

# 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 年年度报告

2021 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:2022 年 03 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2022年3月30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2021年1月1日起至12月31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	5
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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	63
8.1 期末基金资产组合情况	63
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	64
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	65
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	79
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	80
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	81
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	81
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	81
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	81
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	82

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	82
8.12 投资组合报告附注.....	82
§9 基金份额持有人信息.....	83
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	83
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	84
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情况.....	84
§10 开放式基金份额变动.....	84
§11 重大事件揭示.....	85
11.1 基金份额持有人大会决议.....	85
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.....	85
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	85
11.4 基金投资策略的改变.....	85
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	85
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.....	86
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	86
11.8 其他重大事件.....	89
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
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.....	89
§13 备查文件目录.....	90
13.1 备查文件目录.....	90
13.2 存放地点.....	90
13.3 查阅方式.....	90

## § 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	161,917,381.50份	
基金合同存续期	不定期	
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	27,769,188.21份	134,148,193.29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。

### 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
	联系电话	0757-86208608
	电子邮箱	caoping@richlandasm.com.cn
客户服务电话	400-018-3610	95588
传真	0757-86208604	(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	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
邮政编码	528200	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	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）

## 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	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

## §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	2021年		2020年		2019年	
	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	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	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
本期已 实现收 益	15,658,41 3.89	26,579,38 1.36	31,549,56 3.78	8,819,31 0.79	13,741,43 1.00	-
本期利 润	4,885,65 6.95	13,686,08 9.87	43,924,90 7.37	14,234,82 6.64	19,611,37 5.84	-
加权平 均基金 份额本 期利润	0.0908	0.1076	0.3328	0.1782	0.2287	-
本期加 权平均 净值利 润率	6.82%	8.02%	29.73%	14.30%	25.45%	-
本期基 金份额 净值增	8.70%	7.88%	31.83%	24.35%	21.26%	-

长率						
<b>3.1.2 期末数 据和指 标</b>	2021年末		2020年末		2019年末	
期末可供分配利润	11,113,37 5.90	52,017,07 4.20	27,554,34 1.65	20,630,15 6.82	-3,618,93 8.99	-
期末可供分配基金份额利润	0.4002	0.3878	0.2013	0.2008	-0.0328	-
期末基金资产净值	38,882,56 4.11	186,165,2 67.49	176,308,3 60.10	132,166,5 61.67	107,848,7 05.14	-
期末基金份额净值	1.4002	1.3878	1.2881	1.2864	0.9771	-
<b>3.1.3 累计期 末指标</b>	2021年末		2020年末		2019年末	
基金份额累计净值增长率	40.02%	33.74%	28.81%	24.35%	-2.29%	-

- 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。
- 4 本基金C类份额成立日为2020年6月29日。



### 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
过去三个月	2.57%	0.58%	1.06%	0.39%	1.51%	0.19%
过去六个月	1.85%	0.72%	-2.00%	0.51%	3.85%	0.21%
过去一年	8.70%	0.81%	-1.55%	0.59%	10.25%	0.22%
过去三年	73.77%	1.11%	33.73%	0.64%	40.04%	0.47%
过去五年	39.94%	1.02%	26.95%	0.59%	12.99%	0.43%
自基金合同生效起至今	40.02%	1.00%	24.29%	0.59%	15.73%	0.41%

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
过去三个月	2.10%	0.58%	1.06%	0.39%	1.04%	0.19%
过去六个月	1.34%	0.72%	-2.00%	0.51%	3.34%	0.21%
过去一年	7.88%	0.81%	-1.55%	0.59%	9.43%	0.22%
自基金合同生效起至今	33.74%	0.84%	24.29%	0.61%	9.45%	0.23%

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累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年10月25日-2021年12月31日)

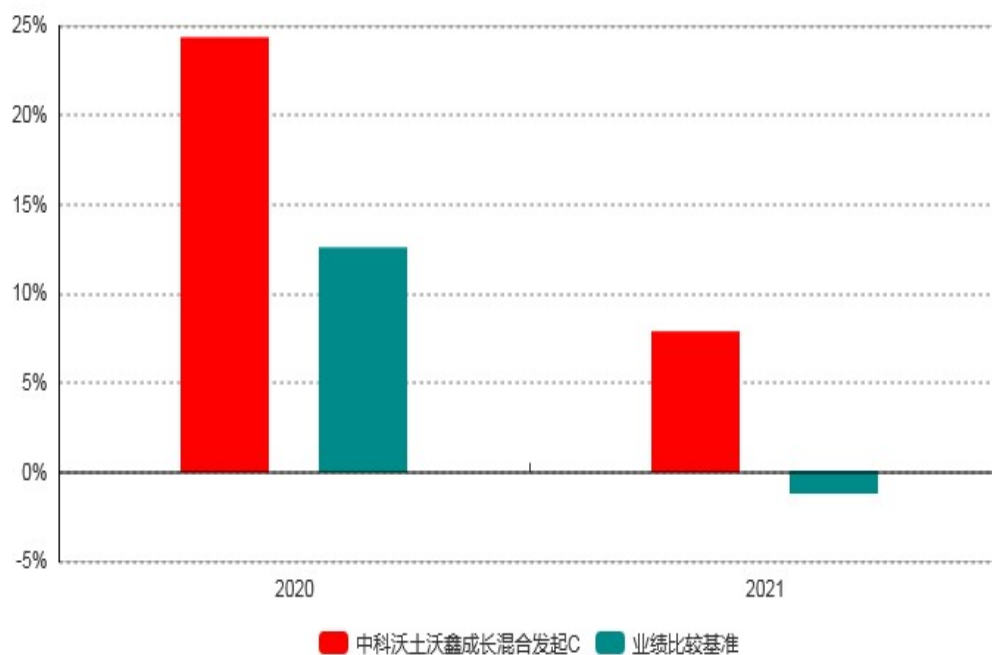


中科沃土沃鑫成长混合发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年06月29日-2021年12月31日)



1、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。

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



基金合同生效当年（份额 A：2016 年；份额 C：2020 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（2016年10月25日）至本期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。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		
徐伟	基金经理、权益投资部总经理助理	2019-08-09	-	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，2022年3月1日起，徐

					伟担任中科沃土沃瑞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。
--	--	--	--	--	---

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

### 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

在2021年中，虽然受到境外流入变异毒株的影响，国内部分地区散发疫情有所反复，但疫情控制措施的效果仍然较好，并未对国内生产生活带来重大影响，国内消费的增长较为平稳，增速波动不大。海外疫情受到变异毒株的影响日均新感染人数再次反弹，但主要经济体并未加强疫情的管控措施，利好中国的净出口保持较高的增速，对2021年的GDP增长贡献较大。投资方面受到房地产投资增速大幅度下滑的拖累，整体增长速度也有下滑，也导致了下半年GDP的增速出现了一定程度的下降，到四季度降幅更加扩大。

在2021年上半年，较严格的“能耗”双控政策使得部分上游产品产能利用率偏低，价格出现了较大幅度的上行。下半年相关政策做出了较大的调整，“能耗”双控政策在细节上的微调，同时配合强有力的能源保供政策，有效抑制了以能源产品为首的大宗商品价格上涨的势头，PPI的上行压力缓解，CPI也因为猪肉价格处于低位而上涨幅度较小，为货币政策与财政政策发力稳增长提供了空间。

在GDP增速下降压力开始逐步变大的背景下，2021年底的中央政治局会议、中央经济工作会议提出要加大稳增长的力度。在稳增长的政策框架下，国内的货币政策逐步走向宽松，降准降息的预期逐步加强。财政支出也将充分发挥托底作用，基建投资力度将进一步加大。信贷政策上，房地产信贷调控政策边际上有所放松，但是对实体经济发展的支持没有变化。

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，资本市场在未来中国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。在前述宏观经济状况下，我们在2021年的投资策略中，保持了较均衡的股票仓位水平，行业配置也较为均衡，估值较为合理。精选优质公司，分享公司的业绩增长也仍然是我们投资组合的核心策略。我们希望通过较长期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

截至报告期末中科沃土沃鑫A级基金份额净值为1.4002元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为8.70%，同期业绩比较基准收益率为-1.55%；截至报告期末中科沃土沃鑫C级基金份额净值为1.3878元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为7.88%，同期业绩比较基准收益率为-1.55%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于全球经济增速，我们认为由于最新变异毒株的特性，让全球很多国家对新冠疫情的预期逐步改善，主要经济体的防疫管控政策也陆续放开，预计其经济复苏进程仍然能够持续较高强度，欧美等发达国家能获得比较高的经济增速。

但我们认为在供给方面，全球范围内将面临较大的冲击，2022年内的全球PPI有较大概率会维持在较高水平。原因是前五年大宗商品开采与生产的资本开支持续不振，叠加疫情对海外基础设施建设的巨大影响，在目前海外经济逐步复苏对需求的提振的背景下，2022年受全球市场定价影响较大的商品可能仍然面临较大的价格上涨压力。国际大宗商品涨价会对国内造成输入性通胀压力，同时能繁母猪存栏量的持续下降也可能导致在四季度出现猪肉价格上涨压力，这些因素可能会在2022年晚些时候制约货币政策进一步宽松，财政政策进一步积极的力度。

我们预期2022年宏观经济增速下滑的压力较大，财政政策、货币政策将同步发力，扩信用与宽货币将同时实施，拉动宏观经济增长保持在合理稳定区间。但海外市场方面，发达经济体通胀高企的势头抑制了其货币政策进一步宽松的可能，美联储加息的预期增强，预计从一季度末开始2022年内可能实施2~3次加息，在一定程度上也可能对国内货币政策的宽松力度产生制约。

在2022年的投资策略中，我们将加强对全球能源供需形势的研究，重点关注对解决能源供应问题有帮助的行业与公司。

#### 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，本基金本报告期内未进行利润分配，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，无相关预警说明。

### § 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中科沃土基金管理有限公司编制和披露的中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金2021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(2022)第22944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	中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	（一）我们审计的内容 我们审计了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“中科沃土沃鑫成长混合基金”）的财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。（二）我们的意见 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沃鑫成长混合基金2021年12月31日的财务状况以及2021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	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

	<p>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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中科沃土沃鑫成长混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>中科沃土沃鑫成长混合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。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中科沃土沃鑫成长混合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沃鑫成长混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督中科沃土沃鑫成长混合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。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：（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</p>

	<p>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。（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。（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。（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，就可能对中科沃土沃鑫成长混合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沃鑫成长混合基金不能持续经营。</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。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 姜爱悦
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	2022-03-29

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	10,774,580.53	17,297,531.58
结算备付金		34,942,960.98	24,529,195.94
存出保证金		36,778.16	78,414.02
交易性金融资产	7.4.7.2	181,665,295.70	294,494,343.76
其中：股票投资		163,671,050.20	174,078,374.96
基金投资		-	-
债券投资		17,994,245.50	120,415,968.80
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	-	-
应收证券清算款		-	3,360,929.18
应收利息	7.4.7.5	359,615.58	2,333,078.45
应收股利		-	-
应收申购款		2,001,420.27	206.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		229,780,651.22	342,093,699.55
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020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		2,000,000.00	23,000,000.00
应付证券清算款		2,034,719.82	-

应付赎回款		-	9,748,038.30
应付管理人报酬		283,828.10	420,600.50
应付托管费		47,304.68	70,100.04
应付销售服务费		31,227.14	25,640.52
应付交易费用	7.4.7.7	117,998.10	143,028.31
应交税费		-	-
应付利息		-2,258.22	-8,630.14
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	220,000.00	220,000.25
负债合计		4,732,819.62	33,618,777.78
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	161,917,381.50	239,612,025.01
未分配利润	7.4.7.10	63,130,450.10	68,862,896.76
所有者权益合计		225,047,831.60	308,474,921.77
负债和所有者权益总计		229,780,651.22	342,093,699.55

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额总额161,917,381.50份，其中A类基金份额净值1.4002元，A类基金份额27,769,188.21份；C类基金份额净值1.3878元，C类基金份额134,148,193.29份。

## 7.2 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01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年12月31日
<b>一、收入</b>		24,715,197.59	63,548,483.33
1. 利息收入		945,148.71	1,672,454.48
其中：存款利息收入	7.4.7.11	231,808.30	442,321.38
债券利息收入		713,340.41	1,162,624.72

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	67,508.38
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		47,073,875.67	43,726,783.32
其中：股票投资收益	7.4.7.12	44,553,605.86	41,467,850.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-118,424.24	74,229.67
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	112,342.13	-
股利收益	7.4.7.16	2,526,351.92	2,184,703.37
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-23,666,048.43	17,790,859.44
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	362,221.64	358,386.09
<b>减：二、费用</b>		6,143,450.77	5,388,749.32
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	3,633,885.15	2,942,558.39
2. 托管费	7.4.10.2. 2	605,647.51	490,426.29
3. 销售服务费	7.4.10.2. 3	339,018.18	98,606.65
4. 交易费用	7.4.7.19	1,044,246.40	1,086,157.52
5. 利息支出		341,916.06	594,501.70
其中：卖出回购金融资产		341,916.06	594,501.70

支出			
6. 税金及附加		422.13	7.02
7. 其他费用	7.4.7.20	178,315.34	176,491.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,571,746.82	58,159,734.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,571,746.82	58,159,734.01

### 7.3 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01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021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)	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)	-	18,571,746.82	18,571,746.82
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)	-77,694,643.51	-24,304,193.48	-101,998,836.99
其中：1. 基金申购款	368,376,533.69	120,703,274.71	489,079,808.40
2. 基金赎回款	-446,071,177.20	-145,007,468.19	-591,078,645.39
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）	161,917,381.50	63,130,450.10	225,047,831.60
项 目	上年度可比期间 2020年01月01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）	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）	-	58,159,734.01	58,159,734.01
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）	129,237,518.74	13,228,963.88	142,466,482.62
其中：1. 基金申购款	352,760,050.41	52,265,596.63	405,025,647.04
2. 基金赎回款	-223,522,531.67	-39,036,632.75	-262,559,164.42
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）	239,612,025.01	68,862,896.76	308,474,921.77

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：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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”)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[2016]第1561号《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》核准,由中科沃土基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中科沃土沃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》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213,695,669.67元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2016)验字第61247680\_G06号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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》于2016年10月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为213,733,032.47份基金份额,其中认购资金利息折合37,362.80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”)。

根据中科沃土基金管理有限公司于2020年6月29日发布的《关于中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金增加C类基金份额并根据〈公开募集证券投资基金信息披露管理办法〉修改基金合同等法律文件相应条款的公告》,自2020年6月29日起本基金增加C类基金份额。

根据《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更新的招募说明书》,本基金根据申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》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具。本基金的投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-95%。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。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2022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》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。

本财务报表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2021年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2021年12月31日的财务状况以及2021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、托管费和销售服务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

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

2、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；

3、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；

4、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；

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《中国证监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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号-收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

##### 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	10,774,580.53	17,297,531.58
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	10,774,580.53	17,297,531.58

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	163,745,086.74	163,671,050.20	-74,036.54	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	18,033,726.59	17,994,245.50	-39,481.09
	银行间市场	-	-	-
	合计	18,033,726.59	17,994,245.50	-39,481.09
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	181,778,813.33	181,665,295.70	-113,517.63	
项目	上年度末			

		2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		150,396,310.45	174,078,374.96	23,682,064.51
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	120,545,502.51	120,415,968.80	-129,533.71
	银行间市场	-	-	-
	合计	120,545,502.51	120,415,968.80	-129,533.71
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		270,941,812.96	294,494,343.76	23,552,530.80

#### 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

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	1,986.16	1,020.78
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	18.15	38.83
应收结算备付金利息	6,512.33	77,427.00
应收债券利息	351,098.94	2,254,591.84

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	-	-
合计	359,615.58	2,333,078.45

#### 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	117,998.10	143,028.31
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	117,998.10	143,028.31

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	0.25
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	220,000.00	220,000.00
合计	220,000.00	220,000.25

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 7.4.7.9.1 中科沃土沃鑫成长混合发起A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31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	21,662,415.14	21,662,415.14
本期赎回（以“-”号填列）	-130,762,911.53	-130,762,911.53
本期末	27,769,188.21	27,769,188.21

#### 7.4.7.9.2 中科沃土沃鑫成长混合发起C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31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	346,714,118.55	346,714,118.55
本期赎回（以“-”号填列）	-315,308,265.67	-315,308,265.67
本期末	134,148,193.29	134,148,193.29

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

##### 7.4.7.10.1 中科沃土沃鑫成长混合发起A

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	27,554,341.65	11,884,333.85	39,438,675.50
本期利润	15,658,413.89	-10,772,756.94	4,885,656.95
本期基金份额交易产生的变动数	-31,024,169.00	-2,186,787.55	-33,210,956.55
其中：基金申购款	9,031,957.71	-1,163,365.56	7,868,592.15
基金赎回款	-40,056,126.71	-1,023,421.99	-41,079,548.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,188,586.54	-1,075,210.64	11,113,375.90

#### 7.4.7.10.2 中科沃土沃鑫成长混合发起C

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	20,630,156.82	8,794,064.44	29,424,221.26
本期利润	26,579,381.36	-12,893,291.49	13,686,089.87
本期基金份额交易产生的变动数	10,119,011.75	-1,212,248.68	8,906,763.07
其中：基金申购款	119,103,526.41	-6,268,843.85	112,834,682.56
基金赎回款	-108,984,514.66	5,056,595.17	-103,927,919.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	57,328,549.93	-5,311,475.73	52,017,074.20

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	57,589.23	44,007.36
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	173,451.31	397,233.46
其他	767.76	1,080.56
合计	231,808.30	442,321.38

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	397,409,813.00	368,574,850.64

减：卖出股票成本总额	352,856,207.14	327,107,000.36
买卖股票差价收入	44,553,605.86	41,467,850.28

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	-118,424.24	74,229.67
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	-118,424.24	74,229.67

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月 31日
卖出债券(、债转 股及债券到期兑 付)成交总额	139,120,197.94	55,111,368.45
减：卖出债券(、 债转股及债券到期 兑付)成本总额	136,215,930.92	53,917,989.97
减：应收利息总额	3,022,691.26	1,119,148.81
买卖债券差价收入	-118,424.24	74,229.67

##### 7.4.7.13.3 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

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间收益金额 2020年01月01日至2020年 12月31日
股指期货投资收益	112,342.13	-

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,526,351.92	2,184,703.37
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	2,526,351.92	2,184,703.37

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12 月31日
1. 交易性金融资产	-23,666,048.43	17,790,859.44
——股票投资	-23,756,101.05	17,922,870.12
——债券投资	90,052.62	-132,010.68
——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	-23,666,048.43	17,790,859.44

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	362,221.64	300,505.42
其他	-	89.63
转换费收入	-	57,791.04
合计	362,221.64	358,386.09

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 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	1,041,407.68	1,086,157.52
银行间市场交易费用	-	-
期货市场交易费用	2,838.72	-
合计	1,044,246.40	1,086,157.52



#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
银行汇划费	8,315.34	6,491.75
合计	178,315.34	176,491.75

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

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权证交易。

###### 7.4.10.1.3 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。

###### 7.4.10.1.4 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。

###### 7.4.10.1.6 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 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,633,885.15	2,942,558.39
其中：支付销售机构的客户维护费	1,053,538.56	710,967.74

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 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	605,647.51	490,426.29

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。

#### 7.4.10.2.3 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01月01日至2021年12月31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	-	184,008.18	184,008.18
合计	-	184,008.18	184,008.18
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31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	-	62,967.95	62,967.95

合计	-	62,967.95	62,967.95
----	---	-----------	-----------

注：

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。

#### 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

##### 7.4.10.4.1 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发生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。

##### 7.4.10.4.2 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发生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。

#### 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

本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 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

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12月31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	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份

		额的比例		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	1.2421%
广东中广 投资管理 有限公司	-	-	197,642.23	0.0825%

注：

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资中科沃土沃鑫成长混合发起C类基金份额。

#### 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 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020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	10,774,580.53	57,589.23	17,297,531.58	44,007.36

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（2021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

7.4.12.1.1 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
600941	中国移动	2021-12-24	2022-07-05	新股未上市	57.58	57.58	61,154	3,521,247.32	3,521,247.32	-
601728	中国电信	2021-08-11	2022-02-21	主板锁定	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
600941	中国移动	2021-12-24	2022-01-05	新股未上市	57.58	57.58	26,208	1,509,056.64	1,509,056.64	-
688187	时代电气	2021-08-30	2022-03-07	科创板锁定	31.38	76.65	4,515	141,680.70	346,074.75	-
688711	宏微科技	2021-08-25	2022-03-01	科创板锁定	27.51	116.52	1,865	51,306.15	217,309.80	-
688776	国光电气	2021-08-24	2022-02-28	科创板锁定	51.44	184.99	1,109	57,046.96	205,153.91	-
688305	科德数控	2021-07-02	2022-01-10	科创板锁定	11.03	105.68	1,496	16,500.88	158,097.28	-
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-01-06	新股未上市	41.98	41.98	2,083	87,444.34	87,444.34	-
688786	悦安新材	2021-08-18	2022-02-28	科创板锁定	11.76	54.01	1,513	17,792.88	81,717.13	-
6882	统联	2021	2022	科创	42.7	39.5	1,848	79,0	73,0	-

10	精密	-12- 20	-06- 27	板锁 定	6	3		20.4 8	51.4 4	
3011 36	招标 股份	2021 -12- 31	2022 -01- 11	新股 未上 市	10.5 2	10.5 2	6,794	71,4 72.8 8	71,4 72.8 8	-
3010 29	怡合 达	2021 -07- 14	2022 -01- 24	创业 板锁 定	14.1 4	89.8 7	462	6,53 2.68	41,5 19.9 4	-
3010 50	雷电 微力	2021 -08- 17	2022 -02- 24	创业 板锁 定	60.6 4	234. 74	120	7,27 6.80	28,1 68.8 0	-
3010 58	中粮 工科	2021 -09- 01	2022 -03- 09	创业 板锁 定	3.55	18.2 4	1,386	4,92 0.30	25,2 80.6 4	-
3010 69	凯盛 新材	2021 -09- 16	2022 -03- 28	创业 板锁 定	5.17	44.2 1	539	2,78 6.63	23,8 29.1 9	-
3011 55	海力 风电	2021 -11- 17	2022 -05- 24	创业 板锁 定	60.6 6	96.7 5	240	14,5 58.4 0	23,2 20.0 0	-
3010 18	申菱 环境	2021 -06- 28	2022 -01- 07	创业 板锁 定	8.29	26.0 6	782	6,48 2.78	20,3 78.9 2	-
3011 49	隆华 新材	2021 -11- 03	2022 -05- 10	创业 板锁 定	10.0 7	16.7 6	1,214	12,2 24.9 8	20,3 46.6 4	-
3010 82	久盛 电气	2021 -10- 14	2022 -04- 27	创业 板锁 定	15.4 8	21.5 3	915	14,1 64.2 0	19,6 99.9 5	-
3009 94	久祺 股份	2021 -08- 02	2022 -02- 14	创业 板锁 定	11.9 0	45.4 5	420	4,99 8.00	19,0 89.0 0	-
3010	润丰	2021	2022	创业	22.0	56.2	337	7,42	18,9	-

35	股份	-07- 21	-01- 28	板锁 定	4	8		7.48	66.3 6	
3010 60	兰卫 医学	2021 -09- 06	2022 -03- 14	创业 板锁 定	4.17	30.9 4	587	2,44 7.79	18,1 61.7 8	-
3010 39	中集 车辆	2021 -07- 01	2022 -01- 10	创业 板锁 定	6.96	12.5 1	1,342	9,34 0.32	16,7 88.4 2	-
3011 18	恒光 股份	2021 -11- 09	2022 -05- 18	创业 板锁 定	22.7 0	49.0 2	315	7,15 0.50	15,4 41.3 0	-
3010 89	拓新 药业	2021 -10- 20	2022 -04- 27	创业 板锁 定	19.1 1	67.9 3	220	4,20 4.20	14,9 44.6 0	-
3011 27	天源 环保	2021 -12- 23	2022 -06- 30	创业 板锁 定	12.0 3	17.1 2	857	10,3 09.7 1	14,6 71.8 4	-
3010 46	能辉 科技	2021 -08- 10	2022 -02- 17	创业 板锁 定	8.34	48.9 9	290	2,41 8.60	14,2 07.1 0	-
3012 11	亨迪 药业	2021 -12- 14	2022 -06- 22	创业 板锁 定	25.8 0	33.6 5	416	10,7 32.8 0	13,9 98.4 0	-
3011 11	粤万 年青	2021 -11- 30	2022 -06- 07	创业 板锁 定	10.4 8	36.6 8	379	3,97 1.92	13,9 01.7 2	-
3010 20	密封 科技	2021 -06- 28	2022 -01- 06	创业 板锁 定	10.6 4	30.4 4	421	4,47 9.44	12,8 15.2 4	-
3010 26	浩通 科技	2021 -07- 08	2022 -01- 17	创业 板锁 定	18.0 3	62.7 3	203	3,66 0.09	12,7 34.1 9	-
3011	明月	2021	2022	创业	26.9	43.3	289	7,77	12,5	-



01	镜片	-12-09	-06-16	板锁定	1	6		6.99	31.04	
301087	可孚医疗	2021-10-15	2022-04-25	创业板锁定	93.09	75.34	163	15,173.67	12,280.42	-
301185	鸥玛软件	2021-11-11	2022-05-19	创业板锁定	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	创业板锁定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	创业板锁定	26.17	44.86	260	6,804.20	11,663.60	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	创业板锁定	10.45	11.22	1,017	10,627.65	11,410.74	-
301221	光庭信息	2021-12-15	2022-06-22	创业板锁定	69.89	88.72	128	8,945.92	11,356.16	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	创业板锁定	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301126	达嘉维康	2021-11-30	2022-06-07	创业板锁定	12.37	19.23	565	6,989.05	10,864.95	-
301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	创业板锁定	39.08	52.13	201	7,855.08	10,478.13	-
301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	创业板锁定	36.50	31.31	319	11,643.50	9,987.89	-
3010	东亚	2021	2022	创业	5.31	13.5	733	3,89	9,89	-

28	机械	-07-12	-01-20	板锁定		0		2.23	5.50	
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	创业板锁定	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	创业板锁定	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301166	优宁维	2021-12-21	2022-06-28	创业板锁定	86.06	94.50	97	8,347.82	9,166.50	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	创业板锁定	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301100	风光股份	2021-12-10	2022-06-17	创业板锁定	27.81	31.14	281	7,814.61	8,750.34	-
301182	凯旺科技	2021-12-16	2022-06-23	创业板锁定	27.12	30.58	279	7,566.48	8,531.82	-
301052	果麦文化	2021-08-23	2022-02-28	创业板锁定	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	创业板锁定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	创业板锁定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	创业板锁定	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
3011	善水	2021	2022	创业	27.8	27.4	281	7,82	7,71	-

90	科技	-12-17	-06-24	板锁定	5	6		5.85	6.26	
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	创业板锁定	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	创业板锁定	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	创业板锁定	33.16	24.67	301	9,981.16	7,425.67	-
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	创业板锁定	66.18	56.62	131	8,669.58	7,417.22	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	创业板锁定	58.08	49.85	148	8,595.84	7,377.80	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	创业板锁定	30.73	29.14	248	7,621.04	7,226.72	-
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	创业板锁定	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	创业板锁定	43.99	50.77	131	5,762.69	6,650.87	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	创业板锁定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	创业板锁定	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
3010	新柴	2021	2022	创业	4.97	12.5	513	2,54	6,41	-

32	股份	-07-15	-01-24	板锁定		1		9.61	7.63	
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	创业板锁定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	创业板锁定	36.31	35.52	177	6,426.87	6,287.04	-
301199	迈赫股份	2021-11-30	2022-06-07	创业板锁定	29.28	32.00	194	5,680.32	6,208.00	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	创业板锁定	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	创业板锁定	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	创业板锁定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301083	百胜智能	2021-10-13	2022-04-21	创业板锁定	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	创业板锁定	57.27	53.71	110	6,299.70	5,908.10	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	创业板锁定	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	创业板锁定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
0012	泰慕	2021	2022	新股	16.5	16.5	333	5,50	5,50	-

34	士	-12-31	-01-11	未上市	3	3		4.49	4.49	
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	创业板锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	创业板锁定	79.60	78.53	68	5,412.80	5,340.04	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	创业板锁定	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	创业板锁定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	创业板锁定	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	创业板锁定	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	创业板锁定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	创业板锁定	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	创业板锁定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
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（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注

1130 52	兴业 转债	2021 -12- 29	2022 -01- 14	新债 未上 市	100. 00	100. 00	2,070	207, 000. 00	207, 000. 00	-
1103 52	兴业 转债	2021 -12- 28	2022 -01- 14	新债 未上 市	100. 00	100. 00	2,400	240, 000. 00	240, 000. 00	-

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。

#### 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银行间市场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

截至本报告期末2021年12月31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2,000,000.00元，截至2022年1月4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。

#### 7.4.12.4 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。

#### 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

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

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

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	17,476,272.50	120,313,585.50

合计	17,476,272.50	120,313,585.50
----	---------------	----------------

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为国债。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	447,000.00	-
AAA以下	-	999.30
未评级	70,973.00	101,384.00
合计	517,973.00	102,383.30

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为国债、政策性金融债。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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上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2021年12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有2,000,000.00元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同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，因此账面余额约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上市公司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 2021年1 2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	10,774,580.53	-	-	-	10,774,580.53
结算备付金	34,942,960.98	-	-	-	34,942,960.98
存出保证金	36,778.16	-	-	-	36,778.16
交易性金融资产	17,486,315.50	60,930.00	447,000.00	163,671,050.20	181,665,295.70
应收利息	-	-	-	359,615.58	359,615.58
应收申购款	-	-	-	2,001,420.27	2,001,420.27
资产总计	63,240,635.17	60,930.00	447,000.00	166,032,086.05	229,780,651.22
负债					
卖出回	2,000,000.00	-	-	-	2,000,000.00

购金融资产款					
应付证券清算款	-	-	-	2,034,719.82	2,034,719.82
应付管理人报酬	-	-	-	283,828.10	283,828.10
应付托管费	-	-	-	47,304.68	47,304.68
应付销售服务费	-	-	-	31,227.14	31,227.14
应付交易费用	-	-	-	117,998.10	117,998.10
应付利息	-	-	-	-2,258.22	-2,258.22
其他负债	-	-	-	220,000.00	220,000.00
负债总计	2,000,000.00	-	-	2,732,819.62	4,732,819.62
利率敏感度缺口	61,240,635.17	60,930.00	447,000.00	163,299,266.43	225,047,831.60
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：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

假设	除市场利率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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	1. 市场利率下降25个基点	13,928.81	19,164.79
	2. 市场利率上升25个基点	-13,796.33	-19,094.76

#### 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总资产的0%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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。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 2021年12月31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	163,671,050.20	72.73	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				
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	163,671,050.20	72.73	174,078,374.96	56.43

#### 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	6,971,932.51	9,897,397.23
	业绩比较基准下降5%	-6,971,932.51	-9,897,397.23

#### 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2021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154,915,340.83元，属于第二层次的余额为23,188,971.17元，属于第三层次的余额为3,560,983.70元（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

于2021年12月31日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具3,560,983.70元(2020年12月31日：无)。本基金本年度购买第三层次的金融工具2,547,768.40元(2020年度：无)，计入损益的第三层次的金融工具公允价值变动1,013,215.30元(2020年度：无)。

于2021年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产(均为股票投资)公允价值为3,560,983.70元，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系(2020年12月31日：无)。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021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(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) 根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021年的比较数据将不作重述。

(3)除公允价值和执行新金融工具准则外，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	163,671,050.20	71.23
	其中：股票	163,671,050.20	71.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,994,245.50	7.83
	其中：债券	17,994,245.50	7.83
	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	45,717,541.51	19.90
8	其他各项资产	2,397,814.01	1.04
9	合计	229,780,651.22	100.00

## 8.2 报告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

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	1,274,508.34	0.57
B	采矿业	12,538,888.02	5.57
C	制造业	77,620,861.67	34.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,937,886.75	4.86
E	建筑业	1,877,810.38	0.83
F	批发和零售业	966,094.07	0.43
G	交通运输、仓储和邮政业	3,672,545.91	1.63
H	住宿和餐饮业	6,598.56	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,373,134.36	5.05



J	金融业	33,018,470.83	14.67
K	房地产业	3,778,023.47	1.68
L	租赁和商务服务业	1,955,461.22	0.87
M	科学研究和技术服务业	2,092,583.99	0.93
N	水利、环境和公共设施管理业	53,964.69	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	174,814.26	0.08
Q	卫生和社会工作	1,703,910.02	0.76
R	文化、体育和娱乐业	625,493.66	0.28
S	综合	-	-
	合计	163,671,050.20	72.73

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	4,045	8,292,250.00	3.68
2	002142	宁波银行	169,025	6,470,277.00	2.88
3	600941	中国移动	87,362	5,030,303.96	2.24
4	601318	中国平安	74,876	3,774,499.16	1.68
5	600036	招商银行	70,111	3,415,106.81	1.52
6	000858	五粮液	14,221	3,166,447.86	1.41
7	300750	宁德时代	5,174	3,042,312.00	1.35
8	600905	三峡能源	378,810	2,844,863.10	1.26
9	000333	美的集团	31,733	2,342,212.73	1.04
10	300059	东方财富	58,699	2,178,319.89	0.97
11	601166	兴业银行	99,904	1,902,172.16	0.85
12	000651	格力电器	50,986	1,888,011.58	0.84

13	000001	平安银行	110,122	1,814,810.56	0.81
14	601728	中国电信	420,573	1,797,440.43	0.80
15	600276	恒瑞医药	33,468	1,697,162.28	0.75
16	601088	中国神华	71,498	1,610,134.96	0.72
17	600188	兖州煤业	67,159	1,580,251.27	0.70
18	600048	保利地产	99,608	1,556,873.04	0.69
19	601225	陕西煤业	127,612	1,556,866.40	0.69
20	002475	立讯精密	30,995	1,524,954.00	0.68
21	600900	长江电力	64,344	1,460,608.80	0.65
22	600887	伊利股份	34,405	1,426,431.30	0.63
23	000983	山西焦煤	172,074	1,423,051.98	0.63
24	603259	药明康德	11,753	1,393,670.74	0.62
25	600795	国电电力	434,412	1,377,086.04	0.61
26	601888	中国中免	6,247	1,370,654.27	0.61
27	600089	特变电工	63,574	1,345,861.58	0.60
28	600123	兰花科创	140,210	1,313,767.70	0.58
29	601012	隆基股份	15,080	1,299,896.00	0.58
30	600030	中信证券	45,306	1,196,531.46	0.53
31	000725	京东方 A	233,254	1,177,932.70	0.52
32	000767	晋控电力	308,000	1,158,080.00	0.51
33	002415	海康威视	21,769	1,138,954.08	0.51
34	603501	韦尔股份	3,625	1,126,541.25	0.50
35	601919	中远海控	60,015	1,121,680.35	0.50
36	000400	许继电气	42,524	1,109,876.40	0.49
37	600011	华能国际	108,334	1,049,756.46	0.47
38	000568	泸州老窖	4,060	1,030,712.20	0.46
39	601985	中国核电	123,242	1,022,908.60	0.45
40	002594	比亚迪	3,574	958,260.88	0.43
41	601857	中国石油	194,226	953,649.66	0.42
42	000002	万科 A	47,543	939,449.68	0.42
43	300015	爱尔眼科	21,389	904,326.92	0.40

44	600809	山西汾酒	2,827	892,710.06	0.40
45	600406	国电南瑞	21,321	853,479.63	0.38
46	600309	万华化学	8,392	847,592.00	0.38
47	600031	三一重工	36,968	842,870.40	0.37
48	603288	海天味业	7,876	827,846.36	0.37
49	002714	牧原股份	14,600	779,056.00	0.35
50	600436	片仔癀	1,767	772,444.05	0.34
51	002092	中泰化学	80,700	769,878.00	0.34
52	601328	交通银行	164,298	757,413.78	0.34
53	601666	平煤股份	86,206	721,544.22	0.32
54	002352	顺丰控股	10,444	719,800.48	0.32
55	600863	内蒙华电	180,000	709,200.00	0.32
56	002241	歌尔股份	12,929	699,458.90	0.31
57	001979	招商蛇口	51,673	689,317.82	0.31
58	300122	智飞生物	5,446	678,571.60	0.30
59	300124	汇川技术	9,851	675,778.60	0.30
60	002271	东方雨虹	12,378	652,073.04	0.29
61	600690	海尔智家	21,705	648,762.45	0.29
62	603986	兆易创新	3,648	641,500.80	0.29
63	601899	紫金矿业	65,797	638,230.90	0.28
64	600837	海通证券	51,551	632,015.26	0.28
65	600028	中国石化	147,718	624,847.14	0.28
66	002230	科大讯飞	11,749	616,939.99	0.27
67	600027	华电国际	115,085	615,704.75	0.27
68	300014	亿纬锂能	5,135	606,854.30	0.27
69	002304	洋河股份	3,672	604,888.56	0.27
70	603799	华友钴业	5,479	604,388.49	0.27
71	600000	浦发银行	69,367	591,700.51	0.26
72	600348	华阳股份	49,916	591,504.60	0.26
73	002027	分众传媒	71,405	584,806.95	0.26
74	601816	京沪高铁	119,797	578,619.51	0.26

75	000661	长春高新	2,107	571,839.80	0.25
76	601668	中国建筑	112,338	561,690.00	0.25
77	600585	海螺水泥	13,928	561,298.40	0.25
78	002812	恩捷股份	2,227	557,640.80	0.25
79	000063	中兴通讯	16,638	557,373.00	0.25
80	688111	金山办公	2,100	556,500.00	0.25
81	000100	TCL科技	89,123	549,888.91	0.24
82	600958	东方证券	35,713	526,409.62	0.23
83	600703	三安光电	13,598	510,740.88	0.23
84	601688	华泰证券	28,653	508,877.28	0.23
85	600016	民生银行	127,490	497,211.00	0.22
86	601601	中国太保	18,246	494,831.52	0.22
87	000338	潍柴动力	26,827	479,935.03	0.21
88	601288	农业银行	157,595	463,329.30	0.21
89	600196	复星医药	9,459	462,923.46	0.21
90	300142	沃森生物	8,231	462,582.20	0.21
91	600438	通威股份	10,000	449,600.00	0.20
92	600919	江苏银行	74,837	436,299.71	0.19
93	002460	赣锋锂业	3,024	431,978.40	0.19
94	688187	时代电气	5,515	428,074.75	0.19
95	300347	泰格医药	3,322	424,551.60	0.19
96	600691	阳煤化工	81,651	418,053.12	0.19
97	002459	晶澳科技	4,500	417,150.00	0.19
98	601229	上海银行	58,494	417,062.22	0.19
99	600570	恒生电子	6,686	415,534.90	0.18
100	002311	海大集团	5,661	414,951.30	0.18
101	600050	中国联通	105,432	414,347.76	0.18
102	601211	国泰君安	22,907	409,806.23	0.18
103	600104	上汽集团	19,667	405,730.21	0.18
104	300498	温氏股份	20,920	402,919.20	0.18
105	600763	通策医疗	2,021	402,179.00	0.18

106	600075	新疆天业	48,617	399,631.74	0.18
107	601800	中国交建	46,538	399,296.04	0.18
108	601766	中国中车	65,542	399,150.78	0.18
109	601001	晋控煤业	40,655	390,694.55	0.17
110	600256	广汇能源	58,960	385,598.40	0.17
111	600745	闻泰科技	2,951	381,564.30	0.17
112	002049	紫光国微	1,691	380,475.00	0.17
113	600999	招商证券	21,316	376,227.40	0.17
114	600660	福耀玻璃	7,971	375,752.94	0.17
115	300413	芒果超媒	6,425	367,638.50	0.16
116	000538	云南白药	3,494	365,647.10	0.16
117	600019	宝钢股份	50,519	361,716.04	0.16
118	002371	北方华创	1,029	357,083.58	0.16
119	002129	中环股份	8,470	353,622.50	0.16
120	600132	重庆啤酒	2,310	349,549.20	0.16
121	300316	晶盛机电	5,000	347,500.00	0.15
122	002353	杰瑞股份	8,638	345,520.00	0.15
123	002709	天赐材料	3,000	343,950.00	0.15
124	601988	中国银行	112,510	343,155.50	0.15
125	002821	凯莱英	769	334,515.00	0.15
126	600588	用友网络	9,250	331,890.00	0.15
127	600989	宝丰能源	19,018	330,152.48	0.15
128	601818	光大银行	95,691	317,694.12	0.14
129	688036	传音控股	2,020	316,938.00	0.14
130	601390	中国中铁	53,767	311,310.93	0.14
131	600893	航发动力	4,876	309,430.96	0.14
132	688008	澜起科技	3,678	308,473.86	0.14
133	300450	先导智能	4,144	308,189.28	0.14
134	601658	邮储银行	60,000	306,000.00	0.14
135	002456	欧菲光	30,595	296,771.50	0.13
136	002410	广联达	4,613	295,139.74	0.13

137	601600	中国铝业	48,272	293,976.48	0.13
138	601628	中国人寿	9,471	284,982.39	0.13
139	300601	康泰生物	2,855	281,331.70	0.13
140	600346	恒力石化	12,182	279,820.54	0.12
141	000776	广发证券	11,345	278,973.55	0.12
142	002493	荣盛石化	15,242	276,794.72	0.12
143	000786	北新建材	7,626	273,239.58	0.12
144	601377	兴业证券	27,506	271,759.28	0.12
145	002001	新 和 成	8,732	271,739.84	0.12
146	000895	双汇发展	8,606	271,519.30	0.12
147	300433	蓝思科技	11,763	270,313.74	0.12
148	601009	南京银行	30,086	269,570.56	0.12
149	300408	三环集团	5,909	263,541.40	0.12
150	600584	长电科技	8,361	259,358.22	0.12
151	000963	华东医药	6,322	254,144.40	0.11
152	000625	长安汽车	16,724	254,037.56	0.11
153	601128	常熟银行	37,973	251,001.53	0.11
154	688012	中微公司	1,957	247,756.20	0.11
155	002179	中航光电	2,462	247,578.72	0.11
156	600426	华鲁恒升	7,896	247,144.80	0.11
157	002841	视源股份	2,998	244,037.20	0.11
158	600085	同仁堂	5,408	243,251.84	0.11
159	300888	稳健医疗	2,948	243,062.60	0.11
160	601100	恒立液压	2,935	240,083.00	0.11
161	601939	建设银行	39,976	234,259.36	0.10
162	002050	三花智控	9,213	233,088.90	0.10
163	600029	南方航空	34,088	232,139.28	0.10
164	603882	金域医学	2,083	231,983.71	0.10
165	000166	申万宏源	45,111	230,968.32	0.10
166	002601	龙佰集团	8,046	230,035.14	0.10
167	300595	欧普康视	3,984	228,562.08	0.10

168	600600	青岛啤酒	2,275	225,225.00	0.10
169	000768	中航西飞	6,122	223,453.00	0.10
170	002007	华兰生物	7,638	222,571.32	0.10
171	600547	山东黄金	11,822	222,490.04	0.10
172	600009	上海机场	4,751	221,824.19	0.10
173	603511	爱慕股份	9,315	220,951.80	0.10
174	002008	大族激光	4,091	220,914.00	0.10
175	600741	华域汽车	7,765	219,749.50	0.10
176	688711	宏微科技	1,865	217,309.80	0.10
177	600875	东方电气	10,000	214,200.00	0.10
178	002555	三七互娱	7,887	213,106.74	0.09
179	002236	大华股份	9,038	212,212.24	0.09
180	600143	金发科技	16,863	212,136.54	0.09
181	601006	大秦铁路	32,754	209,625.60	0.09
182	603369	今世缘	3,828	208,243.20	0.09
183	600926	杭州银行	16,073	206,055.86	0.09
184	688776	国光电气	1,109	205,153.91	0.09
185	601138	工业富联	17,124	204,118.08	0.09
186	601989	中国重工	47,832	201,851.04	0.09
187	600015	华夏银行	35,869	200,866.40	0.09
188	601633	长城汽车	4,094	198,722.76	0.09
189	600111	北方稀土	4,322	197,947.60	0.09
190	600176	中国巨石	10,689	194,539.80	0.09
191	002384	东山精密	7,092	192,193.20	0.09
192	000157	中联重科	26,630	190,937.10	0.08
193	601179	中国西电	34,345	190,614.75	0.08
194	603806	福斯特	1,460	190,603.00	0.08
195	601186	中国铁建	24,215	188,877.00	0.08
196	601901	方正证券	23,933	187,634.72	0.08
197	300529	健帆生物	3,508	186,976.40	0.08
198	002624	完美世界	9,205	186,953.55	0.08

199	300003	乐普医疗	8,248	186,652.24	0.08
200	600352	浙江龙盛	14,740	186,166.20	0.08
201	601336	新华保险	4,783	185,963.04	0.08
202	000969	安泰科技	17,356	185,882.76	0.08
203	000876	新希望	12,058	183,402.18	0.08
204	000069	华侨城A	25,987	182,948.48	0.08
205	601916	浙商银行	50,403	176,410.50	0.08
206	003816	中国广核	56,260	176,093.80	0.08
207	002607	中公教育	22,241	174,814.26	0.08
208	600010	包钢股份	62,434	174,190.86	0.08
209	002736	国信证券	15,172	174,174.56	0.08
210	000977	浪潮信息	4,739	169,798.37	0.08
211	603993	洛阳钼业	30,254	168,817.32	0.08
212	603899	晨光文具	2,607	168,177.57	0.07
213	002938	鹏鼎控股	3,961	168,065.23	0.07
214	600760	中航沈飞	2,470	168,058.80	0.07
215	600150	中国船舶	6,774	167,927.46	0.07
216	601877	正泰电器	3,107	167,436.23	0.07
217	601066	中信建投	5,699	166,695.75	0.07
218	688396	华润微	2,570	166,022.00	0.07
219	601788	光大证券	11,048	164,946.64	0.07
220	603833	欧派家居	1,118	164,905.00	0.07
221	688169	石头科技	200	162,600.00	0.07
222	600109	国金证券	14,343	162,506.19	0.07
223	000596	古井贡酒	663	161,772.00	0.07
224	603666	亿嘉和	2,149	161,432.88	0.07
225	000425	徐工机械	26,570	159,154.30	0.07
226	601669	中国电建	19,635	158,650.80	0.07
227	600079	人福医药	7,039	158,518.28	0.07
228	688305	科德数控	1,496	158,097.28	0.07
229	603517	绝味食品	2,313	158,047.29	0.07



230	601155	新城控股	5,396	157,185.48	0.07
231	002463	沪电股份	9,410	156,017.80	0.07
232	603019	中科曙光	5,646	155,660.22	0.07
233	002916	深南电路	1,277	155,564.14	0.07
234	600312	平高电气	17,091	155,357.19	0.07
235	002202	金风科技	9,432	155,345.04	0.07
236	600332	白云山	4,536	155,131.20	0.07
237	300033	同花顺	1,071	154,845.18	0.07
238	000783	长江证券	20,466	154,313.64	0.07
239	300136	信维通信	6,068	153,641.76	0.07
240	600886	国投电力	13,259	152,080.73	0.07
241	600383	金地集团	11,719	151,995.43	0.07
242	605090	九丰能源	4,317	151,828.89	0.07
243	600497	驰宏锌锗	30,000	149,700.00	0.07
244	603160	汇顶科技	1,378	148,507.06	0.07
245	601111	中国国航	16,198	147,887.74	0.07
246	002600	领益智造	19,911	146,544.96	0.07
247	600872	中炬高新	3,859	146,526.23	0.07
248	601799	星宇股份	716	146,243.00	0.06
249	002044	美年健康	18,529	145,452.65	0.06
250	600183	生益科技	6,137	144,526.35	0.06
251	300677	英科医疗	2,494	144,252.96	0.06
252	002252	上海莱士	21,142	144,188.44	0.06
253	000938	紫光股份	6,302	144,000.70	0.06
254	300144	宋城演艺	9,949	142,469.68	0.06
255	300999	金龙鱼	2,246	141,340.78	0.06
256	601607	上海医药	7,044	139,964.28	0.06
257	601108	财通证券	12,572	139,800.64	0.06
258	000066	中国长城	9,836	139,277.76	0.06
259	002602	世纪华通	16,568	139,005.52	0.06
260	002414	高德红外	5,655	136,907.55	0.06

261	601838	成都银行	11,307	135,684.00	0.06
262	600718	东软集团	10,000	135,600.00	0.06
263	002508	老板电器	3,764	135,579.28	0.06
264	000703	恒逸石化	12,678	134,640.36	0.06
265	603659	璞泰来	831	133,466.91	0.06
266	600115	东方航空	25,670	132,457.20	0.06
267	601077	渝农商行	34,271	131,943.35	0.06
268	300676	华大基因	1,446	126,958.80	0.06
269	601238	广汽集团	8,352	126,866.88	0.06
270	300558	贝达药业	1,572	125,492.76	0.06
271	600161	天坛生物	4,317	125,020.32	0.06
272	688363	华熙生物	800	124,240.00	0.06
273	600487	亨通光电	8,088	122,290.56	0.05
274	300628	亿联网络	1,501	122,256.45	0.05
275	603939	益丰药房	2,153	118,651.83	0.05
276	000708	中信特钢	5,750	117,760.00	0.05
277	600845	宝信软件	1,851	112,596.33	0.05
278	601878	浙商证券	8,533	112,464.94	0.05
279	601162	天风证券	27,564	111,634.20	0.05
280	600061	国投资本	13,531	111,224.82	0.05
281	600362	江西铜业	4,976	111,114.08	0.05
282	601021	春秋航空	1,946	110,532.80	0.05
283	601618	中国中冶	28,574	109,438.42	0.05
284	002558	巨人网络	9,054	108,376.38	0.05
285	600606	绿地控股	24,895	108,044.30	0.05
286	688009	中国通号	21,005	104,604.90	0.05
287	603392	万泰生物	469	103,883.50	0.05
288	688100	威胜信息	3,000	103,290.00	0.05
289	601933	永辉超市	25,386	102,813.30	0.05
290	600655	豫园股份	9,831	101,259.30	0.04
291	002024	苏宁易购	24,462	100,783.44	0.04

292	600452	涪陵电力	5,000	100,700.00	0.04
293	600848	上海临港	6,742	100,253.54	0.04
294	601990	南京证券	10,081	99,902.71	0.04
295	688676	金盘科技	3,000	97,950.00	0.04
296	600118	中国卫星	3,532	95,893.80	0.04
297	601216	君正集团	17,824	93,219.52	0.04
298	002157	正邦科技	9,579	92,533.14	0.04
299	603195	公牛集团	548	91,680.40	0.04
300	600489	中金黄金	11,056	90,990.88	0.04
301	002120	韵达股份	4,310	88,182.60	0.04
302	688126	沪硅产业	3,397	87,710.54	0.04
303	688262	国芯科技	2,083	87,444.34	0.04
304	002739	万达电影	5,615	86,920.20	0.04
305	601995	中金公司	1,762	86,390.86	0.04
306	301118	恒光股份	1,442	85,371.65	0.04
307	601696	中银证券	6,301	84,748.45	0.04
308	600018	上港集团	15,342	84,074.16	0.04
309	601998	中信银行	18,050	83,391.00	0.04
310	601881	中国银河	7,362	82,380.78	0.04
311	688786	悦安新材	1,513	81,717.13	0.04
312	603338	浙江鼎力	1,012	81,223.12	0.04
313	002673	西部证券	9,955	80,336.85	0.04
314	688599	天合光能	1,000	78,900.00	0.04
315	002032	苏泊尔	1,224	76,181.76	0.03
316	601898	中煤能源	11,700	73,593.00	0.03
317	688210	统联精密	1,848	73,051.44	0.03
318	301136	招标股份	6,794	71,472.88	0.03
319	601319	中国人保	15,122	71,073.40	0.03
320	603658	安图生物	1,289	70,972.34	0.03
321	000027	深圳能源	8,593	69,603.30	0.03
322	601231	环旭电子	4,276	68,672.56	0.03

323	603233	大参林	1,570	66,112.70	0.03
324	600482	中国动力	3,231	63,650.70	0.03
325	601236	红塔证券	4,685	55,845.20	0.02
326	000800	一汽解放	4,822	49,618.38	0.02
327	600025	华能水电	7,492	49,372.28	0.02
328	600918	中泰证券	4,611	45,971.67	0.02
329	301029	怡合达	499	44,928.38	0.02
330	601808	中海油服	2,877	43,155.00	0.02
331	601698	中国卫通	2,567	36,939.13	0.02
332	603087	甘李药业	518	36,436.12	0.02
333	603071	物产环能	1,378	34,808.28	0.02
334	301155	海力风电	299	30,488.80	0.01
335	301050	雷电微力	120	28,168.80	0.01
336	300982	苏文电能	370	27,228.30	0.01
337	301058	中粮工科	1,460	26,729.56	0.01
338	301069	凯盛新材	586	26,121.38	0.01
339	001317	三羊马	300	25,722.00	0.01
340	300994	久祺股份	495	22,660.50	0.01
341	301018	C申菱	811	21,146.84	0.01
342	301149	隆华新材	1,238	20,855.44	0.01
343	301035	润丰股份	365	20,590.36	0.01
344	301082	久盛电气	944	20,421.18	0.01
345	301060	兰卫医学	639	19,967.74	0.01
346	301089	拓新药业	270	18,964.60	0.01
347	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
348	301039	N中集	1,416	17,737.84	0.01
349	301087	可孚医疗	230	17,567.39	0.01
350	301046	能辉科技	341	16,792.80	0.01
351	301166	优宁维	169	16,582.50	0.01
352	603216	梦天家居	654	16,539.66	0.01
353	301111	粤万年青	433	16,507.22	0.01

354	300614	百川畅银	341	16,368.00	0.01
355	603213	镇洋发展	687	15,910.92	0.01
356	301221	光庭信息	175	15,843.25	0.01
357	301211	亨迪药业	456	15,502.80	0.01
358	301101	明月镜片	338	15,195.66	0.01
359	301127	天源环保	857	14,671.84	0.01
360	301020	C密封	480	14,641.29	0.01
361	301026	浩通科技	227	14,268.03	0.01
362	301138	华研精机	295	13,725.10	0.01
363	301168	通灵股份	251	13,481.13	0.01
364	301126	达嘉维康	642	12,612.08	0.01
365	301021	C英诺	299	12,390.99	0.01
366	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.01
367	301091	深城交	387	12,229.17	0.01
368	301048	金鹰重工	924	12,032.55	0.01
369	301090	华润材料	1,062	12,006.54	0.01
370	301189	奥尼电子	203	11,738.66	0.01
371	301052	果麦文化	320	10,901.48	0.00
372	301028	东亚机械	799	10,804.32	0.00
373	300774	倍杰特	485	10,261.52	0.00
374	301030	仕净科技	317	10,052.59	0.00
375	301078	孩子王	801	9,926.19	0.00
376	301062	上海艾录	575	9,833.79	0.00
377	301182	凯旺科技	314	9,779.92	0.00
378	301179	泽宇智能	187	9,753.83	0.00
379	301055	张小泉	441	9,687.54	0.00
380	301012	扬电科技	191	9,672.24	0.00
381	301100	风光股份	305	9,639.54	0.00
382	301198	喜悦智行	313	9,547.09	0.00
383	300814	中富电路	380	9,119.12	0.00
384	301025	读客文化	427	8,937.84	0.00

385	605577	龙版传媒	588	8,625.96	0.00
386	301093	华兰股份	171	8,578.40	0.00
387	301098	金埔园林	369	8,560.79	0.00
388	301088	戎美股份	340	8,435.77	0.00
389	301092	争光股份	232	8,421.59	0.00
390	301190	善水科技	303	8,380.66	0.00
391	301033	迈普医学	138	8,310.36	0.00
392	301063	海锅股份	224	8,308.03	0.00
393	301193	家联科技	275	8,086.67	0.00
394	301096	百诚医药	98	7,917.34	0.00
395	301108	洁雅股份	142	7,833.54	0.00
396	301199	迈赫股份	234	7,614.00	0.00
397	301036	双乐股份	247	7,419.59	0.00
398	301041	金百泽	250	7,107.10	0.00
399	301056	森赫股份	616	6,850.80	0.00
400	301072	中捷精工	202	6,846.26	0.00
401	301083	百胜智能	460	6,667.72	0.00
402	301073	君亭酒店	202	6,598.56	0.00
403	301032	新柴股份	524	6,558.54	0.00
404	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
405	301038	深水规院	310	6,304.30	0.00
406	301053	远信工业	214	6,225.00	0.00
407	300854	中兰环保	226	6,211.01	0.00
408	301059	金三江	311	6,069.38	0.00
409	301068	大地海洋	206	5,985.78	0.00
410	301027	华蓝集团	356	5,956.80	0.00
411	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
412	301037	保立佳	223	5,436.08	0.00
413	301079	邵阳液压	196	5,252.80	0.00
414	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
415	688296	和达科技	73	3,708.40	0.00

416	688226	威腾电气	93	1,477.77	0.00
-----	--------	------	----	----------	------

#### 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	002142	宁波银行	13,406,400.93	4.35
2	000001	平安银行	11,800,900.00	3.83
3	600519	贵州茅台	10,047,233.55	3.26
4	601318	中国平安	8,909,786.99	2.89
5	600036	招商银行	6,548,142.00	2.12
6	000858	五粮液	6,097,773.62	1.98
7	600941	中国移动	5,030,303.96	1.63
8	601012	隆基股份	4,936,646.48	1.60
9	000333	美的集团	4,899,476.00	1.59
10	300750	宁德时代	4,729,531.00	1.53
11	600276	恒瑞医药	4,489,853.20	1.46
12	601888	中国中免	4,242,100.09	1.38
13	601166	兴业银行	4,102,073.00	1.33
14	002594	比亚迪	3,805,350.00	1.23
15	300059	东方财富	3,787,995.46	1.23
16	000651	格力电器	3,743,189.00	1.21
17	603259	药明康德	3,735,733.10	1.21
18	600031	三一重工	3,200,686.16	1.04
19	002475	立讯精密	3,172,261.00	1.03
20	002714	牧原股份	3,104,947.74	1.01

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	000001	平安银行	20,615,816.20	6.68
2	002142	宁波银行	19,307,383.89	6.26
3	601318	中国平安	12,280,334.84	3.98
4	600519	贵州茅台	9,983,442.03	3.24
5	600036	招商银行	8,784,593.59	2.85
6	000333	美的集团	6,804,834.80	2.21
7	000858	五粮液	6,023,501.45	1.95
8	601012	隆基股份	5,740,502.27	1.86
9	600276	恒瑞医药	4,821,004.97	1.56
10	002594	比亚迪	4,685,995.02	1.52
11	600905	三峡能源	4,258,898.08	1.38
12	600031	三一重工	3,944,216.92	1.28
13	601888	中国中免	3,769,999.27	1.22
14	002415	海康威视	3,572,555.75	1.16
15	300059	东方财富	3,444,859.25	1.12
16	600887	伊利股份	3,392,028.39	1.10
17	000651	格力电器	3,233,598.19	1.05
18	601899	紫金矿业	3,029,591.75	0.98
19	601939	建设银行	3,018,343.49	0.98
20	000002	万科A	2,827,178.12	0.92

#### 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	366,204,983.44
卖出股票收入（成交）总额	397,409,813.00

#### 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	17,537,202.50	7.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,043.00	0.00
	其中：政策性金融债	10,043.00	0.00
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)	447,000.00	0.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	17,994,245.50	8.00

#### 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	019649	21国债01	96,910	9,692,938.20	4.31
2	019654	21国债06	77,810	7,783,334.30	3.46
3	113052	兴业转债	4,470	447,000.00	0.20
4	010303	03国债(3)	600	60,930.00	0.03
5	018006	国开1702	100	10,043.00	0.00

#### 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

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					112,342.13
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，根据风险管理的原则，本基金以套保为目的，通过阶段性投资少量流动性较好的股指期货空单对冲部分系统性风险。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期，本基金未投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期内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 本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

### 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	36,778.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	359,615.58

5	应收申购款	2,001,420.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,397,814.01

#### 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

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	600941	中国移动	5,030,303.96	2.24	新股未上市

### § 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

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	477	58,216.33	23,493,633.88	84.60%	4,275,554.33	15.40%
中科沃土沃鑫	27	4,968,451.60	134,094,186.69	99.96%	54,006.60	0.04%

成长混合发起C						
合计	504	321,264.65	157,587,820.57	97.33%	4,329,560.93	2.67%

### 9.2 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	846,881.54	3.05%
	中科沃土沃鑫成长混合发起C	17.26	0.00%
	合计	846,898.80	0.52%

### 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中科沃土沃鑫成长混合发起A	0~10
	中科沃土沃鑫成长混合发起C	0
	合计	0~10
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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	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	21,662,415.14	346,714,118.55
减:本报告期基金总赎回份额	130,762,911.53	315,308,265.67
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	27,769,188.21	134,148,193.29

本基C类份额于本报告期间成立,合同生效日为2020年6月29日,生效当日份额为0。

## § 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2021年公司高级管理人员任免情况具体如下:2021年5月21日起,智会杰先生担任公司总经理,于建伟先生离任公司总经理职务转任公司副董事长。2021年8月5日,林青先生担任公司副总经理职务。以上事项均于发布公告。

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。

### 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50,000.00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

本报告期末，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的监管措施，公司按照监管要求积极整改。本报告期内，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。

### 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	
安信证券	1	161,899,407.10	21.97%	118,397.58	21.97%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	37,648,461.18	5.11%	27,532.28	5.11%	-
东莞证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	361,782,044.29	49.09%	264,571.54	49.09%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	91,474,062.17	12.41%	66,894.89	12.41%	-
国信	2	-	-	-	-	-

证券						
恒泰 证券	2	-	-	-	-	-
华泰 证券	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
万联 证券	2	-	-	-	-	-
兴业 证券	2	84,133,990.80	11.42%	61,527.48	11.42%	-
银河 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投	2	-	-	-	-	-

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	1,205,400,000.00	36.30%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	1,057.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	38,716,194.61	100.00%	2,115,500,000.00	63.70%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证	-	-	-	-	-	-	-	-



券								
银河证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金2021年第一季度报告	公司网站、中国证券报	2021-04-21
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2021年第二季度报告	公司网站、中国证券报	2021-07-20
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2021年中期报告	公司网站、中国证券报	2021-08-31
4	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年第三季度报告	公司网站、中国证券报	2021-10-27

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210412-20210414 和 20210421-20210726	-	39,027,473.15	39,027,473.15	0.00	0.00%
	2	20210816-20211018 20 和 211027-20211231	-	44,052,844.89	7,750,000.00	36,302,844.89	22.42%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持							

有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理。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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 13.3 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  
二〇二二年三月三十一日