

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

2022 年中期报告

2022 年 06 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: 2022 年 08 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。本中期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8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日至2022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	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	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
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	12
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	51
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66
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	67
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	67
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	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	67
§8 基金份额持有人信息	68

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
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情况	69
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	70
§9 开放式基金份额变动	70
§10 重大事件揭示	70
10.1 基金份额持有人大会决议	70
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	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
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	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
10.8 其他重大事件	73
§11 影响投资者决策的其他重要信息	74
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	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§12 备查文件目录	74
12.1 备查文件目录	74
12.2 存放地点	74
12.3 查阅方式	75

§ 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	136,673,061.70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	11,916,957.63份	124,756,104.07份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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。</p>
投资策略	<p>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</p>

	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	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日-2022年06月30日)	
	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	-621,229.68	-2,795,341.98
本期利润	-2,356,057.86	-10,970,804.28
加权平均基金份额本期利润	-0.1101	-0.0766
本期加权平均净值利润率	-8.43%	-5.95%
本期基金份额净值增长率	-4.74%	-4.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	3,977,633.97	39,889,294.99
期末可供分配基金份额利润	0.3338	0.3197
期末基金资产净值	15,894,591.60	164,645,399.06
期末基金份额净值	1.3338	1.3197
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	33.38%	27.18%

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	5.01%	0.86%	4.54%	0.53%	0.47%	0.33%
过去三个月	3.89%	1.04%	3.47%	0.72%	0.42%	0.32%
过去六个月	-4.74%	1.01%	-4.02%	0.73%	-0.72%	0.28%
过去一年	-2.98%	0.87%	-5.77%	0.63%	2.79%	0.24%
过去三年	54.61%	0.97%	12.64%	0.63%	41.97%	0.34%
自基金合同生效起至今	33.38%	1.00%	20.57%	0.60%	12.81%	0.40%

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	4.94%	0.86%	4.54%	0.53%	0.40%	0.33%
过去三个月	3.80%	1.04%	3.47%	0.72%	0.33%	0.32%
过去六个月	-4.91%	1.01%	-4.02%	0.73%	-0.89%	0.28%
过去一年	-3.64%	0.87%	-5.77%	0.63%	2.13%	0.24%
自基金合同生效起至今	27.18%	0.89%	6.93%	0.64%	20.25%	0.25%

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-2022年06月30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-2022年06月30日)



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”的首要经营原则，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2022年6月30日，中科沃土旗下共管理6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和中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金。

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	2019-08-09	-	11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。

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

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

2022年二季度初，国内部分经济发达地区的防疫形势较严峻，对经济的影响不仅局限在服务业，也开始波及到制造业。5月之后全国生产生活开始恢复正常，同时国家稳经济的一揽子措施加快落地，财政政策加大实施力度，主要经济指标有了边际改善。但因为居民部门对未来收入的预期偏悲观，导致二季度的消费增长还是受到较大抑制。投资方面受到房地产投资下滑的拖累，整体上也不乐观。受益于能源等方面的成本比较优势，5、6月外贸出口增长强劲，成为目前拉动经济增长最重要的积极因素。

2022年上半年，海外发达经济体因为大宗商品、食品与工资的大幅度上涨导致CPI持续高企，导致欧美货币政策收紧力度持续加强，美联储在6、7月份连续加息75个基点，加息速度加快，抑制了海外总需求的增长，市场开始预期海外发达经济体2023年开始衰退，与此同时我们也观察到了海外的能源消费已经出现了负反馈的现象，上述因素导致了以原油为代表的大宗商品价格开始出现大幅度下跌。

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成长混合发起A基金份额净值为1.3338元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.74%，同期业绩比较基准收益率为-4.02%；截至报告期末

中科沃土沃鑫成长混合发起C基金份额净值为1.3197元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.91%，同期业绩比较基准收益率为-4.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从2021年底开始，中央政府多次提出要加强稳增长的力度，在上半年经济运行受到疫情影响较大的背景下，我们预计财政政策将继续发力，充分发挥托底作用，基建作为稳定经济增长的关键抓手，投资力度将进一步加大，地方政府专项债也可能会进一步前置，我们也将密切关注这方面的边际变化。同时由于国内的能源及中间产品价格显著低于国外价格，中国的制造业相对竞争力进一步加强，从而提升中国在全球贸易中的份额，预计中国的外贸顺差还能维持较高的增速。但是下半年经济复苏的基础还不稳固，整体上看下半年经济运行仍然面临较大不确定性。

国内CPI在三季度虽然可能会因为猪肉价格上涨而出现同比上升的压力，但其他分项的涨幅会比较小；而得益于国内卓有成效的上游大宗商品保供措施（以煤炭为典型代表），预计国内下半年PPI的同比增速会下降比较快；因此我们认为国内在下半年仍然维持较为宽松的货币政策。信贷政策上，预计房地产信贷调控政策可能边际上有所放松，对实体经济发展的也会给予更大的支持。

国家继续稳步推进金融改革，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，我们在二季度的投资策略中，提高了股票仓位水平，行业配置较为均衡，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。在2022年下半年的投资策略中，我们将重点关注与宏观经济关系较小的成长性较好的行业与公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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。

基金日常估值由运营科技部具体执行，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。合规稽核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，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2022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：2022年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	10,309,979.10	10,774,580.53
结算备付金		2,698,671.43	34,942,960.98
存出保证金		3,236,064.00	36,778.16
交易性金融资产	6.4.7.2	168,078,802.34	181,665,295.70
其中：股票投资		164,918,150.03	163,671,050.20
基金投资		-	-
债券投资		3,160,652.31	17,994,245.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		2,760,588.43	-
应收股利		-	-
应收申购款		209.69	2,001,420.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	359,615.58
资产总计		187,084,314.99	229,780,651.22

负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021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		2,400,000.00	2,000,000.00
应付清算款		75,707.71	2,034,719.82
应付赎回款		3,554,141.35	-
应付管理人报酬		234,128.90	283,828.10
应付托管费		39,021.53	47,304.68
应付销售服务费		28,476.44	31,227.14
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.31	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	212,848.09	335,739.88
负债合计		6,544,324.33	4,732,819.62
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	136,673,061.70	161,917,381.50
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	43,866,928.96	63,130,450.10
净资产合计		180,539,990.66	225,047,831.60
负债和净资产总计		187,084,314.99	229,780,651.22

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额总额136,673,061.70份，其中A类基金份额净值1.3338元，A类基金份额11,916,957.63份；C类基金份额净值1.3197元，C类基金份额124,756,104.07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：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		-11,134,588.85	19,616,838.98
1. 利息收入		104,113.08	525,505.55
其中：存款利息收入	6.4.7.9	95,781.29	130,949.27
债券利息收入		-	394,556.28
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,331.79	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,341,392.90	33,440,664.61
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-3,862,564.83	32,465,407.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	180,796.96	-176,439.67
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	293,865.13	-
股利收益	6.4.7.15	2,046,509.84	1,151,697.15
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	-9,910,290.48	-14,516,844.32
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	6.4.7.17	12,981.45	167,513.14

号填列)			
减：二、营业总支出		2,192,273.29	3,186,461.42
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	1,588,127.43	1,803,410.27
2. 托管费	6.4.10.2. 2	264,687.92	300,568.41
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	183,736.83	146,042.65
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		66,475.21	189,770.68
其中：卖出回购金融资产支出		66,475.21	189,770.68
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		2,382.59	-
8. 其他费用	6.4.7.18	86,863.31	746,669.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,326,862.14	16,430,377.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,326,862.14	16,430,377.56
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-13,326,862.14	16,430,377.56

6.3 净资产（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：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收	未分配利润	净资产合计

		益		
一、上期期末净资产（基金净值）	161,917,381.50	-	63,130,450.10	225,047,831.60
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	161,917,381.50	-	63,130,450.10	225,047,831.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-25,244,319.80	-	-19,263,521.14	-44,507,840.94
（一）、综合收益总额	-	-	-13,326,862.14	-13,326,862.14
（二）、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）	-25,244,319.80	-	-5,936,659.00	-31,180,978.80
其中：1. 基金申购款	115,716,531.15	-	33,248,664.41	148,965,195.56
2. 基金赎回款	-140,960,850.95	-	-39,185,323.41	-180,146,174.36
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	136,673,061.70	-	43,866,928.96	180,539,990.66
项目	上年度可比期间			

	2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	239,612,025.01	-	68,862,896.76	308,474,921.77
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	239,612,025.01	-	68,862,896.76	308,474,921.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-61,865,937.57	-	-2,987,186.90	-64,853,124.47
（一）、综合收益总额	-	-	16,430,377.56	16,430,377.56
（二）、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
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产 产（基金净值）	177,746,087.44	-	65,875,709.86	243,621,797.30
----------------------	----------------	---	---------------	----------------

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”)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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中科沃土沃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》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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2022年6月30日的财务状况以及2022上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。除下述会计政策外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则（截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则）

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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。

本基金目前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。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未

来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

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（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率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投资收益。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投资收益。

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相关交易费用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。

原金融工具准则（截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则）

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

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

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

6.4.4.4 费用的确认和计量

以摊余成本计量的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。

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

财政部于2017年颁布了修订后的《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》及《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”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，财政部于2022年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》（财会[2022]14号），本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于2022年1月1日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为10,774,580.53元、34,942,960.98元、36,778.16元、359,615.58元和2,001,420.27元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为10,776,584.84元、34,949,473.31元、36,778.16元、0.00元和2,001,420.27元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为181,665,295.70元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为182,016,394.64元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和应付利息，金额分别为2,000,000.00元、2,034,719.82元、283,828.10元、47,304.68元、31,227.14元、117,998.10元和-2,258.22元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-应付利息，金额分别为1,997,741.78元、2,034,719.82元、283,828.10元、47,304.68元、31,227.14元、117,998.10元和0.00元。

于2021年12月31日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

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。

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 2022年06月30日
活期存款	10,309,979.10
等于：本金	10,309,450.20
加：应计利息	528.90
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
合计	10,309,979.10

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		173,576,076.48	-	164,918,150.03	-8,657,926.45
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,092,439.67	70,894.31	3,160,652.31	-2,681.67
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,092,439.67	70,894.31	3,160,652.31	-2,681.67
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		176,668,516.15	70,894.31	168,078,802.34	-8,660,608.12

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	25,320,000.00	-	-	-

股指期货	25,320,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	25,320,000.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2209	沪深300股指期货2 209合约	-20.00	-26,683,200.0 0	-1,363,200.00
合计				-1,363,200.00
减：可抵销 期货暂收 款				-1,363,200.00
净额				-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.03
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	28,545.50
其中：交易所市场	28,545.50

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	74,795.19
预提费用-信息披露费	109,507.37
合计	212,848.09

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 中科沃土沃鑫成长混合发起A

金额单位：人民币元

项目 (中科沃土沃鑫成长混合发起 A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	27,769,188.21	27,769,188.21
本期申购	67,373.75	67,373.75
本期赎回(以“-”号填列)	-15,919,604.33	-15,919,604.33
本期末	11,916,957.63	11,916,957.63

6.4.7.7.2 中科沃土沃鑫成长混合发起C

金额单位：人民币元

项目 (中科沃土沃鑫成长混合发起 C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	134,148,193.29	134,148,193.29
本期申购	115,649,157.40	115,649,157.40
本期赎回(以“-”号填列)	-125,041,246.62	-125,041,246.62
本期末	124,756,104.07	124,756,104.07

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 中科沃土沃鑫成长混合发起A

单位：人民币元

项目 (中科沃土沃鑫成长混	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

合发起A)			
本期期初	12,188,586.54	-1,075,210.64	11,113,375.90
本期利润	-621,229.68	-1,734,828.18	-2,356,057.86
本期基金份额交易产生的变动数	-6,519,892.10	1,740,208.03	-4,779,684.07
其中：基金申购款	28,231.53	-7,318.87	20,912.66
基金赎回款	-6,548,123.63	1,747,526.90	-4,800,596.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,047,464.76	-1,069,830.79	3,977,633.97

6.4.7.8.2 中科沃土沃鑫成长混合发起C

单位：人民币元

项目 (中科沃土沃鑫成长混合发起C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	57,328,549.93	-5,311,475.73	52,017,074.20
本期利润	-2,795,341.98	-8,175,462.30	-10,970,804.28
本期基金份额交易产生的变动数	-3,385,699.22	2,228,724.29	-1,156,974.93
其中：基金申购款	46,828,278.68	-13,600,526.93	33,227,751.75
基金赎回款	-50,213,977.90	15,829,251.22	-34,384,726.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	51,147,508.73	-11,258,213.74	39,889,294.99

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	28,773.39
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	66,657.13

其他	350.77
合计	95,781.29

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	87,451,351.08
减：卖出股票成本总额	91,056,019.94
减：交易费用	257,895.97
买卖股票差价收入	-3,862,564.83

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	146,979.31
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	33,817.65
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	180,796.96

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	42,142,945.01
减：卖出债券（债	41,276,206.02

转股及债券到期兑 付) 成本总额	
减: 应计利息总额	832,870.51
减: 交易费用	50.83
买卖债券差价收入	33,817.65

6.4.7.12 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 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
	2022年01月01日至2022年06月30日
期货投资	293,865.13

6.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,046,509.84
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	2,046,509.84

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-8,547,090.48

——股票投资	-8,583,889.90
——债券投资	36,799.42
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-1,363,200.00
——权证投资	-
——期货投资	-1,363,200.00
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	-9,910,290.48

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	12,981.45
合计	12,981.45

注：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。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06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	-
汇划手续费	2,560.75
合计	86,863.31

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，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作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

本报告期末不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：下述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。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期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。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期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。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

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 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,588,127.43	1,803,410.27
其中：支付销售机构的客户维护费	423,062.53	309,124.32

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	264,687.92	300,568.41

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。

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 2022年01月01日至2022年06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	中科沃土沃鑫成长混合发	合计

	A	起C	
中科沃土基金	0.00	25,754.78	25,754.78
合计	0.00	25,754.78	25,754.78
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06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	0.00	90,439.60	90,439.60
合计	0.00	90,439.60	90,439.60

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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

本报告期内及上年度可比期间本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06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	10,309,979.10	28,773.39	12,458,094.90	26,822.59

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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022年06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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

						价				
600941	中国移动	2021-12-24	6个月	新股锁定	57.58	60.26	61,154	3,521,247.32	3,685,140.04	-
600938	中国海油	2022-04-14	6个月	新股锁定	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个交易日	新股未上市	38.46	38.46	2,187	84,112.02	84,112.02	-
301175	中科环保	2022-06-30	6个交易日	新股未上市	3.82	3.82	19,585	74,814.70	74,814.70	-
688400	凌云光	2022-06-27	7个交易日	新股未上市	21.93	21.93	3,390	74,342.70	74,342.70	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	9个交易日	新股未上市	33.65	33.65	2,154	72,482.10	72,482.10	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	8个交易日	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301238	瑞泰新材	2022-06-10	6个月	创业板打新限售	19.18	32.07	599	11,488.82	19,209.93	-
301215	中汽股份	2022-02-28	6个月	创业板打新限售	3.80	6.39	2,898	11,012.40	18,518.22	-
301266	宇邦新材	2022-05-30	6个月	创业板打新限售	26.86	47.07	390	10,475.40	18,357.30	-
301120	新特电气	2022-04-11	6个月	创业板打新限售	13.73	15.49	970	13,318.10	15,025.30	-
301160	翔楼新材	2022-05-25	6个月	创业板打新限售	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-
301298	东利机械	2022-05-27	6个月	创业板打新限售	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301286	侨源股份	2022-06-06	6个月	创业板打新限售	16.91	19.79	634	10,720.94	12,546.86	-
301112	信邦智能	2022-06-20	6个月	创业板打新限售	27.53	45.04	266	7,322.98	11,980.64	-
301256	华融化学	2022-03-14	6个月	创业板打新限售	8.05	10.08	1,180	9,499.00	11,894.40	-

301259	艾布鲁	2022-04-18	6个月	创业板打新限售	18.39	24.94	474	8,716.86	11,821.56	-
301116	益客食品	2022-01-10	6个月	创业板打新限售	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301187	欧圣电气	2022-04-13	6个月	创业板打新限售	21.33	22.54	508	10,835.64	11,450.32	-
301220	亚香股份	2022-06-15	6个月	创业板打新限售	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301268	铭利达	2022-03-29	6个月	创业板打新限售	28.50	34.87	312	8,892.00	10,879.44	-
301302	华如科技	2022-06-16	6个月	创业板打新限售	52.03	56.42	180	9,365.40	10,155.60	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	6个月	创业板打新限售	15.37	15.99	622	9,560.14	9,945.78	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6个月	创业板打新限售	29.67	33.28	296	8,782.32	9,850.88	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个月	创业板打新限售	38.46	38.46	243	9,345.78	9,345.78	-
301288	清研环境	2022-04-14	6个月	创业板打新限售	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301125	腾亚精工	2022-05-27	6个月	创业板打新限售	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301130	西点药业	2022-02-16	6个月	创业板打新限售	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301200	大族数控	2022-02-18	6个月	创业板打新限售	76.56	51.92	172	13,168.32	8,930.24	-
301175	中科环保	2022-06-30	6个月	创业板打新限售	3.82	3.82	2,177	8,316.14	8,316.14	-
301109	军信股份	2022-04-06	6个月	创业板打新限售	23.18	16.14	515	11,939.83	8,312.10	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	6个月	创业板打新限售	33.65	33.65	240	8,076.00	8,076.00	-
301111	何氏	2022-0	6个月	创业板打	32.	32.	251	8,202.5	8,037.0	-

03	眼科	3-14		新限售	68	02		0	2	
3011 02	兆讯 传媒	2022-0 3-15	6个月	创业板打 新限售	39. 88	31. 09	257	10,249. 16	7,990.1 3	-
3012 48	杰创 智能	2022-0 4-13	6个月	创业板打 新限售	39. 07	29. 87	266	10,392. 62	7,945.4 2	-
3012 22	浙江 恒威	2022-0 3-02	6个月	创业板打 新限售	33. 98	28. 96	266	9,038.6 8	7,703.3 6	-
3012 16	万凯 新材	2022-0 3-21	6个月	创业板打 新限售	35. 68	29. 84	234	8,349.1 2	6,982.5 6	-
3011 35	瑞德 智能	2022-0 4-01	6个月	创业板打 新限售	31. 98	26. 26	254	8,122.9 2	6,670.0 4	-
3012 33	盛帮 股份	2022-0 6-24	6个月	创业板打 新限售	41. 52	41. 52	158	6,560.1 6	6,560.1 6	-
3011 81	标榜 股份	2022-0 2-11	6个月	创业板打 新限售	40. 25	30. 59	213	8,573.2 5	6,515.6 7	-
3012 37	和顺 科技	2022-0 3-16	6个月	创业板打 新限售	56. 69	41. 86	153	8,673.5 7	6,404.5 8	-
3012 19	腾远 钴业	2022-0 3-10	6个月	创业板打 新限售	96. 66	87. 82	72	6,959.2 0	6,323.0 4	-
3011 51	冠龙 节能	2022-0 3-30	6个月	创业板打 新限售	30. 82	21. 46	286	8,814.5 2	6,137.5 6	-
3011 23	奕东 电子	2022-0 1-14	6个月	创业板打 新限售	37. 23	25. 39	219	8,153.3 7	5,560.4 1	-
3011 10	青木 股份	2022-0 3-04	6个月	创业板打 新限售	63. 10	39. 85	132	8,329.2 0	5,260.2 0	-
3008 34	星辉 环材	2022-0 1-06	6个月	创业板打 新限售	55. 57	30. 03	149	8,279.9 3	4,474.4 7	-
3011 96	唯科 科技	2022-0 1-04	6个月	创业板打 新限售	64. 08	37. 52	82	5,254.5 6	3,076.6 4	-

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

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022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2,400,000.00元，截至2022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

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、合规稽核部、风险管理部、集中交易部和基金事务部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。

于2022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。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于2022年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有2,400,000.00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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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时间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6.4.12。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。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年0 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	10,309,979.10	-	-	-	10,309,979.10
结算备付金	458,991.85	-	-	2,239,679.58	2,698,671.43
存出保证金	3,236,064.00	-	-	-	3,236,064.00
交易性金融资产	3,160,652.31	-	-	164,918,150.03	168,078,802.34
应收清算款	-	-	-	2,760,588.43	2,760,588.43
应收申购款	-	-	-	209.69	209.69
资产总计	17,165,687.26	-	-	169,918,627.73	187,084,314.99
负债					
卖出回购金融资产款	2,400,000.00	-	-	-	2,400,000.00
应付清算款	-	-	-	75,707.71	75,707.71
应付赎回款	-	-	-	3,554,141.35	3,554,141.35
应付管理人报酬	-	-	-	234,128.90	234,128.90
应付托管费	-	-	-	39,021.53	39,021.53
应付销售服务费	-	-	-	28,476.44	28,476.44
应交税	-	-	-	0.31	0.31

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 2022 年中期报告

费					
其他负债	-	-	-	212,848.09	212,848.09
负债总计	2,400,000.00	-	-	4,144,324.33	6,544,324.33
利率敏感度缺口	14,765,687.26	-	-	165,774,303.40	180,539,990.66
上年度末 2021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	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					
卖出回购金融资产款	2,000,000.00	-	-	-	2,000,000.00
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	-	-	-	117,998.10	117,998.10

易费用					
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

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。

6.4.13.4.1.2 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率下降25个基点	1,094.97	13,928.81
	市场利率上升25个基点	-1,094.97	-13,796.33

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

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 2022年06月30日		上年度末 2021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	164,918,150.03	91.35	163,671,050.20	72.73
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	164,918,150.03	91.35	163,671,050.20	72.73

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单

		位：人民币元)	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	3,760,052.12	6,971,932.51
	业绩比较基准下降5%	-3,760,052.12	-6,971,932.51

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	159,147,957.61	154,915,340.83
第二层次	3,557,577.27	23,188,971.17
第三层次	5,373,267.46	3,560,983.70
合计	168,078,802.34	181,665,295.70

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022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(2021年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	164,918,150.03	88.15
	其中：股票	164,918,150.03	88.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,160,652.31	1.69
	其中：债券	3,160,652.31	1.69
	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	13,008,650.53	6.95
8	其他各项资产	5,996,862.12	3.21
9	合计	187,084,314.99	100.00

7.2 报告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

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	1,649,895.10	0.91
B	采矿业	21,889,264.23	12.12
C	制造业	65,768,365.48	36.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,968,142.19	2.75
E	建筑业	2,856,095.02	1.58
F	批发和零售业	691,501.04	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	5,389,714.75	2.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,405,252.19	6.32
J	金融业	38,208,679.80	21.16
K	房地产业	5,897,047.13	3.27
L	租赁和商务服务业	2,550,615.99	1.41
M	科学研究和技术服务业	2,100,208.95	1.16
N	水利、环境和公共设施管理业	107,167.20	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	80,481.00	0.04
Q	卫生和社会工作	1,057,029.16	0.59
R	文化、体育和娱乐业	298,690.80	0.17
S	综合	-	-
	合计	164,918,150.03	91.35

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(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

1	000001	平安银行	453,922	6,799,751.56	3.77
2	002142	宁波银行	167,325	5,991,908.25	3.32
3	600941	中国移动	87,362	5,270,724.04	2.92
4	600188	兖州煤业	94,349	3,724,898.52	2.06
5	600036	招商银行	86,634	3,655,954.80	2.03
6	601318	中国平安	76,407	3,567,442.83	1.98
7	001979	招商蛇口	221,673	2,977,068.39	1.65
8	601225	陕西煤业	121,363	2,570,468.34	1.42
9	000983	山西焦煤	172,074	2,304,070.86	1.28
10	600123	兰花科创	133,403	2,194,479.35	1.22
11	601088	中国神华	63,046	2,099,431.80	1.16
12	601888	中国中免	8,463	1,971,286.59	1.09
13	000933	神火股份	150,000	1,962,000.00	1.09
14	600900	长江电力	81,393	1,881,806.16	1.04
15	601857	中国石油	307,126	1,627,767.80	0.90
16	600887	伊利股份	40,734	1,586,589.30	0.88
17	600030	中信证券	70,368	1,524,170.88	0.84
18	601728	中国电信	403,373	1,504,581.29	0.83
19	600048	保利地产	85,431	1,491,625.26	0.83
20	601166	兴业银行	72,870	1,450,113.00	0.80
21	600938	中国海油	90,005	1,437,020.89	0.80
22	603259	药明康德	13,400	1,393,466.00	0.77
23	002415	海康威视	37,786	1,367,853.20	0.76
24	600438	通威股份	22,066	1,320,870.76	0.73
25	300750	宁德时代	2,445	1,305,630.00	0.72
26	603799	华友钴业	13,599	1,300,336.38	0.72
27	000651	格力电器	38,243	1,289,553.96	0.71
28	600309	万华化学	12,616	1,223,625.84	0.68
29	600276	恒瑞医药	31,229	1,158,283.61	0.64
30	002475	立讯精密	33,891	1,145,176.89	0.63
31	600026	中远海能	103,163	1,065,673.79	0.59

32	002714	牧原股份	18,997	1,049,964.19	0.58
33	000400	许继电气	53,993	1,036,665.60	0.57
34	600519	贵州茅台	500	1,022,500.00	0.57
35	601328	交通银行	197,253	982,319.94	0.54
36	300124	汇川技术	14,906	981,858.22	0.54
37	000333	美的集团	16,182	977,230.98	0.54
38	600328	中盐化工	40,000	942,000.00	0.52
39	601899	紫金矿业	100,863	941,051.79	0.52
40	000002	万科A	45,371	930,105.50	0.52
41	603288	海天味业	10,292	929,985.12	0.52
42	002371	北方华创	3,273	907,013.76	0.50
43	000725	京东方A	226,817	893,658.98	0.49
44	002466	天齐锂业	7,109	887,203.20	0.49
45	600406	国电南瑞	32,339	873,153.00	0.48
46	601985	中国核电	126,824	870,012.64	0.48
47	002460	赣锋锂业	5,780	859,486.00	0.48
48	002352	顺丰控股	15,258	851,548.98	0.47
49	600031	三一重工	44,240	843,214.40	0.47
50	603501	韦尔股份	4,636	802,167.08	0.44
51	600256	广汇能源	75,960	800,618.40	0.44
52	600348	华阳股份	51,202	791,582.92	0.44
53	601816	京沪高铁	156,910	787,688.20	0.44
54	601288	农业银行	257,361	777,230.22	0.43
55	601668	中国建筑	144,415	768,287.80	0.43
56	300122	智飞生物	6,876	763,304.76	0.42
57	002594	比亚迪	2,225	742,015.25	0.41
58	002092	中泰化学	93,459	725,241.84	0.40
59	600837	海通证券	72,349	709,743.69	0.39
60	600436	片仔癀	1,952	696,336.96	0.39
61	002049	紫光国微	3,638	690,201.36	0.38
62	600000	浦发银行	85,965	688,579.65	0.38

63	601001	晋控煤业	38,707	687,049.25	0.38
64	600016	民生银行	182,265	678,025.80	0.38
65	000063	中兴通讯	26,305	671,566.65	0.37
66	600104	上汽集团	37,594	669,549.14	0.37
67	603986	兆易创新	4,658	662,414.18	0.37
68	000807	云铝股份	65,000	642,200.00	0.36
69	300142	沃森生物	13,254	641,361.06	0.36
70	002241	歌尔股份	19,030	639,408.00	0.35
71	601666	平煤股份	46,206	627,939.54	0.35
72	601601	中国太保	26,529	624,227.37	0.35
73	600690	海尔智家	22,169	608,760.74	0.34
74	300498	温氏股份	28,179	599,930.91	0.33
75	002230	科大讯飞	14,046	578,976.12	0.32
76	600893	航发动力	12,397	564,187.47	0.31
77	600089	特变电工	20,564	563,247.96	0.31
78	600919	江苏银行	77,787	553,843.44	0.31
79	600585	海螺水泥	15,533	548,004.24	0.30
80	002129	TCL中环	9,171	540,080.19	0.30
81	601919	中远海控	38,515	535,358.50	0.30
82	601688	华泰证券	37,056	526,195.20	0.29
83	000100	TCL科技	107,059	512,812.61	0.28
84	600809	山西汾酒	1,573	510,910.40	0.28
85	601669	中国电建	64,382	506,686.34	0.28
86	600875	东方电气	30,782	506,363.90	0.28
87	600028	中国石化	123,545	504,063.60	0.28
88	002812	恩捷股份	2,005	502,152.25	0.28
89	601988	中国银行	153,414	500,129.64	0.28
90	002271	东方雨虹	9,705	499,516.35	0.28
91	002353	杰瑞股份	12,365	498,309.50	0.28
92	600660	福耀玻璃	11,912	498,040.72	0.28
93	002532	天山铝业	76,143	497,213.79	0.28

94	300015	爱尔眼科	11,104	497,126.08	0.28
95	601211	国泰君安	32,600	495,520.00	0.27
96	002027	分众传媒	73,495	494,621.35	0.27
97	601229	上海银行	73,145	479,099.75	0.27
98	000338	潍柴动力	38,332	478,000.04	0.26
99	600050	中国联通	136,928	473,770.88	0.26
100	601766	中国中车	90,787	472,092.40	0.26
101	600027	华电国际	118,532	465,830.76	0.26
102	600745	闻泰科技	5,369	456,955.59	0.25
103	000776	广发证券	23,139	432,699.30	0.24
104	600958	东方证券	41,540	424,123.40	0.23
105	300896	爱美客	700	420,007.00	0.23
106	002311	海大集团	6,973	418,449.73	0.23
107	601390	中国中铁	67,958	417,262.12	0.23
108	002410	广联达	7,576	412,437.44	0.23
109	600999	招商证券	28,297	407,759.77	0.23
110	300347	泰格医药	3,503	400,918.35	0.22
111	600009	上海机场	7,055	400,018.50	0.22
112	600570	恒生电子	9,178	399,610.12	0.22
113	000895	双汇发展	13,499	395,520.70	0.22
114	002179	中航光电	6,229	394,420.28	0.22
115	000166	申万宏源	91,595	392,942.55	0.22
116	600546	山煤国际	20,000	389,200.00	0.22
117	601658	邮储银行	71,959	387,859.01	0.21
118	600010	包钢股份	164,940	387,609.00	0.21
119	000937	冀中能源	51,405	383,481.30	0.21
120	600019	宝钢股份	62,831	378,242.62	0.21
121	601628	中国人寿	11,697	363,542.76	0.20
122	601818	光大银行	119,897	360,889.97	0.20
123	688111	金山办公	1,800	354,816.00	0.20
124	601009	南京银行	33,820	352,404.40	0.20

125	601989	中国重工	94,299	349,849.29	0.19
126	300274	阳光电源	3,519	345,741.75	0.19
127	600176	中国巨石	19,817	345,013.97	0.19
128	600703	三安光电	13,850	340,433.00	0.19
129	300496	中科创达	2,600	339,248.00	0.19
130	603659	璞泰来	4,004	337,937.60	0.19
131	600346	恒力石化	15,077	335,312.48	0.19
132	002493	荣盛石化	21,652	333,224.28	0.18
133	601012	隆基股份	4,942	329,285.46	0.18
134	600905	三峡能源	51,648	324,865.92	0.18
135	000768	中航西飞	10,606	321,255.74	0.18
136	600426	华鲁恒升	10,981	320,645.20	0.18
137	601138	工业富联	32,216	317,005.44	0.18
138	600588	用友网络	14,434	313,362.14	0.17
139	300408	三环集团	10,400	313,040.00	0.17
140	601128	常熟银行	40,973	313,033.72	0.17
141	601186	中国铁建	39,162	309,379.80	0.17
142	000963	华东医药	6,694	302,301.04	0.17
143	600600	青岛啤酒	2,848	295,964.16	0.16
144	600075	新疆天业	46,295	295,825.05	0.16
145	603993	洛阳钼业	51,524	295,232.52	0.16
146	600760	中航沈飞	4,811	290,824.95	0.16
147	601939	建设银行	47,973	290,716.38	0.16
148	002821	凯莱英	1,000	289,000.00	0.16
149	300759	康龙化成	3,000	285,660.00	0.16
150	601800	中国交建	30,760	285,452.80	0.16
151	601377	兴业证券	40,332	284,340.60	0.16
152	601006	大秦铁路	43,080	283,897.20	0.16
153	600763	通策医疗	1,626	283,639.44	0.16
154	688008	澜起科技	4,678	283,393.24	0.16
155	600989	宝丰能源	19,313	282,935.45	0.16

156	600312	平高电气	35,338	281,997.24	0.16
157	300760	迈瑞医疗	900	281,880.00	0.16
158	600132	重庆啤酒	1,920	281,472.00	0.16
159	000786	北新建材	8,058	278,967.96	0.15
160	600547	山东黄金	14,921	276,933.76	0.15
161	600150	中国船舶	14,583	276,785.34	0.15
162	002001	新 和 成	12,131	276,708.11	0.15
163	600029	南方航空	37,736	275,850.16	0.15
164	002050	三花智控	10,007	274,992.36	0.15
165	600584	长电科技	10,082	272,214.00	0.15
166	600085	同仁堂	4,985	263,606.80	0.15
167	688012	中微公司	2,257	263,504.75	0.15
168	603019	中科曙光	9,046	262,514.92	0.15
169	003816	中国广核	93,159	260,845.20	0.14
170	600741	华域汽车	11,334	260,682.00	0.14
171	601868	中国能建	108,644	257,486.28	0.14
172	000157	中联重科	41,700	256,872.00	0.14
173	300782	卓胜微	1,900	256,500.00	0.14
174	000876	新 希 望	16,712	255,693.60	0.14
175	600795	国电电力	65,138	254,689.58	0.14
176	600886	国投电力	24,211	254,215.50	0.14
177	000538	云南白药	4,203	253,819.17	0.14
178	601066	中信建投	8,743	252,760.13	0.14
179	601238	广汽集团	16,582	252,709.68	0.14
180	601126	四方股份	15,383	249,358.43	0.14
181	002236	大华股份	15,122	248,303.24	0.14
182	600926	杭州银行	16,431	246,136.38	0.14
183	601111	中国国航	20,918	242,857.98	0.13
184	601100	恒立液压	3,852	237,745.44	0.13
185	300628	亿联网络	3,059	232,942.85	0.13
186	600015	华夏银行	44,526	231,980.46	0.13

187	601916	浙商银行	69,723	231,480.36	0.13
188	000596	古井贡酒	917	228,938.22	0.13
189	600115	东方航空	40,802	224,002.98	0.12
190	000938	紫光股份	11,536	223,798.40	0.12
191	002008	大族激光	6,753	223,726.89	0.12
192	000425	徐工机械	41,272	222,456.08	0.12
193	000977	浪潮信息	8,400	222,432.00	0.12
194	601838	成都银行	13,307	220,630.06	0.12
195	601901	方正证券	32,819	220,215.49	0.12
196	300413	芒果超媒	6,600	220,176.00	0.12
197	605090	九丰能源	10,732	217,537.64	0.12
198	600452	涪陵电力	18,349	213,031.89	0.12
199	300595	欧普康视	3,722	212,861.18	0.12
200	000069	华侨城 A	32,699	212,216.51	0.12
201	002456	欧菲光	31,346	210,331.66	0.12
202	002841	视源股份	2,773	208,862.36	0.12
203	601333	广深铁路	95,287	207,725.66	0.12
204	688015	交控科技	8,615	207,621.50	0.12
205	688036	传音控股	2,320	207,013.60	0.11
206	002736	国信证券	21,387	204,673.59	0.11
207	603833	欧派家居	1,351	203,568.68	0.11
208	601336	新华保险	6,260	201,509.40	0.11
209	002007	华兰生物	8,722	198,861.60	0.11
210	601799	星宇股份	1,156	197,676.00	0.11
211	300433	蓝思科技	17,827	197,344.89	0.11
212	300529	健帆生物	3,800	193,382.00	0.11
213	601108	财通证券	24,523	192,996.01	0.11
214	603290	斯达半导	500	192,950.00	0.11
215	002601	龙佰集团	9,595	192,379.75	0.11
216	600352	浙江龙盛	18,760	190,976.80	0.11
217	002252	上海莱士	32,101	190,358.93	0.11

218	300003	乐普医疗	10,075	187,092.75	0.10
219	601788	光大证券	11,871	187,086.96	0.10
220	603392	万泰生物	1,201	186,515.30	0.10
221	603882	金城医学	2,254	186,067.70	0.10
222	000703	恒逸石化	17,699	186,016.49	0.10
223	601618	中国中冶	52,774	184,709.00	0.10
224	002938	鹏鼎控股	6,099	184,250.79	0.10
225	600018	上港集团	31,328	182,642.24	0.10
226	600332	白云山	5,765	182,116.35	0.10
227	002602	世纪华通	37,475	180,629.50	0.10
228	002028	思源电气	5,055	180,261.30	0.10
229	002120	韵达股份	10,526	179,573.56	0.10
230	600489	中金黄金	23,844	176,207.16	0.10
231	000783	长江证券	29,603	175,545.79	0.10
232	000066	中国长城	15,978	172,881.96	0.10
233	600918	中泰证券	22,486	172,017.90	0.10
234	603899	晨光文具	3,061	171,660.88	0.10
235	600109	国金证券	18,972	170,748.00	0.09
236	002555	三七互娱	8,008	170,009.84	0.09
237	688126	沪硅产业	7,385	169,707.30	0.09
238	000708	中信特钢	8,343	168,111.45	0.09
239	300999	金龙鱼	3,100	167,462.00	0.09
240	600183	生益科技	9,796	166,434.04	0.09
241	002384	东山精密	7,249	166,219.57	0.09
242	603369	今世缘	3,170	161,670.00	0.09
243	300033	同花顺	1,678	161,339.70	0.09
244	002916	深南电路	1,712	160,431.52	0.09
245	601898	中煤能源	15,382	159,665.16	0.09
246	300223	北京君正	1,500	159,375.00	0.09
247	600362	江西铜业	8,911	158,883.13	0.09
248	600111	北方稀土	4,412	155,125.92	0.09

249	603511	爱慕股份	8,870	154,958.90	0.09
250	600845	宝信软件	2,836	154,845.60	0.09
251	601021	春秋航空	2,620	152,877.00	0.08
252	688290	景业智能	3,000	152,700.00	0.08
253	601155	新城控股	5,829	148,231.47	0.08
254	600497	驰宏锌锗	28,559	148,221.21	0.08
255	603198	迎驾贡酒	2,262	147,346.68	0.08
256	300601	康泰生物	3,248	146,744.64	0.08
257	601990	南京证券	16,902	140,962.68	0.08
258	002463	沪电股份	9,528	140,633.28	0.08
259	603666	亿嘉和	2,048	140,492.80	0.08
260	601699	潞安环能	9,513	139,080.06	0.08
261	600657	信达地产	20,000	137,800.00	0.08
262	002508	老板电器	3,786	136,409.58	0.08
263	601696	中银证券	10,187	135,487.10	0.08
264	600061	国投资本	21,226	134,997.36	0.07
265	600161	天坛生物	5,477	132,981.56	0.07
266	688195	腾景科技	4,787	132,695.64	0.07
267	301187	欧圣电气	5,080	132,425.44	0.07
268	601077	渝农商行	35,259	130,458.30	0.07
269	601878	浙商证券	11,293	128,514.34	0.07
270	688561	奇安信	2,300	128,340.00	0.07
271	600606	绿地控股	32,028	126,830.88	0.07
272	601216	君正集团	25,308	123,503.04	0.07
273	688169	石头科技	200	123,340.00	0.07
274	688065	凯赛生物	1,100	122,980.00	0.07
275	688396	华润微	2,070	122,274.90	0.07
276	002304	洋河股份	665	121,794.75	0.07
277	600011	华能国际	17,160	120,806.40	0.07
278	002568	百润股份	4,000	120,160.00	0.07
279	600487	亨通光电	8,213	119,417.02	0.07

280	603160	汇顶科技	1,889	116,985.77	0.06
281	002600	领益智造	22,519	113,045.38	0.06
282	601319	中国人保	22,020	111,421.20	0.06
283	002791	坚朗五金	853	110,651.16	0.06
284	002064	华峰化学	13,100	110,564.00	0.06
285	601162	天风证券	33,728	107,255.04	0.06
286	601966	玲珑轮胎	4,200	106,554.00	0.06
287	601998	中信银行	22,221	105,549.75	0.06
288	600025	华能水电	14,950	104,500.50	0.06
289	601995	中金公司	2,347	104,418.03	0.06
290	300136	信维通信	6,040	101,774.00	0.06
291	002414	高德红外	7,502	96,550.74	0.05
292	301130	西点药业	2,370	94,254.90	0.05
293	601881	中国银河	9,707	93,866.69	0.05
294	301139	元道通信	2,430	93,457.80	0.05
295	603806	福斯特	1,336	87,534.72	0.05
296	300957	贝泰妮	400	87,012.00	0.05
297	301102	兆讯传媒	2,565	84,708.05	0.05
298	002558	巨人网络	9,225	84,408.75	0.05
299	301175	中科环保	21,762	83,130.84	0.05
300	601600	中国铝业	16,972	80,617.00	0.04
301	301239	普瑞眼科	2,394	80,558.10	0.04
302	002607	中公教育	13,900	80,481.00	0.04
303	603195	公牛集团	522	79,819.02	0.04
304	002739	万达电影	5,752	78,514.80	0.04
305	688400	凌云光	3,390	74,342.70	0.04
306	600118	中国卫星	3,559	71,464.72	0.04
307	002032	苏泊尔	1,261	71,044.74	0.04
308	000800	一汽解放	7,190	67,154.60	0.04
309	002673	西部证券	10,194	66,668.76	0.04
310	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.04

311	688100	威胜信息	3,000	62,970.00	0.03
312	601236	红塔证券	6,848	62,522.24	0.03
313	000877	天山股份	5,000	61,500.00	0.03
314	603087	甘李药业	1,255	60,202.35	0.03
315	301123	奕东电子	2,183	56,919.01	0.03
316	600482	中国动力	3,278	51,497.38	0.03
317	605499	东鹏饮料	300	51,258.00	0.03
318	300919	中伟股份	400	49,560.00	0.03
319	601698	中国卫通	3,709	41,948.79	0.02
320	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.02
321	300545	联得装备	1,800	32,598.00	0.02
322	301238	瑞泰新材	684	22,408.48	0.01
323	301215	中汽股份	2,980	19,087.30	0.01
324	301266	宇邦新材	399	18,852.57	0.01
325	301112	信邦智能	356	16,883.84	0.01
326	301160	翔楼新材	418	15,883.58	0.01
327	301120	新特电气	992	15,419.98	0.01
328	301268	铭利达	412	14,719.44	0.01
329	301220	亚香股份	349	13,905.27	0.01
330	301116	益客食品	664	13,615.02	0.01
331	301259	艾布鲁	531	13,497.36	0.01
332	301298	东利机械	640	13,358.92	0.01
333	301286	侨源股份	640	12,683.96	0.01
334	301212	联盛化学	356	12,121.28	0.01
335	301256	华融化学	1,198	12,088.80	0.01
336	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
337	301219	腾远钴业	126	11,316.96	0.01
338	301302	华如科技	197	11,198.38	0.01
339	301200	大族数控	213	11,144.24	0.01
340	301248	杰创智能	353	10,793.80	0.01
341	301288	清研环境	516	10,587.44	0.01

342	301137	哈焊华通	656	10,541.80	0.01
343	301109	军信股份	645	10,539.00	0.01
344	301125	腾亚精工	370	10,311.38	0.01
345	301216	万凯新材	332	10,074.46	0.01
346	301103	何氏眼科	298	9,637.84	0.01
347	301110	青木股份	217	8,940.70	0.00
348	301135	瑞德智能	332	8,908.64	0.00
349	301237	和顺科技	192	8,151.78	0.00
350	301151	冠龙节能	356	7,762.96	0.00
351	301222	浙江恒威	266	7,703.36	0.00
352	301181	标榜股份	224	6,868.88	0.00
353	300834	星辉环材	181	5,442.79	0.00
354	301196	唯科科技	111	4,174.58	0.00
355	300059	东方财富	113	2,870.20	0.00
356	301136	招标股份	54	1,077.30	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	000001	平安银行	6,344,909.00	2.82
2	300750	宁德时代	4,889,929.00	2.17
3	002594	比亚迪	3,038,074.68	1.35
4	601012	隆基股份	3,023,411.76	1.34
5	600519	贵州茅台	2,387,871.00	1.06
6	001979	招商蛇口	2,280,189.00	1.01
7	002142	宁波银行	2,219,820.00	0.99
8	000933	神火股份	1,962,397.00	0.87
9	300274	阳光电源	1,701,711.00	0.76
10	002466	天齐锂业	1,587,761.00	0.71

11	601728	中国电信	1,483,500.00	0.66
12	600188	兖州煤业	1,426,205.00	0.63
13	603259	药明康德	1,378,083.00	0.61
14	600938	中国海油	1,296,054.00	0.58
15	002460	赣锋锂业	1,268,211.00	0.56
16	601600	中国铝业	1,026,264.00	0.46
17	600036	招商银行	984,804.00	0.44
18	600585	海螺水泥	958,166.00	0.43
19	600048	保利地产	949,060.00	0.42
20	002812	恩捷股份	937,298.00	0.42

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	600519	贵州茅台	8,526,946.70	3.79
2	300750	宁德时代	5,988,343.96	2.66
3	601012	隆基股份	3,684,581.60	1.64
4	002594	比亚迪	2,988,683.60	1.33
5	000858	五粮液	2,739,634.25	1.22
6	002142	宁波银行	2,338,944.50	1.04
7	600905	三峡能源	2,084,501.66	0.93
8	300059	东方财富	1,783,266.00	0.79
9	601728	中国电信	1,371,328.00	0.61
10	600795	国电电力	1,351,325.74	0.60
11	000001	平安银行	1,339,960.00	0.60
12	000333	美的集团	1,257,974.93	0.56

13	002466	天齐锂业	1,251,935.46	0.56
14	600048	保利地产	1,233,460.93	0.55
15	000568	泸州老窖	1,222,697.00	0.54
16	000767	晋控电力	1,182,936.74	0.53
17	300274	阳光电源	1,137,902.75	0.51
18	300014	亿纬锂能	1,074,794.10	0.48
19	600089	特变电工	1,067,885.60	0.47
20	603259	药明康德	1,049,456.92	0.47

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	100,887,009.67
卖出股票收入（成交）总额	87,451,351.08

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	3,160,652.31	1.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,160,652.31	1.75

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	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净
---	------	------	-------	------	--------

号					值比例(%)
1	019641	20国债11	30,260	3,099,501.13	1.72
2	010303	03国债(3)	600	61,151.18	0.03

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 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，本基金投资股指期货以保持股票仓位平稳与套期保值为目的，选择交易活跃、流动性较好的股指期货合约进行投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,236,064.00

2	应收清算款	2,760,588.43
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	209.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,996,862.12

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	600941	中国移动	3,685,140.04	2.04	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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	452	26,364.95	7,901,794.90	66.31%	4,015,162.73	33.69%

混合发起A						
中科沃土沃鑫成长混合发起C	22	5,670,732.00	124,683,561.73	99.94%	72,542.34	0.06%
合计	474	288,339.79	132,585,356.63	97.01%	4,087,705.07	2.99%

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	806,880.04	6.77%
	中科沃土沃鑫成长混合发起C	0.00	0.00%
	合计	806,880.04	0.5903%

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
	中科沃土沃鑫成长混合发起C	0
	合计	0
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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

截至本报告期末，发起资金认购的本基金基金份额持有期限已满3年。

§ 9 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	27,769,188.21	134,148,193.29
本报告期基金总申购份额	67,373.75	115,649,157.40
减：本报告期基金总赎回份额	15,919,604.33	125,041,246.62
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	11,916,957.63	124,756,104.07

注：本基金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

本报告期内，无涉及基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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	
安信证券	1	55,939,424.11	30.93%	40,908.66	28.32%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	42,597,339.30	23.55%	31,151.40	21.56%	-
东莞证券	2	60,993,003.96	33.72%	56,803.18	39.32%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	13,466,826.70	7.45%	9,848.57	6.82%	-
国信证券	2	2,736,987.00	1.51%	2,001.64	1.39%	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

天风证券	2	3,403,729.88	1.88%	2,489.22	1.72%	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	1,728,125.15	0.96%	1,263.80	0.87%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

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

2、交易席位选择流程：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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	5,565,102.00	11.13%	314,100,000.00	38.92%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东莞证券	43,237,489.10	86.45%	257,500,000.00	31.90%	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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	107,511.00	0.21%	123,000,000.00	15.24%	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	1,101,976.00	2.20%	112,500,000.00	13.94%	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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基金产品资料概要更新（A类份额）	中国证券报及基金管理人网站	2022-03-03
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产品资料概要更新（C类份额）	中国证券报及基金管理人网站	2022-03-03
3	中科沃土基金管理有限公司关于新增申万宏源西部证券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	2022-03-18
4	中科沃土基金管理有限公司关于新增中植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	2022-03-18
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2022年第一季度报告	中国证券报及基金管理人网站	2022-04-22
6	中科沃土基金管理有限公司关于新增泰信财富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	2022-06-24
7	中科沃土基金管理有限公司关于新增福克斯（北京）基	中国证券报及基金管理人网站	2022-06-28

	金为旗下部分基金销售机构的公告		
--	-----------------	--	--

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220323-20220630	0.00	39,247,936.30	0.00	39,247,936.30	28.72%
	2	20220101-20220630	36,302,844.89	29,005,377.86	9,400,000.00	55,908,222.75	40.91%
	3	20220126-20220321	23,089,238.83	20,912,116.37	36,300,000.00	7,701,355.20	5.63%
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 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
二〇二二年八月三十一日