

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 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：中科沃土基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

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

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	59
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	59
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.....	59
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.....	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	60
§8 基金份额持有人信息.....	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	62
§9 开放式基金份额变动.....	63
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	68

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	68
§12 备查文件目录.....	69
12.1 备查文件目录.....	69
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

§ 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	177,746,087.44 份	
下属分级基金的基金简称:	中科沃土沃鑫成长混合发起 A	中科沃土沃鑫成长混合发起 C
下属分级基金的交易代码:	003125	009747
报告期末下属分级基金的份额总额	38,585,758.94 份	139,160,328.50 份

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。	
	中科沃土沃鑫成长混合发起 A	中科沃土沃鑫成长混合发起 C

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中科沃土基金管理有限公司	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	智会杰	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	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.richlandasm.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 21 楼

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	中科沃土沃鑫成长混合发起 A	中科沃土沃鑫成长混合发起 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	13,218,177.17	17,729,044.71
本期利润	4,566,626.04	11,863,751.52
加权平均基金份额本期利润	0.0638	0.1046
本期加权平均净值利润率	4.85%	7.99%
本期基金份额净值增长率	6.73%	6.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	14,125,890.75	50,330,601.52
期末可供分配基金份额利润	0.3661	0.3617
期末基金资产净值	53,048,333.17	190,573,464.13
期末基金份额净值	1.3748	1.3695
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	37.48%	32.38%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中科沃土沃鑫成长混合发起 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.41%	0.54%	-1.03%	0.40%	2.44%	0.14%
过去三个月	7.87%	0.68%	1.96%	0.49%	5.91%	0.19%
过去六个月	6.73%	0.90%	0.45%	0.66%	6.28%	0.24%
过去一年	32.49%	0.90%	12.63%	0.66%	19.86%	0.24%

过去三年	53.95%	1.08%	22.80%	0.67%	31.15%	0.41%
自基金合同生效起至今	37.48%	1.02%	27.78%	0.59%	9.70%	0.43%

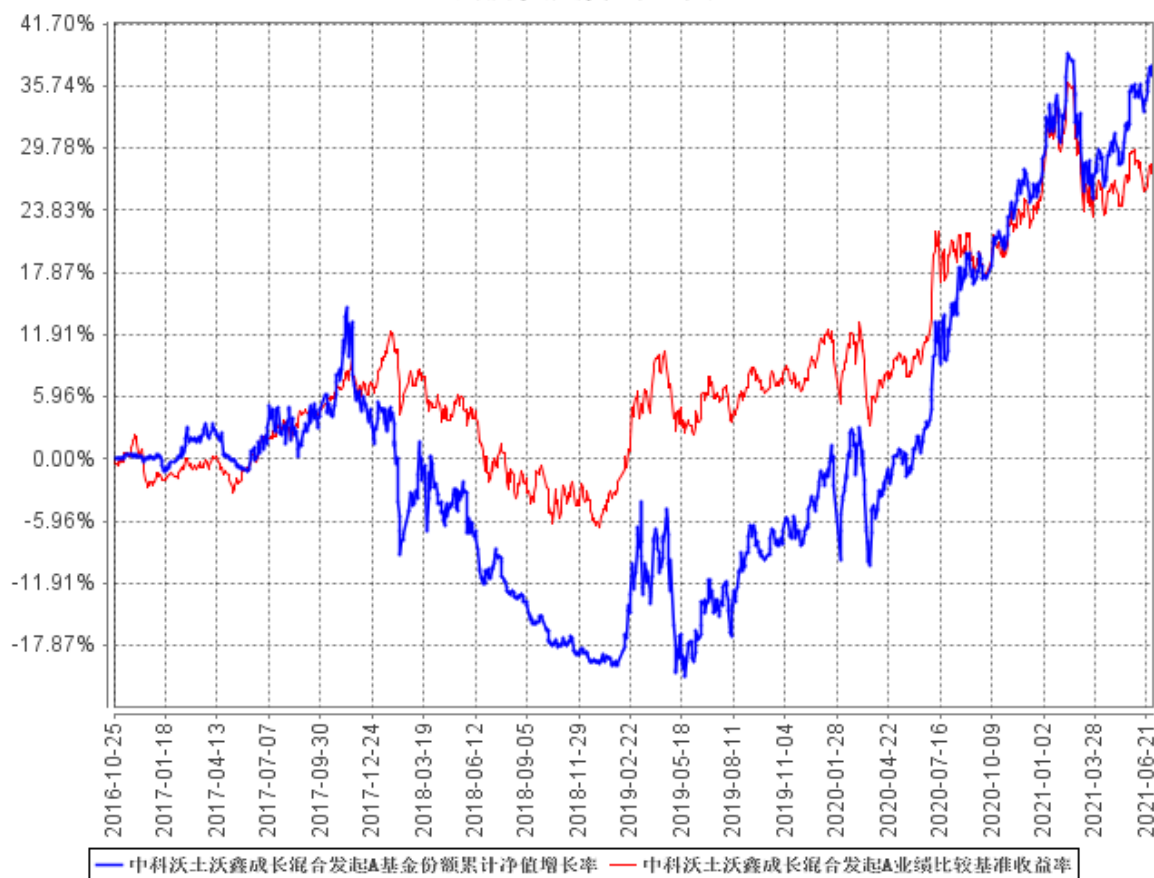
中科沃土沃鑫成长混合发起 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.41%	0.54%	-1.03%	0.40%	2.44%	0.14%
过去三个月	7.77%	0.67%	1.96%	0.49%	5.81%	0.18%
过去六个月	6.46%	0.90%	0.45%	0.66%	6.01%	0.24%
过去一年	31.97%	0.90%	12.63%	0.66%	19.34%	0.24%
自基金合同生效起至今	32.38%	0.90%	13.08%	0.66%	19.30%	0.24%

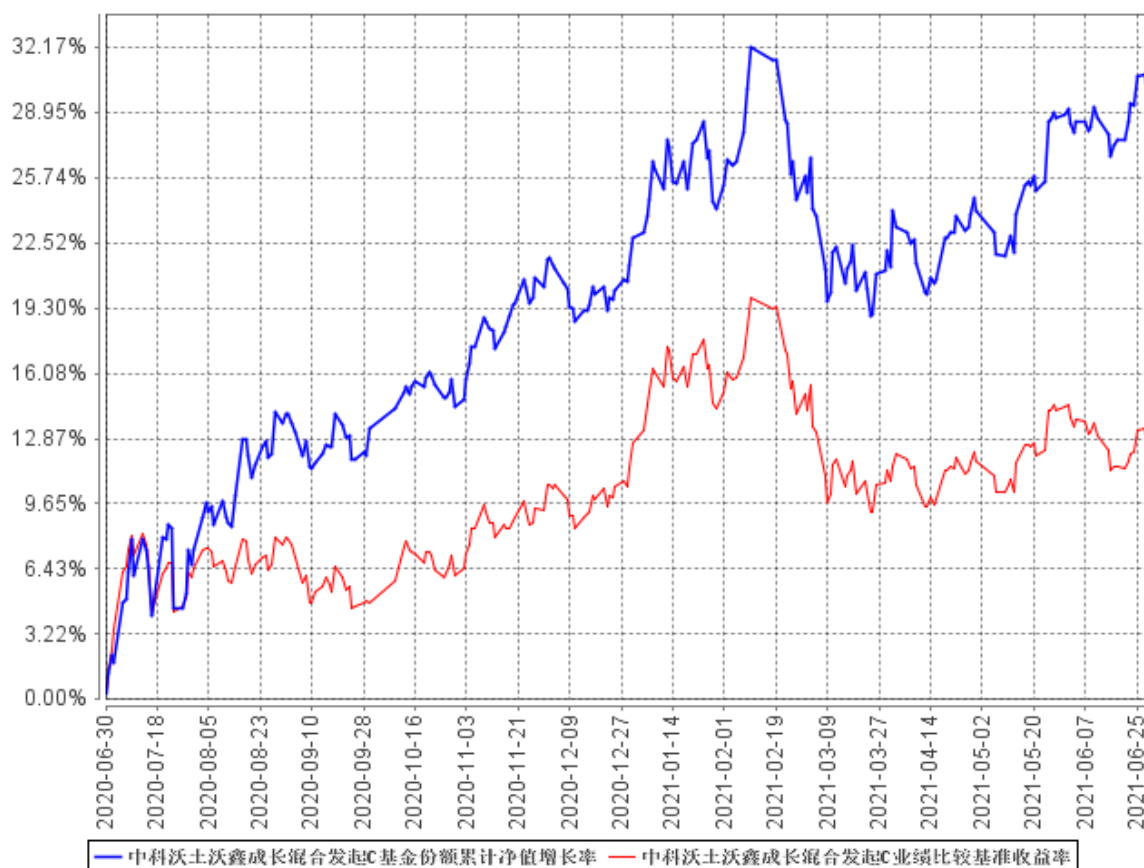
注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

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



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



注：本基金合同于 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 2.42 亿元，是国内第 100 家公募基金管理公司，也是一家拥有 PE 背景的公募基金管理公司。中科沃土带着中科招商、粤科金融等主要股东强大的精神基因和优秀的文化基因，始终贯彻“持有人利益至上”的首要经营准则，遵循诚信、规范、稳健的经营方针，崇尚价值投资理念和长期、平稳、盈利的投资风格，致力于为持有人提供专业、精品、创新的投资理财服务，创造成长价值，汇聚阳光财富。截至 2021 年 6 月 30 日，中科沃土旗下共管理 7 只开放式基金：中科沃土货币市场基金、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金、中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金和中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐伟	基金经理	2019 年 8 月 9 日	-	10 年	工学硕士，曾任宏源证券研究所分析师，中信建投证券研究发展部首席分析师，上海磐信投资有限公司金融市场部高级研究员，中科沃土基金管理有限公司研究部资深研究员，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。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，徐伟的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期内，不存在本基金的基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及

基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，虽然受到境外流入变异毒株的影响，在短暂的时期内国内局部地区疫情有所反复，但很快得到了及时控制，并未对国内生产生活带来重大影响，国内宏观经济仍然保持平稳运行。随着新冠疫苗的推广应用，海外疫情经历高峰之后开始平稳回落，助力全球各主要经济体的经济复苏，出口仍呈现较好的增长态势，拉动二季度 GDP 平稳增长。虽然上半年大宗商品价格出现了较大幅度的上涨，但随着 5 月份国务院常务会议提出做好大宗商品供应的保供稳价，PPI 上行的压力也开始缓解。

在 2021 年上半年的操作中，我们在投资组合中保持了较高的股票仓位水平，配置更为均衡，估值更为合理，组合稳定性也有了提高，取得了较为理想的收益。我们中长期仍然相对看好权益市场的表现，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

截至本报告期末中科沃土沃鑫成长混合发起 A 基金份额净值为 1.3748 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.73%；截至本报告期末中科沃土沃鑫成长混合发起 C 基金份额净值为 1.3695 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.46%；同期业绩比较基准收益率为 0.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然进入 2021 年下半年，新冠肺炎疫情的局部反复、河南暴雨等事件对宏观经济还有短暂的

冲击，但国内财政政策的逆周期调节空间较大，经济韧性较强，预计国内宏观经济将维持复苏进程。在信贷政策上，继续严格执行“房住不炒”，房地产信贷调控政策再次升级，从而加强对实体经济发展的支持，坚定中国经济转型升级的决心。而在海外，虽然货币政策与财政政策进一步操作的空间在变小，但仍然保持了宽松状态。在中国整体长期潜在经济增长率下行的背景下，结合我们对 2021 年下半年国内 CPI 上行压力较小、PPI 上行幅度逐步缓解的判断，预计国内长期利率趋势依然处于下行阶段，货币政策环境仍将保持适当宽松。从大类资产配置上考虑国内的资金大概率向权益类资产倾斜，判断国内资本市场的资金面仍然处于较宽松的环境。

同时国家稳步推进金融改革，大幅提高了对股票欺诈发行、信息披露造假等金融证券犯罪的处罚力度，还开始逐步明确中介机构的责任，为资本市场的健康发展创造了良好的法律环境，新《证券法》的修订，再融资新政的颁布，以及创业板注册制的实施，使得资本市场支持实体经济的融资功能得以完善。资本市场在未来中国经济转型升级中将承担更为重要的角色，并将继续获得政策层面的大力支持。

我们 2021 年下半年认为股票市场整体下跌空间有限，将继续保持较高的股票仓位，精选优质公司，分享公司的业绩增长仍然是我们组合的核心策略。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。

4.6 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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金无相关情况的预警说明。

§ 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。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中科沃土基金管理有限公司编制和披露的中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	12,458,094.90	17,297,531.58
结算备付金		54,018,263.13	24,529,195.94
存出保证金		54,701.69	78,414.02
交易性金融资产	6.4.7.2	204,231,585.27	294,494,343.76
其中：股票投资		171,315,590.27	174,078,374.96
基金投资		-	-
债券投资		32,915,995.00	120,415,968.80
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	-	-
应收证券清算款		691,284.98	3,360,929.18
应收利息	6.4.7.5	719,507.54	2,333,078.45
应收股利		-	-
应收申购款		1,349.04	206.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		272,174,786.55	342,093,699.55
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		22,000,000.00	23,000,000.00
应付证券清算款		4,741,362.51	-
应付赎回款		1,125,925.95	9,748,038.30
应付管理人报酬		305,327.06	420,600.50
应付托管费		50,887.83	70,100.04
应付销售服务费		32,112.04	25,640.52
应付交易费用	6.4.7.7	163,044.79	143,028.31
应交税费		-	-

应付利息		-	-8,630.14
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	134,329.07	220,000.25
负债合计		28,552,989.25	33,618,777.78
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	177,746,087.44	239,612,025.01
未分配利润	6.4.7.10	65,875,709.86	68,862,896.76
所有者权益合计		243,621,797.30	308,474,921.77
负债和所有者权益总计		272,174,786.55	342,093,699.55

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 177,746,087.44 份，其中 A 类基金份额净值 1.3748 元，A 类基金份额总额 38,585,758.94 份；C 类基金份额净值 1.3695 元，C 类基金份额总额 139,160,328.50 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		19,616,838.98	8,073,993.36
1.利息收入		525,505.55	239,367.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	130,949.27	96,020.39
债券利息收入		394,556.28	105,495.11
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	37,852.37
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		33,440,664.61	9,139,363.19
其中：股票投资收益	6.4.7.12	32,465,407.13	8,376,369.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13.1	-176,439.67	73,926.02
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,151,697.15	689,067.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-14,516,844.32	-1,370,769.08
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	167,513.14	66,031.38
减：二、费用		3,186,461.42	1,403,819.60
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,803,410.27	767,490.29
2. 托管费	6.4.10.2.2	300,568.41	127,915.03
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	146,042.65	-
4. 交易费用	6.4.7.19	657,299.95	370,625.16
5. 利息支出		189,770.68	55,518.53
其中：卖出回购金融资产支出		189,770.68	55,518.53
6. 税金及附加		-	7.02
7. 其他费用	6.4.7.20	89,369.46	82,263.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,430,377.56	6,670,173.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,430,377.56	6,670,173.76

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	239,612,025.01	68,862,896.76	308,474,921.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,430,377.56	16,430,377.56
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）	-61,865,937.57	-19,417,564.46	-81,283,502.03
其中：1.基金申购款	191,271,723.93	58,002,453.36	249,274,177.29
2.基金赎回款	-253,137,661.50	-77,420,017.82	-330,557,679.32
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）	177,746,087.44	65,875,709.86	243,621,797.30
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	110,374,506.27	-2,525,801.13	107,848,705.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,670,173.76	6,670,173.76
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）	16,108,237.90	628,844.19	16,737,082.09
其中：1.基金申购款	55,939,582.71	492,212.92	56,431,795.63
2.基金赎回款	-39,831,344.81	136,631.27	-39,694,713.54
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）	126,482,744.17	4,773,216.82	131,255,960.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 智会杰 _____	_____ 智会杰 _____	_____ 李峰 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于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批复》（证监许可〔2016〕1561号），由基金发起人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》、《证券投资基金运作管理办法》等

有关规定和《中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	12,458,094.90
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：	12,458,094.90

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	162,376,842.63	171,315,590.27	8,938,747.64
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	32,919,056.16	32,915,995.00
	银行间市场	-	-
	合计	32,919,056.16	32,915,995.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	195,195,898.79	204,231,585.27	9,035,686.48

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,313.49
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	40,475.43
应收债券利息	677,694.02
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	24.60
合计	719,507.54

6.4.7.6 其他资产

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 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	163,044.79
银行间市场应付交易费用	-
合计	163,044.79

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	26.51
应付证券出借违约金	-

预提费用	134,302.56
-	-
合计	134,329.07

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中科沃土沃鑫成长混合发起 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	136,869,684.60	136,869,684.60
本期申购	236,080.27	236,080.27
本期赎回(以“-”号填列)	-98,520,005.93	-98,520,005.93
- 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	38,585,758.94	38,585,758.94

金额单位：人民币元

中科沃土沃鑫成长混合发起 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	102,742,340.41	102,742,340.41
本期申购	191,035,643.66	191,035,643.66
本期赎回(以“-”号填列)	-154,617,655.57	-154,617,655.57
- 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	139,160,328.50	139,160,328.50

注：本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中科沃土沃鑫成长混合发起 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	27,554,341.65	11,884,333.85	39,438,675.50

本期利润	13,218,177.17	-8,651,551.13	4,566,626.04
本期基金份额交易产生的变动数	-26,646,628.07	-2,896,099.24	-29,542,727.31
其中：基金申购款	63,397.07	14,144.54	77,541.61
基金赎回款	-26,710,025.14	-2,910,243.78	-29,620,268.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,125,890.75	336,683.48	14,462,574.23

单位：人民币元

中科沃土沃鑫成长混合发起 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,630,156.82	8,794,064.44	29,424,221.26
本期利润	17,729,044.71	-5,865,293.19	11,863,751.52
本期基金份额交易产生的变动数	11,971,399.99	-1,846,237.14	10,125,162.85
其中：基金申购款	56,662,598.51	1,262,313.24	57,924,911.75
基金赎回款	-44,691,198.52	-3,108,550.38	-47,799,748.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,330,601.52	1,082,534.11	51,413,135.63

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	26,822.59
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	103,713.98
其他	412.70
合计	130,949.27

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	250,455,914.74
减：卖出股票成本总额	217,990,507.61

买卖股票差价收入	32,465,407.13
----------	---------------

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	89,519,623.78
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	87,726,446.35
减：应收利息总额	1,969,617.10
买卖债券差价收入	-176,439.67

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

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

本基金本报告期内无投资衍生工具。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,151,697.15
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,151,697.15

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
------	----------------------------

1. 交易性金融资产	-14,516,844.32
——股票投资	-14,743,316.87
——债券投资	226,472.55
——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	-14,516,844.32

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	167,513.14
合计	167,513.14

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	657,299.95
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	657,299.95

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	24,795.19

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	5,066.90
其他	-
合计	89,369.46

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（“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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未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

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无需支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,803,410.27	767,490.29
其中：支付销售机构的客户维护费	309,124.32	107,162.76

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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	300,568.41	127,915.03

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃鑫成长混合发起 A	中科沃土沃鑫成长混合发起 C	合计
中科沃土基金	-	90,439.60	90,439.60
合计	-	90,439.60	90,439.60
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃鑫成长混合发起 A	中科沃土沃鑫成长混合发起 C	合计
中科沃土基金	-	-	-
合计	-	-	-

注：(1) C 类基金份额生效日为 2020 年 6 月 29 日，无上年度可比期间。

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

日销售服务费 = 前一日 C 类的基金资产净值 X 0.20% / 当年天数

6.4.10.3 本基金 C 类份额成立日为 2020 年 6 月 29 日。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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金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。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中科沃土沃鑫成长混合发起 A				
关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	1.6700%	2,976,293.76	1.24%
广东中广投资 管理有限公司	-	-	197,642.23	0.08%

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。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股 份有限公司	12,458,094.90	26,822.59	14,808,382.62	23,479.45

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
688226	威腾	2021 年	2021	新股	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-

	电气	6月28日	年7月7日	未上市						
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
600905	三峡能源	2021年6月2日	2021年12月10日	主板锁定	2.65	5.67	726,210	1,924,456.50	4,117,610.70	-
688425	铁建重工	2021年6月11日	2021年12月22日	科创板锁定	2.87	4.75	33,047	94,844.89	156,973.25	-
688687	凯因科技	2021年1月29日	2021年8月9日	科创板锁定	18.98	27.98	5,240	99,455.20	146,615.20	-
688345	博力威	2021年6月3日	2021年12月13日	科创板锁定	25.91	55.53	2,332	60,422.12	129,495.96	-
688700	东威科技	2021年6月7日	2021年12月15日	科创板锁定	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.54	-
688667	菱电电控	2021年3月3日	2021年9月13日	科创板锁定	75.42	103.88	914	68,933.88	94,946.32	-
688191	智洋创新	2021年3月30日	2021年10月8日	科创板锁定	11.38	17.74	3,203	36,450.14	56,821.22	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	创业板锁定	47.33	251.96	213	10,081.29	53,667.48	-
688260	昀冢科技	2021年3月25日	2021年10月8日	科创板锁定	9.63	16.41	2,990	28,793.70	49,065.90	-
300973	立高	2021年	2021	创业	28.28	115.71	270	7,635.60	31,241.70	-

	食品	4月8日	年10月15日	板锁定						
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	创业板锁定	33.22	87.50	287	9,534.14	25,112.50	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	创业板锁定	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	创业板锁定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	创业板锁定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	创业板锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	创业板锁定	48.59	90.39	193	9,377.87	17,445.27	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	创业板锁定	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	创业板锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	创业板锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	创业板锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川	2021年	2021	创业	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-

	畅银	5月18日	年11月25日	板锁定						
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	创业板锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	C利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	创业板锁定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	创业板锁定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	创业板锁定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	创业板锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	创业板锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	创业板锁定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	创业板锁定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	创业板锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	创业板锁定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔	2021年	2021	创业	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-

	伟	6月23日	2021年12月30日	创业板锁定						
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	创业板锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	创业板锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	创业板锁定	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	创业板锁定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	创业板锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德国特	2021年2月24日	2021年9月3日	创业板锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	创业板锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	创业板锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	创业板锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	创业板锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊	2021年	2021	创业	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-

	科技	1月7日	年7月7日	板锁定						
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	创业板锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	创业板锁定	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	创业板锁定	24.90	24.81	280	6,972.00	6,946.80	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	创业板锁定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	创业板锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2021年1月7日	2021年7月7日	创业板锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	创业板锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	创业板锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	创业板锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	创业板锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣	2021年	2021	创业	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-

	股份	4月2日	年10月13日	板锁定						
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	创业板锁定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月20日	创业板锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	创业板锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	创业板锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	创业板锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	创业板锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	创业板锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	创业板锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	创业板锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

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

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021年6月16日	临时停牌	5.59	2021年7月6日	6.15	34,675	282,370.87	193,833.25	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金未从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 22,000,000.00 元，截至 2021 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资部门负责人和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、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 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2020 年 12 月 31 日:0.0003%)。

6.4.13.3 流动性风险

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

资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 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	12,458,094.90	-	-	-	12,458,094.90
结算备付金	54,018,263.13	-	-	-	54,018,263.13
存出保证金	54,701.69	-	-	-	54,701.69
交易性金融 资产	32,855,185.00	60,810.00	-	171,315,590.27	204,231,585.27
应收证券清 算款	-	-	-	691,284.98	691,284.98
应收利息	-	-	-	719,507.54	719,507.54
应收申购款	-	-	-	1,349.04	1,349.04
资产总计	99,386,244.72	60,810.00	-	172,727,731.83	272,174,786.55
负债					
卖出回购金 融资产款	22,000,000.00	-	-	-	22,000,000.00
应付证券清 算款	-	-	-	4,741,362.51	4,741,362.51
应付赎回款	-	-	-	1,125,925.95	1,125,925.95

应付管理人 报酬	-	-	-	305,327.06	305,327.06
应付托管费	-	-	-	50,887.83	50,887.83
应付销售服 务费	-	-	-	32,112.04	32,112.04
应付交易费 用	-	-	-	163,044.79	163,044.79
其他负债	-	-	-	134,329.07	134,329.07
负债总计	22,000,000.00	-	-	6,552,989.25	28,552,989.25
利率敏感度 缺口	77,386,244.72	60,810.00	-	166,174,742.58	243,621,797.30
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	17,297,531.58	-	-	-	17,297,531.58
结算备付金	24,529,195.94	-	-	-	24,529,195.94
存出保证金	78,414.02	-	-	-	78,414.02
交易性金融 资产	120,343,906.50	72,062.30	-	174,078,374.96	294,494,343.76
应收证券清 算款	-	-	-	3,360,929.18	3,360,929.18
应收利息	-	-	-	2,333,078.45	2,333,078.45
应收申购款	-	-	-	206.62	206.62
资产总计	162,249,048.04	72,062.30	-	179,772,589.21	342,093,699.55
负债					
卖出回购金 融资产款	23,000,000.00	-	-	-	23,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	9,748,038.30	9,748,038.30
应付管理人 报酬	-	-	-	420,600.50	420,600.50
应付托管费	-	-	-	70,100.04	70,100.04
应付销售服 务费	-	-	-	25,640.52	25,640.52
应付交易费 用	-	-	-	143,028.31	143,028.31
应付利息	-	-	-	-8,630.14	-8,630.14
其他负债	-	-	-	220,000.25	220,000.25
负债总计	23,000,000.00	-	-	10,618,777.78	33,618,777.78
利率敏感度 缺口	139,249,048.04	72,062.30	-	169,153,811.43	308,474,921.77

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 其他变量不变，只有利率变动通过债券公允价值变动对基金资产净值产生影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1. 利率上升 25 个基点	-3,881.07	19,164.79
	2. 利率下降 25 个基点	3,881.07	-19,094.76

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	171,315,590.27	70.32	174,078,374.96	56.43
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	32,915,995.00	13.51	-	-
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	204,231,585.27	83.83	174,078,374.96	56.43
----	----------------	-------	----------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	业绩比较基准变动+5%	4,523,736.32	9,897,397.23
	业绩比较基准变动-5%	-4,523,736.32	-9,897,397.23

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 171,315,590.27 元，属于第二层次的余额为 32,915,995.00 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 168,426,750.43 元，第二层次 126,067,593.33 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 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	171,315,590.27	62.94
	其中：股票	171,315,590.27	62.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	32,915,995.00	12.09
	其中：债券	32,915,995.00	12.09
	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	66,476,358.03	24.42
8	其他各项资产	1,466,843.25	0.54
9	合计	272,174,786.55	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,881,082.02	0.77
B	采矿业	4,032,631.38	1.66
C	制造业	93,283,473.35	38.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,029,450.28	2.89
E	建筑业	1,980,429.44	0.81
F	批发和零售业	1,346,593.14	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	4,117,174.51	1.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,267,141.78	2.16
J	金融业	39,087,014.67	16.04
K	房地产业	3,451,961.97	1.42
L	租赁和商务服务业	3,150,424.72	1.29
M	科学研究和技术服务业	2,222,208.33	0.91

N	水利、环境和公共设施管理业	52,626.32	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	348,069.18	0.14
Q	卫生和社会工作	3,386,095.40	1.39
R	文化、体育和娱乐业	679,213.78	0.28
S	综合	-	-
	合计	171,315,590.27	70.32

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,923	10,125,134.10	4.16
2	601318	中国平安	86,973	5,590,624.44	2.29
3	600036	招商银行	96,165	5,211,181.35	2.14
4	000858	五粮液	15,962	4,754,920.18	1.95
5	600905	三峡能源	726,442	4,119,086.22	1.69
6	601012	隆基股份	33,387	2,966,101.08	1.22
7	000001	平安银行	124,910	2,825,464.20	1.16
8	000333	美的集团	38,402	2,740,750.74	1.13
9	601166	兴业银行	117,390	2,412,364.50	0.99
10	601888	中国中免	7,921	2,377,092.10	0.98
11	600276	恒瑞医药	34,668	2,356,383.96	0.97
12	002415	海康威视	36,284	2,340,318.00	0.96
13	002142	宁波银行	59,772	2,329,314.84	0.96
14	300059	东方财富	63,053	2,067,507.87	0.85
15	000651	格力电器	39,473	2,056,543.30	0.84
16	603259	药明康德	12,987	2,033,634.33	0.83
17	600900	长江电力	87,178	1,799,353.92	0.74
18	600887	伊利股份	47,023	1,731,857.09	0.71
19	002594	比亚迪	6,475	1,625,225.00	0.67
20	600030	中信证券	64,151	1,599,925.94	0.66
21	002475	立讯精密	34,033	1,565,518.00	0.64
22	000725	京东方A	244,687	1,526,846.88	0.63
23	000568	泸州老窖	6,264	1,477,928.16	0.61

24	300015	爱尔眼科	20,307	1,441,390.86	0.59
25	002714	牧原股份	22,596	1,374,288.72	0.56
26	600309	万华化学	12,621	1,373,417.22	0.56
27	603501	韦尔股份	4,230	1,362,060.00	0.56
28	600031	三一重工	44,731	1,300,330.17	0.53
29	000002	万科A	53,427	1,272,096.87	0.52
30	300122	智飞生物	6,724	1,255,572.52	0.52
31	603288	海天味业	9,722	1,253,651.90	0.51
32	600438	通威股份	28,052	1,213,810.04	0.50
33	601919	中远海控	39,543	1,207,643.22	0.50
34	600809	山西汾酒	2,633	1,179,584.00	0.48
35	601899	紫金矿业	115,971	1,123,758.99	0.46
36	601328	交通银行	207,638	1,017,426.20	0.42
37	002304	洋河股份	4,771	988,551.20	0.41
38	600436	片仔癀	2,156	966,534.80	0.40
39	300014	亿纬锂能	9,078	943,476.54	0.39
40	002352	顺丰控股	13,902	941,165.40	0.39
41	002812	恩捷股份	3,894	911,585.40	0.37
42	600000	浦发银行	89,487	894,870.00	0.37
43	000661	长春高新	2,227	861,849.00	0.35
44	600837	海通证券	74,868	860,982.00	0.35
45	600585	海螺水泥	20,811	854,291.55	0.35
46	300274	阳光电源	7,379	849,027.74	0.35
47	600690	海尔智家	31,076	805,179.16	0.33
48	603986	兆易创新	4,267	801,769.30	0.33
49	601601	中国太保	27,325	791,605.25	0.32
50	000100	TCL 科技	103,157	789,151.05	0.32
51	002230	科大讯飞	11,617	785,076.86	0.32
52	002460	赣锋锂业	6,392	774,007.28	0.32
53	300124	汇川技术	10,421	773,863.46	0.32
54	002027	分众传媒	82,182	773,332.62	0.32
55	000063	中兴通讯	22,910	761,299.30	0.31
56	603799	华友钴业	6,595	753,149.00	0.31
57	300142	沃森生物	12,170	750,889.00	0.31
58	601668	中国建筑	160,120	744,558.00	0.31
59	002271	东方雨虹	13,439	743,445.48	0.31
60	600016	民生银行	162,600	717,066.00	0.29
61	601288	农业银行	236,628	716,982.84	0.29
62	300347	泰格医药	3,677	710,764.10	0.29

63	600048	保利地产	57,238	689,145.52	0.28
64	002241	歌尔股份	16,030	685,122.20	0.28
65	600763	通策医疗	1,663	683,493.00	0.28
66	600919	江苏银行	96,000	681,600.00	0.28
67	600196	复星医药	9,007	649,674.91	0.27
68	000338	潍柴动力	35,708	638,101.96	0.26
69	688111	金山办公	1,600	631,680.00	0.26
70	600050	中国联通	144,578	624,576.96	0.26
71	601229	上海银行	76,000	623,200.00	0.26
72	601688	华泰证券	39,414	622,741.20	0.26
73	600660	福耀玻璃	10,323	576,539.55	0.24
74	600703	三安光电	17,818	571,066.90	0.23
75	601211	国泰君安	33,280	570,419.20	0.23
76	600570	恒生电子	6,067	565,747.75	0.23
77	600019	宝钢股份	73,751	563,457.64	0.23
78	601766	中国中车	90,593	550,805.44	0.23
79	002129	中环股份	14,007	540,670.20	0.22
80	300601	康泰生物	3,623	539,827.00	0.22
81	600999	招商证券	27,957	531,742.14	0.22
82	600104	上汽集团	23,891	524,885.27	0.22
83	002410	广联达	7,595	517,979.00	0.21
84	601088	中国神华	26,332	514,000.64	0.21
85	002311	海大集团	6,285	512,856.00	0.21
86	600406	国电南瑞	21,917	509,351.08	0.21
87	300498	温氏股份	34,336	493,408.32	0.20
88	601988	中国银行	156,203	481,105.24	0.20
89	601818	光大银行	126,492	478,139.76	0.20
90	300450	先导智能	7,935	477,210.90	0.20
91	600745	闻泰科技	4,845	469,480.50	0.19
92	002049	紫光国微	3,014	464,728.66	0.19
93	600028	中国石化	104,656	456,300.16	0.19
94	600346	恒力石化	16,984	445,660.16	0.18
95	000983	山西焦煤	53,507	444,643.17	0.18
96	002371	北方华创	1,587	440,202.06	0.18
97	600588	用友网络	13,150	437,369.00	0.18
98	000625	长安汽车	16,620	436,773.60	0.18
99	000538	云南白药	3,746	433,487.12	0.18
100	002493	荣盛石化	24,741	427,277.07	0.18
101	601628	中国人寿	12,240	414,813.60	0.17

102	600893	航发动力	7,534	400,733.46	0.16
103	601633	长城汽车	9,124	397,715.16	0.16
104	601390	中国中铁	75,818	397,286.32	0.16
105	002821	凯莱英	1,056	393,465.60	0.16
106	601377	兴业证券	40,626	392,447.16	0.16
107	300595	欧普康视	3,784	391,833.20	0.16
108	601009	南京银行	36,913	388,324.76	0.16
109	600426	华鲁恒升	12,283	380,158.85	0.16
110	601857	中国石油	71,329	377,330.41	0.15
111	002601	龙麟佰利	10,892	376,645.36	0.15
112	300413	芒果超媒	5,426	372,223.60	0.15
113	601225	陕西煤业	31,367	371,698.95	0.15
114	000963	华东医药	7,820	359,798.20	0.15
115	688036	传音控股	1,700	356,150.00	0.15
116	000895	双汇发展	11,140	354,252.00	0.15
117	000786	北新建材	8,947	351,169.75	0.14
118	002607	中公教育	16,662	348,069.18	0.14
119	600584	长电科技	9,234	347,937.12	0.14
120	600009	上海机场	7,186	345,862.18	0.14
121	002001	新和成	12,058	345,823.44	0.14
122	600111	北方稀土	16,381	339,086.70	0.14
123	600926	杭州银行	22,824	336,654.00	0.14
124	601939	建设银行	50,329	334,687.85	0.14
125	601100	恒立液压	3,822	328,386.24	0.13
126	002050	三花智控	13,671	327,830.58	0.13
127	600132	重庆啤酒	1,654	327,409.30	0.13
128	603882	金域医学	2,042	326,250.34	0.13
129	300408	三环集团	7,628	323,579.76	0.13
130	000166	申万宏源	69,063	323,214.84	0.13
131	002841	视源股份	2,542	315,945.18	0.13
132	600958	东方证券	31,460	314,285.40	0.13
133	600741	华域汽车	11,915	313,007.05	0.13
134	002179	中航光电	3,947	311,891.94	0.13
135	600176	中国巨石	19,929	309,098.79	0.13
136	600600	青岛啤酒	2,670	308,785.50	0.13
137	000157	中联重科	32,840	303,441.60	0.12
138	601128	常熟银行	48,900	303,180.00	0.12
139	300433	蓝思科技	10,298	302,864.18	0.12
140	601336	新华保险	6,504	298,598.64	0.12

141	002007	华兰生物	8,111	297,511.48	0.12
142	601600	中国铝业	55,629	294,833.70	0.12
143	601006	大秦铁路	44,321	291,632.18	0.12
144	688012	中微公司	1,757	291,521.44	0.12
145	601901	方正证券	31,092	291,021.12	0.12
146	300003	乐普医疗	9,050	290,686.00	0.12
147	603993	洛阳钼业	56,246	290,229.36	0.12
148	601155	新城控股	6,965	289,744.00	0.12
149	600015	华夏银行	46,339	286,838.41	0.12
150	601877	正泰电器	8,592	286,800.96	0.12
151	600143	金发科技	13,436	280,274.96	0.12
152	600352	浙江龙盛	20,247	278,193.78	0.11
153	600089	特变电工	21,411	275,131.35	0.11
154	601138	工业富联	22,047	273,603.27	0.11
155	002236	大华股份	12,948	273,202.80	0.11
156	601989	中国重工	66,172	272,628.64	0.11
157	001979	招商蛇口	24,669	270,125.55	0.11
158	300529	健帆生物	3,122	269,615.92	0.11
159	600547	山东黄金	13,983	268,753.26	0.11
160	000768	中航西飞	10,223	268,660.44	0.11
161	601788	光大证券	15,009	268,511.01	0.11
162	600010	包钢股份	173,142	268,370.10	0.11
163	601916	浙商银行	65,600	260,432.00	0.11
164	603806	福斯特	2,434	255,886.42	0.11
165	600760	中航沈飞	4,202	253,380.60	0.10
166	002008	大族激光	6,273	253,366.47	0.10
167	603369	今世缘	4,667	252,764.72	0.10
168	601186	中国铁建	34,008	252,679.44	0.10
169	688169	石头科技	200	252,200.00	0.10
170	000876	新希望	16,912	248,099.04	0.10
171	002736	国信证券	22,692	243,939.00	0.10
172	002202	金风科技	20,025	243,504.00	0.10
173	003816	中国广核	89,860	239,926.20	0.10
174	002555	三七互娱	9,982	239,767.64	0.10
175	000069	华侨城 A	31,705	235,885.20	0.10
176	603659	璞泰来	1,700	232,220.00	0.10
177	600109	国金证券	18,157	230,412.33	0.09
178	601669	中国电建	58,906	227,966.22	0.09
179	600795	国电电力	93,561	227,353.23	0.09

180	603160	汇顶科技	1,737	225,167.31	0.09
181	603899	晨光文具	2,660	224,929.60	0.09
182	000425	徐工机械	35,248	224,529.76	0.09
183	601066	中信建投	7,139	224,378.77	0.09
184	002044	美年健康	24,610	224,197.10	0.09
185	000938	紫光股份	10,205	223,285.40	0.09
186	002384	东山精密	10,680	222,571.20	0.09
187	000977	浪潮信息	7,841	220,567.33	0.09
188	600989	宝丰能源	16,118	220,494.24	0.09
189	601799	星宇股份	973	219,625.56	0.09
190	600886	国投电力	22,266	213,976.26	0.09
191	601838	成都银行	16,915	213,805.60	0.09
192	600085	同仁堂	5,181	211,643.85	0.09
193	600150	中国船舶	12,805	211,410.55	0.09
194	603517	绝味食品	2,500	210,725.00	0.09
195	601108	财通证券	20,035	210,167.15	0.09
196	000783	长江证券	28,609	209,417.88	0.09
197	000703	恒逸石化	17,504	209,172.80	0.09
198	000596	古井贡酒	868	207,886.00	0.09
199	603833	欧派家居	1,448	205,558.08	0.08
200	600183	生益科技	8,716	204,041.56	0.08
201	600029	南方航空	33,792	203,427.84	0.08
202	603019	中科曙光	7,320	202,105.20	0.08
203	688008	澜起科技	3,220	200,863.60	0.08
204	688161	威高骨科	1,888	200,222.40	0.08
205	002624	完美世界	8,345	199,528.95	0.08
206	300558	贝达药业	1,842	199,378.08	0.08
207	002252	上海莱士	26,178	196,073.22	0.08
208	600872	中炬高新	4,666	196,065.32	0.08
209	601985	中国核电	38,741	196,029.46	0.08
210	601238	广汽集团	15,131	195,946.45	0.08
211	300136	信维通信	6,329	195,439.52	0.08
212	002024	苏宁易购	34,675	193,833.25	0.08
213	300144	宋城演艺	11,523	193,586.40	0.08
214	300677	英科医疗	1,549	193,315.20	0.08
215	601607	上海医药	9,133	192,980.29	0.08
216	600079	人福医药	6,814	192,631.78	0.08
217	601555	东吴证券	22,961	191,494.74	0.08
218	300999	金龙鱼	2,246	190,820.16	0.08

219	600362	江西铜业	8,471	189,580.98	0.08
220	002938	鹏鼎控股	5,274	189,231.12	0.08
221	300676	华大基因	1,590	188,574.00	0.08
222	000066	中国长城	12,828	187,288.80	0.08
223	002602	世纪华通	29,004	186,205.68	0.08
224	601111	中国国航	23,455	182,479.90	0.07
225	600845	宝信软件	3,544	180,389.60	0.07
226	600061	国投资本	21,143	179,504.07	0.07
227	600332	白云山	5,292	179,134.20	0.07
228	000728	国元证券	22,475	179,125.75	0.07
229	300033	同花顺	1,588	179,094.64	0.07
230	600522	中天科技	17,861	178,610.00	0.07
231	002600	领益智造	19,314	177,495.66	0.07
232	300628	亿联网络	2,110	176,818.00	0.07
233	600383	金地集团	17,255	176,691.20	0.07
234	600115	中国东航	34,154	173,502.32	0.07
235	000860	顺鑫农业	4,079	172,052.22	0.07
236	601800	中国交建	26,281	170,300.88	0.07
237	002414	高德红外	6,118	168,734.44	0.07
238	688363	华熙生物	600	166,716.00	0.07
239	000708	中信特钢	7,982	166,344.88	0.07
240	002508	老板电器	3,558	165,447.00	0.07
241	600161	天坛生物	4,741	162,379.25	0.07
242	601162	天风证券	32,903	159,908.58	0.07
243	600606	绿地控股	29,292	159,641.40	0.07
244	601618	中国中冶	53,457	159,301.86	0.07
245	600705	中航资本	41,098	159,049.26	0.07
246	601727	上海电气	37,379	158,486.96	0.07
247	601021	春秋航空	2,785	158,466.50	0.07
248	603939	益丰药房	2,822	158,285.98	0.06
249	688425	铁建重工	33,047	156,973.25	0.06
250	002157	正邦科技	12,985	155,170.75	0.06
251	688396	华润微	1,700	154,734.00	0.06
252	600521	华海药业	7,402	154,553.76	0.06
253	002463	沪电股份	9,816	151,853.52	0.06
254	601878	浙商证券	11,578	151,440.24	0.06
255	002916	深南电路	1,348	149,803.24	0.06
256	600011	华能国际	35,268	148,830.96	0.06
257	688687	凯因科技	5,240	146,615.20	0.06

258	600848	上海临港	8,112	145,204.80	0.06
259	601658	邮储银行	28,625	143,697.50	0.06
260	601816	京沪高铁	27,104	143,380.16	0.06
261	002456	欧菲光	16,130	143,234.40	0.06
262	603392	万泰生物	544	140,993.92	0.06
263	601933	永辉超市	29,762	140,774.26	0.06
264	600655	豫园股份	12,047	139,624.73	0.06
265	601216	君正集团	26,857	136,702.13	0.06
266	601990	南京证券	12,783	134,477.16	0.06
267	002558	巨人网络	10,081	134,077.30	0.06
268	000656	金科股份	23,041	133,407.39	0.05
269	601995	中金公司	2,151	132,286.50	0.05
270	600018	上港集团	27,661	131,942.97	0.05
271	601998	中信银行	25,600	130,560.00	0.05
272	002120	韵达股份	9,609	130,009.77	0.05
273	688345	博力威	2,332	129,495.96	0.05
274	600118	中国卫星	4,341	127,017.66	0.05
275	601696	中银证券	6,071	125,001.89	0.05
276	600489	中金黄金	14,458	124,627.96	0.05
277	603195	公牛集团	588	118,776.00	0.05
278	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.05
279	603338	浙江鼎力	1,943	114,034.67	0.05
280	002739	万达电影	7,182	113,403.78	0.05
281	601872	招商轮船	24,311	112,316.82	0.05
282	688009	中国通号	19,673	111,939.37	0.05
283	601319	中国人保	18,873	111,916.89	0.05
284	002673	西部证券	13,531	111,630.75	0.05
285	300896	爱美客	138	108,865.44	0.04
286	688126	沪硅产业	3,400	99,212.00	0.04
287	601881	中国银河	9,185	99,014.30	0.04
288	603658	安图生物	1,267	96,000.59	0.04
289	600233	圆通速递	9,525	95,345.25	0.04
290	688667	菱电电控	914	94,946.32	0.04
291	603233	大参林	1,851	94,604.61	0.04
292	002153	石基信息	3,898	91,641.98	0.04
293	300919	中伟股份	534	87,042.00	0.04
294	601231	环旭电子	5,155	86,655.55	0.04
295	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.03
296	002032	苏泊尔	1,259	80,311.61	0.03

297	600025	华能水电	13,857	80,232.03	0.03
298	000800	一汽解放	7,399	80,057.18	0.03
299	600340	华夏幸福	15,271	80,020.04	0.03
300	600482	中国动力	4,584	79,853.28	0.03
301	002939	长城证券	6,390	71,120.70	0.03
302	600918	中泰证券	6,295	68,111.90	0.03
303	601236	红塔证券	4,898	66,416.88	0.03
304	002773	康弘药业	2,854	66,013.02	0.03
305	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.03
306	601808	中海油服	4,268	61,288.48	0.03
307	300957	贝泰妮	230	58,286.21	0.02
308	603087	甘李药业	538	57,340.04	0.02
309	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.02
310	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
311	601077	渝农商行	13,943	55,632.57	0.02
312	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
313	688260	昀冢科技	2,990	49,065.90	0.02
314	601698	中国卫通	2,933	47,485.27	0.02
315	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
316	300973	立高食品	294	34,961.70	0.01
317	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
318	300979	华利集团	366	34,110.60	0.01
319	002945	华林证券	2,418	33,416.76	0.01
320	600299	安迪苏	2,632	31,478.72	0.01
321	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
322	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
323	300941	创识科技	459	23,010.06	0.01
324	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
325	300981	中红医疗	230	21,621.09	0.01
326	301015	百洋医药	514	20,859.78	0.01
327	300898	熊猫乳品	496	17,984.96	0.01
328	300982	苏文电能	370	17,322.28	0.01
329	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
330	300932	三友联众	518	16,437.22	0.01
331	300937	药易购	304	16,406.44	0.01
332	300614	百川畅银	383	16,272.30	0.01
333	300940	南极光	368	16,038.26	0.01
334	301002	崧盛股份	251	15,676.62	0.01
335	300968	格林精密	1,220	14,941.74	0.01

336	300955	嘉亨家化	314	14,830.88	0.01
337	300942	易瑞生物	498	14,268.41	0.01
338	300996	普联软件	310	14,068.34	0.01
339	301013	C利和兴	504	13,986.51	0.01
340	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
341	300997	欢乐家	979	13,067.16	0.01
342	300892	品渥食品	272	12,479.36	0.01
343	300966	共同药业	358	12,311.56	0.01
344	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
345	300933	中辰股份	1,167	12,191.18	0.01
346	301016	雷尔伟	347	12,175.58	0.00
347	300950	德固特	286	11,320.49	0.00
348	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
349	300986	志特新材	332	10,808.84	0.00
350	300948	冠中生态	379	10,474.13	0.00
351	300971	博亚精工	345	10,457.05	0.00
352	300962	中金辐照	607	10,173.12	0.00
353	300987	川网传媒	354	10,134.69	0.00
354	300945	曼卡龙	531	10,073.73	0.00
355	300961	深水海纳	436	9,727.10	0.00
356	300930	屹通新材	390	9,575.08	0.00
357	300958	建工修复	343	9,420.74	0.00
358	300931	通用电梯	713	9,360.14	0.00
359	300993	玉马遮阳	467	9,331.05	0.00
360	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
361	300978	东箭科技	630	8,741.53	0.00
362	300991	创益通	305	8,577.70	0.00
363	300926	博俊科技	384	8,534.80	0.00
364	300927	江天化学	263	7,928.72	0.00
365	300963	中洲特材	330	7,821.67	0.00
366	300960	通业科技	332	7,806.84	0.00
367	300985	致远新能	297	7,437.93	0.00
368	300943	春晖智控	312	7,215.60	0.00
369	300975	商络电子	517	6,872.51	0.00
370	300967	晓鸣股份	561	6,749.88	0.00
371	300929	华骐环保	227	6,732.05	0.00
372	300972	万辰生物	500	6,635.10	0.00
373	300992	泰福泵业	268	6,021.72	0.00
374	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00

375	300998	宁波方正	253	5,895.24	0.00
376	301010	晶雪节能	272	5,127.96	0.00
377	300995	奇德新材	209	5,008.52	0.00
378	301012	扬电科技	191	4,854.16	0.00
379	301007	德迈仕	322	4,766.15	0.00
380	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	8,282,360.55	2.68
2	000001	平安银行	7,992,392.00	2.59
3	002142	宁波银行	7,108,142.00	2.30
4	601318	中国平安	6,190,192.00	2.01
5	000858	五粮液	5,097,477.62	1.65
6	600036	招商银行	4,937,307.00	1.60
7	601012	隆基股份	3,591,138.48	1.16
8	601166	兴业银行	3,343,262.00	1.08
9	601888	中国中免	3,341,261.09	1.08
10	002594	比亚迪	3,319,873.00	1.08
11	600276	恒瑞医药	3,055,042.00	0.99
12	000333	美的集团	3,020,267.00	0.98
13	002714	牧原股份	2,809,710.74	0.91
14	600905	三峡能源	2,749,221.30	0.89
15	603259	药明康德	2,677,703.10	0.87
16	601899	紫金矿业	2,640,202.58	0.86
17	300059	东方财富	2,616,415.46	0.85
18	002352	顺丰控股	2,381,674.10	0.77
19	600031	三一重工	2,359,220.16	0.76
20	002475	立讯精密	2,182,606.00	0.71

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票

收入”) 均按买卖成交金额 (成交单价乘以成交数量) 填列, 不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位: 人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000001	平安银行	16,825,929.59	5.45
2	002142	宁波银行	16,358,581.85	5.30
3	601318	中国平安	8,998,296.64	2.92
4	600519	贵州茅台	6,427,333.62	2.08
5	600036	招商银行	5,836,032.66	1.89
6	000858	五粮液	4,615,949.55	1.50
7	000333	美的集团	4,480,827.81	1.45
8	600276	恒瑞医药	3,341,412.88	1.08
9	002594	比亚迪	3,303,841.08	1.07
10	600031	三一重工	2,933,745.74	0.95
11	601012	隆基股份	2,819,810.33	0.91
12	601939	建设银行	2,813,839.60	0.91
13	601888	中国中免	2,481,711.46	0.80
14	600887	伊利股份	2,333,204.65	0.76
15	000002	万科A	2,272,330.19	0.74
16	601899	紫金矿业	2,227,631.03	0.72
17	600690	海尔智家	2,145,100.94	0.70
18	300059	东方财富	2,137,056.39	0.69
19	000651	格力电器	2,039,971.37	0.66
20	000568	泸州老窖	2,026,500.83	0.66

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	229,976,386.67
卖出股票收入 (成交) 总额	250,455,914.74

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位: 人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	32,895,850.00	13.50

2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,145.00	0.01
	其中：政策性金融债	20,145.00	0.01
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	32,915,995.00	13.51

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019640	20 国债 10	328,150	32,815,000.00	13.47
2	010303	03 国债(3)	600	60,810.00	0.02
3	010107	21 国债(7)	200	20,040.00	0.01
4	018006	国开 1702	100	10,118.00	0.00
5	108604	国开 1805	100	10,027.00	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本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

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

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

(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

(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。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	54,701.69
2	应收证券清算款	691,284.98
3	应收股利	-
4	应收利息	719,507.54
5	应收申购款	1,349.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,466,843.25

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	4,117,610.70	1.69	主板锁定

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中科沃土沃鑫成长混合发起 A	502	76,864.06	31,287,444.38	81.09%	7,298,314.56	18.91%
中科沃土沃鑫成长混合发起 C	35	3,976,009.39	131,748,350.90	94.67%	7,411,977.60	5.33%
合计	537	330,998.30	163,035,795.28	91.72%	14,710,292.16	8.28%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中科沃土沃鑫成长混合发起 A	3,346,880.82	8.67%
	中科沃土沃鑫成长混合发起 C	0.00	0.00%
	合计	3,346,880.82	1.88%

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	份额级别	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	中科沃土沃鑫成长混	>100

投资和研究部门负责人持有本开放式基金	合发起 A	
	中科沃土沃鑫成长混合发起 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中科沃土沃鑫成长混合发起 A	0
	中科沃土沃鑫成长混合发起 C	0
	合计	0

注：本报告期内本基金经理未持有本基金份额。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

截止到本报告期末，发起份额承诺期限已到期。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中科沃土沃鑫成长混合发起 A	中科沃土沃鑫成长混合发起 C
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	136,869,684.60	102,742,340.41
本报告期基金总申购份额	236,080.27	191,035,643.66
减：本报告期基金总赎回份额	98,520,005.93	154,617,655.57
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	38,585,758.94	139,160,328.50

注：本基 C 类份额合同生效日为 2020 年 6 月 29 日，生效当日份额为 0。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	139,874,521.09	29.76%	102,290.81	29.76%	-
安信证券	1	139,471,930.93	29.67%	101,996.13	29.67%	-
国盛证券	2	91,474,062.17	19.46%	66,894.89	19.46%	-
兴业证券	2	84,133,990.80	17.90%	61,527.48	17.90%	-

太平洋证券	1	15,085,971.54	3.21%	11,032.40	3.21%	-
东莞证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

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
广发证券	-	-	775,800,000.00	42.44%	-	-

安信证券	4,999,000.00	99.98%	1,052,400,000.00	57.56%	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	1,006.68	0.02%	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

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	中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2020 年第四季度报告	中国证券报及基金管理人网站	2021 年 1 月 21 日
2	中科沃土基金管理有限公司基金管理人的法定名称、住所发生变更的公告	中国证券报及基金管理人网站	2021 年 3 月 6 日
3	中科沃土基金管理有限公司基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东事项公告	中国证券报及基金管理人网站	2021 年 3 月 20 日
4	中科沃土基金管理有限公司关于旗下基金在东方财富证券推出定期定额投资业务的公告	中国证券报及基金管理人网站	2021 年 3 月 26 日
5	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 2020 年年度报告	中国证券报及基金管理人网站	2021 年 3 月 30 日
6	中科沃土基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报及基金管理人网站	2021 年 4 月 17 日
7	中科沃土沃鑫成长精选灵活	中国证券报及基金	2021 年 4 月 21 日

	配置混合型发起式证券投资基金 2021 年第一季度报告	管理人网站	
8	中科沃土基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报及基金管理人网站	2021 年 5 月 22 日
9	中科沃土基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告	中国证券报及基金管理人网站	2021 年 5 月 26 日
10	中科沃土基金管理有限公司关于选举副董事长的公告	中国证券报及基金管理人网站	2021 年 5 月 28 日
11	中科沃土基金管理有限公司关于新增金海九州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	2021 年 6 月 4 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
产品	1	20210412-20210414; 20210421-20210630	0.00	39,027,473.15	-	39,027,473.15	21.96%
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

2021 年 8 月 31 日