 新乳转债 | 363   | 36,300.00 | 0.24         |

### 8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本期无股指期货投资。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期本基金未投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 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。

#### 8.12.2 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

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

#### 8.12.3 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   | 5,367.36     |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,483,942.05 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 166.42       |
| 5  | 应收申购款   | 56,888.73    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,546,364.56 |

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 1,997        | 5,669.25      | 177,869.56 | 1.57%      | 11,143,617.27 | 98.43%     |

### 9.2 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<br>持有本基金 | 373,482.85 | 3.3000%  |

### 9.3 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<br>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                 |

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2018年1月25日）基金份额总额 | 252,921,526.43 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 61,348,910.07  |
| 本报告期基金总申购份额               | 23,493,510.63  |
| 减:本报告期基金总赎回份额             | 73,520,933.87  |
| 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              | 11,321,486.83  |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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 2020 年公司高级管理人员任免情况具体如下：2020 年 4 月 28 日，傅军先生离任公司副总经理、首席信息官职务，李峰先生担任公司首席信息官职务；2020 年 5 月 18 日，于建伟先生担任公司总经理职务，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；2020 年 6 月 22 日起，林峰先生担任公司副总经理职务。以上事项均于发布公告。

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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内为基金进行审计的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，审计费用 40,000.00 元。

### 11.6 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，基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

报告期内，公司收到中国证券监督管理委员会广东监管局对我司采取责令改正措施的决定，对公司提出整改要求。公司已及时完成了整改。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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 |    |
| 太平洋证券 | 1      | 93,914,699.25 | 52.45%       | 68,680.16 | 50.36%     | -  |

|      |   |               |        |           |        |   |
|------|---|---------------|--------|-----------|--------|---|
| 银河证券 | 2 | 27,990,516.65 | 15.63% | 25,954.51 | 19.03% | - |
| 国盛证券 | 2 | 23,552,459.06 | 13.15% | 17,216.01 | 12.62% | - |
| 国金证券 | 2 | 10,963,771.78 | 6.12%  | 8,017.75  | 5.88%  | - |
| 天风证券 | 2 | 8,224,314.27  | 4.59%  | 5,991.04  | 4.39%  | - |
| 恒泰证券 | 2 | 7,809,068.52  | 4.36%  | 5,710.76  | 4.19%  | - |
| 申万宏源 | 2 | 4,235,523.98  | 2.37%  | 3,097.53  | 2.27%  | - |
| 安信证券 | 1 | 1,221,497.74  | 0.68%  | 893.28    | 0.65%  | - |
| 广发证券 | 2 | 1,140,652.96  | 0.64%  | 827.75    | 0.61%  | - |
| 东莞证券 | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 国泰君安 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 万联证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 国融证券 | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 国信证券 | 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。

### 11.7.2 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<br>成交总额的比<br>例 | 成交金额         | 占当期债<br>券回购<br>成交总额<br>的比例 | 成交金额 | 占当期权证<br>成交总额的<br>比例 |
|-------|----------|----------------------|--------------|----------------------------|------|----------------------|
| 太平洋证券 | -        | -                    | -            | -                          | -    | -                    |
| 银河证券  | -        | -                    | -            | -                          | -    | -                    |
| 国盛证券  | -        | -                    | 5,200,000.00 | 25.87%                     | -    | -                    |
| 国金证券  | -        | -                    | 9,400,000.00 | 46.77%                     | -    | -                    |
| 天风证券  | -        | -                    | -            | -                          | -    | -                    |
| 恒泰证券  | 1,258.50 | 100.00%              | -            | -                          | -    | -                    |
| 申万宏源  | -        | -                    | -            | -                          | -    | -                    |
| 安信证券  | -        | -                    | 4,400,000.00 | 21.89%                     | -    | -                    |
| 广发证券  | -        | -                    | 1,100,000.00 | 5.47%                      | -    | -                    |
| 东莞证券  | -        | -                    | -            | -                          | -    | -                    |
| 国泰君安  | -        | -                    | -            | -                          | -    | -                    |
| 万联证券  | -        | -                    | -            | -                          | -    | -                    |
| 国融证券  | -        | -                    | -            | -                          | -    | -                    |
| 国信证券  | -        | -                    | -            | -                          | -    | -                    |

### 11.8 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  | 中科沃土其他重大事项公告                 | 公司网站、证券时报 | 2020年2月3日  |
| 2  | 中科沃土其他重大事项公告                 | 公司网站、证券时报 | 2020年2月17日 |
| 3  | 中科沃土其他重大事项公告                 | 公司网站、证券时报 | 2020年3月25日 |
| 4  | 中科沃土其他重大事项公告                 | 公司网站、证券时报 | 2020年3月30日 |
| 5  | 中科沃土基金营销活动相关公告               | 公司网站、证券时报 | 2020年4月9日  |
| 6  | 中科沃土基金关于旗下基金在泰诚财富基金销售（大连）有限公 | 公司网站、证券时报 | 2020年6月6日  |

|    |   |           |                 |
|----|---|-----------|-----------------|
|    | 司暂停办理相关销售业务的公告                              |           |                 |
| 7  | 中科沃土基金管理有限公司关于旗下基金参加银河证券申购费率优惠活动的公告         | 公司网站、证券时报 | 2020 年 6 月 8 日  |
| 8  | 中科沃土基金管理有限公司关于公司股东名称及住所变更的公告                | 公司网站、证券时报 | 2020 年 7 月 17 日 |
| 9  | 中科沃土基金管理有限公司关于新增恒泰证券为旗下部分基金销售机构的公告          | 公司网站、证券时报 | 2020 年 9 月 3 日  |
| 10 | 中科沃土基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告                    | 公司网站、证券时报 | 2020 年 9 月 15 日 |
| 11 | 中科沃土基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 公司网站、证券时报 | 2020 年 11 月 2 日 |
| 12 | 中科沃土基金管理有限公司关于新增招商证券为旗下部分基金销售机构的公告          | 公司网站、证券时报 | 2020 年 12 月 1 日 |

## 备查文件目录

### 11.9 备查文件目录

1. 中国证监会准予中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
2. 《中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《中科沃土转型升级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. 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转型升级灵活配置混合型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。

### **11.10 存放地点**

基金管理人、基金托管人处。

### **11.11 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 3 月 30 日