

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 年年度报告

2022 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:2023 年 03 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年3月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自2022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	6
§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	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
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	16
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	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 净资产（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	61
8.1 期末基金资产组合情况	61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	62
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	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
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	75
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	75
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	75
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	75
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	75

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
8.12 投资组合报告附注	76
§9 基金份额持有人信息	77
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
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	78
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	79
§10 开放式基金份额变动	79
§11 重大事件揭示	79
11.1 基金份额持有人大会决议	79
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	79
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	79
11.4 基金投资策略的改变	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	79
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	80
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	80
11.8 其他重大事件	82
§12 影响投资者决策的其他重要信息	84
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	84
§13 备查文件目录	84
13.1 备查文件目录	84
13.2 存放地点	85
13.3 查阅方式	85

§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	73,264,297.94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	3,977,098.15份	69,287,199.79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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.richlandasm.com.cn
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	2022年		2021年		2020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	-1,010,108.64	-11,160,611.96	15,658,413.89	26,579,381.36	31,549,563.78	8,819,310.79
本期利润	-2,869,629.24	-20,357,916.83	4,885,656.95	13,686,089.87	43,924,907.37	14,234,826.64
加权平均基金份额本期利润	-0.2290	-0.1736	0.0908	0.1076	0.3328	0.1782
本期加权平均净值利润率	-17.63%	-13.64%	6.82%	8.02%	29.73%	14.30%
本期基金份额净值增长率	-11.55%	-11.86%	8.70%	7.88%	31.83%	24.35%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末		2021年末		2020年末	
期末可供分配利润	948,720.66	15,463,729.20	11,113,375.90	52,017,074.20	27,554,341.65	20,630,156.82
期末可供分配基金份额利润	0.2385	0.2232	0.4002	0.3878	0.2013	0.2008
期末基金资产净值	4,925,818.81	84,750,928.99	38,882,564.11	186,165,267.49	176,308,360.10	132,166,561.67

期末基金份额净值	1.2385	1.2232	1.4002	1.3878	1.2881	1.2864
3.1.3 累计期末指标	2022年末		2021年末		2020年末	
基金份额累计净值增长率	23.85%	17.88%	40.02%	33.74%	28.81%	24.35%

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
过去三个月	0.04%	0.95%	0.70%	0.64%	-0.66%	0.31%
过去六个月	-7.14%	0.86%	-6.85%	0.55%	-0.29%	0.31%
过去一年	-11.55%	0.93%	-10.80%	0.64%	-0.75%	0.29%
过去三年	26.75%	0.97%	0.03%	0.64%	26.72%	0.33%
过去五年	20.39%	1.05%	5.01%	0.64%	15.38%	0.41%
自基金合同生效起至今	23.85%	0.99%	11.59%	0.60%	12.26%	0.39%

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	-0.01%	0.95%	0.70%	0.64%	-0.71%	0.31%

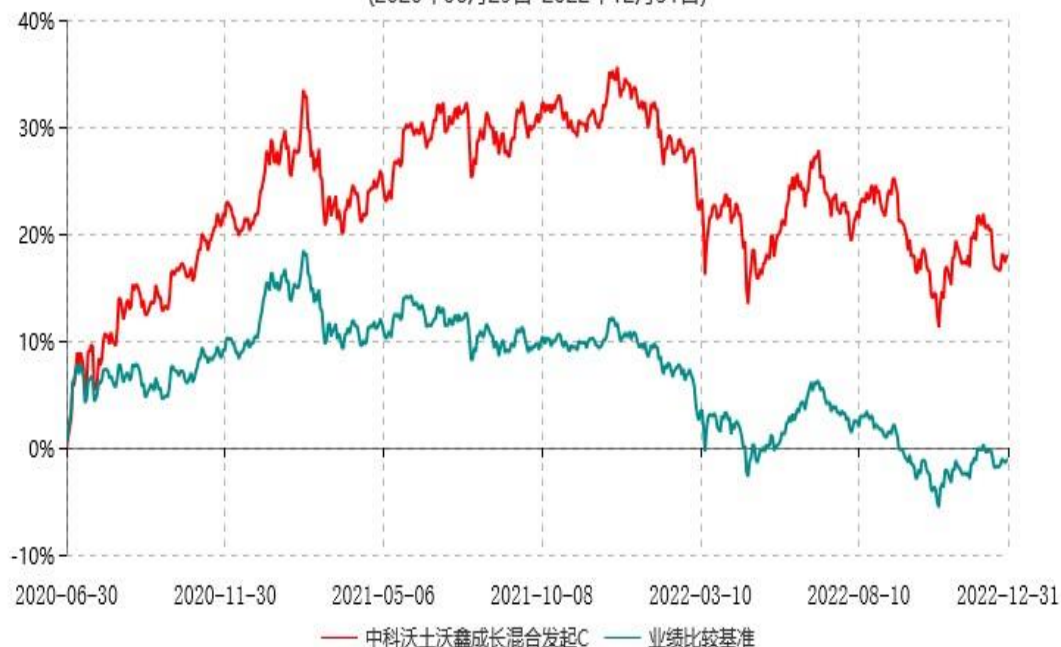
过去六个月	-7.31%	0.86%	-6.85%	0.55%	-0.46%	0.31%
过去一年	-11.86%	0.93%	-10.80%	0.64%	-1.06%	0.29%
自基金合同生效起至今	17.88%	0.88%	-1.17%	0.62%	19.05%	0.26%

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

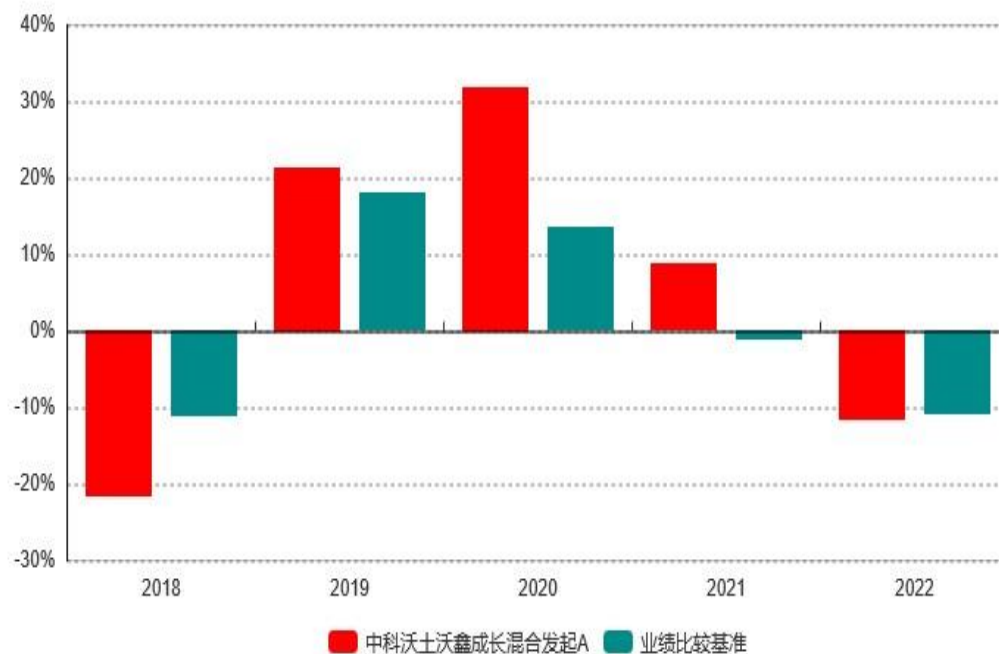
中科沃土沃鑫成长混合发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



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12月31日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中科沃土基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2015]1937号文批准，于2015年9月6日正式成立，注册资本2.42亿元，是国内第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。截止2022年12月31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	权益投资部总经理助理 （主持工作）、基金经理	2019-0 8-09	-	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责任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和中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。

注：1.此处的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中科沃土基金管理有限责任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2022年，因为海外经济增速逐渐陷入下降通道，同时国际经贸关系也趋于复杂，出口的增速呈现前高后低的态势。基建投资的增速趋势表现较好，尤其是四季度的基建

投资增速有较大的提高，表明之前积极的财政政策正在逐步形成实物工作量；但受到房地产投资负增长的拖累，使得投资整体上的增速仍然不高。在消费方面，因为疫情的扰动以及居民对未来收入的预期仍较悲观，2022年下半年的消费增速还是受到了较大抑制。但更重要的是四季国内的疫情防控政策进行了大幅度的优化调整，未来疫情的波动对经济的不确定性影响也基本消除，市场会对未来经济的恢复与增长抱有较强的信心。因此虽然四季度的经济运行受到了外部环境的多方干扰，录得的经济数据较差，但也并不会对股票市场产生利空。

与此同时我们也观察到过高的能源价格已经导致海外的能源消费出现了负反馈得现象，国内疫情波动也导致了出行需求下降，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。同时海外发达经济体的增速也开始显著下行，四季度海外发达经济体PPI的增速有所放慢，但工资与服务的价格还在持续上涨。美联储的加息进程也开始趋缓，但由于美国核心PCE始终处于较高水平，议息会议再次偏向于鹰派，美联储的加息预期又开始升温。

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2023上半年年PPI的同比增速整体成下降趋势，CPI的增长幅度也会有所放缓。由此我们认为国内的货币政策在2023年仍然将维持较为宽松的状态。

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。

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1.2385元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.55%，同期业绩比较基准收益率为-10.80%；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1.2232元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.86%，同期业绩比较基准收益率为-10.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2023年，受到美联储持续加息预期的影响，全球经济增速将会继续放慢，同时因为供给侧不足的原因，欧美主要市场的通胀指数很可能持续高涨，海外发达经济体滞涨的特征更加明显，海外经济与市场大概率进入震荡下行的阶段。这也会对中国2023年出口的增长形成拖累，预计出口增速会下降一个台阶。

对于国内市场，稳住经济增长的任务仍然较重，财政政策可能加大实施力度，货币政策也将保持稳健。2022年中央政府多次提出要加强稳增长的力度，但执行落地的情况并不理想，我们预计财政政策将在2023年继续发力，充分发挥托底作用，而作为稳定经

济增长的关键抓手，基建投资力度将进一步加大。同时作为配套地方政府专项债也可能进一步前置，我们也将密切关注这方面的边际变化。信贷政策上，房地产信贷调控政策边际上有所放松，供给侧的政策陆续出台，但预计仍然以保交楼、防风险为主要目的，优质的房地产企业资产负债表有望开始逐步改善，房地产投资与销售的下降幅度会有所收窄。同时预计银行信贷对实体经济的高质量发展还将给予更大的支持，中小企业与高兴技术领域将继续享受良好的融资环境。消费方面，受益于疫情防控政策的优化，场景消费与休闲消费将会直接受益，而随着居民收入及预期的稳定，预计商品消费尤其是大众品消费也将呈现出较高的增长速度。

在前述宏观经济状况下，我们将在2023年的投资策略中，保持中性偏高的股票仓位与较均衡行业配置。精选优质公司并且在估值低估的时候买入，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。

4.6 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人--中科沃土基金管理有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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2022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(2023)第28107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	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")的财务报表，包括2022年12月31日

	<p>的资产负债表，2022年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。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2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。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，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>-</p>
<p>其他事项</p>	<p>-</p>
<p>其他信息</p>	<p>-</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、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</p>

	<p>合的财务报告过程。</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。(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>

	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。	
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	周祎	成磊
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	2023-03-27	

§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：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	4,520,961.67	10,774,580.53
结算备付金		8,752,280.02	34,942,960.98
存出保证金		19,574.99	36,778.16
交易性金融资产	7.4.7.2	79,873,565.44	181,665,295.70
其中：股票投资		74,849,749.55	163,671,050.20
基金投资		-	-
债券投资		5,023,815.89	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-

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		850,628.56	-
应收股利		-	-
应收申购款		109.84	2,001,420.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	359,615.58
资产总计		94,017,120.52	229,780,651.22
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		3,888,870.30	2,000,000.00
应付清算款		-	2,034,719.82
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		140,088.79	283,828.10
应付托管费		23,348.14	47,304.68
应付销售服务费		17,831.69	31,227.14
应付投资顾问费		-	-
应交税费		11,561.66	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	258,672.14	335,739.88
负债合计		4,340,372.72	4,732,819.62

净资产：			
实收基金	7.4.7.7	73,264,297.94	161,917,381.50
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	16,412,449.86	63,130,450.10
净资产合计		89,676,747.80	225,047,831.60
负债和净资产总计		94,017,120.52	229,780,651.22

注：报告截止日2022年12月31日，基金份额总额73,264,297.94份，其中A类基金份额净值1.2385元，A类基金份额3,977,098.15份；C类基金份额净值1.2232元，C类基金份额69,287,199.79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：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2 021年12月31日
一、营业总收入		-19,720,526.89	24,715,197.59
1.利息收入		173,048.83	945,148.71
其中：存款利息收入	7.4.7.9	159,245.33	231,808.30
债券利息收入		-	713,340.41
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收 入		13,803.50	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-8,856,265.08	47,073,875.67
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-15,243,040.04	44,553,605.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	225,626.53	-118,424.24
资产支持证券投资收	7.4.7.12	-	-

益			
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	1,828,017.97	112,342.13
股利收益	7.4.7.15	4,333,130.46	2,526,351.92
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）	7.4.7.16	-11,056,825.47	-23,666,048.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	19,514.83	362,221.64
减：二、营业总支出		3,507,019.18	6,143,450.77
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,510,028.29	3,633,885.15
2. 托管费	7.4.10.2.2	418,338.03	605,647.51
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	301,122.86	339,018.18
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		97,802.52	341,916.06
其中：卖出回购金融资产支出		97,802.52	341,916.06
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		4,245.54	422.13
8. 其他费用	7.4.7.18	175,481.94	1,222,561.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-23,227,546.07	18,571,746.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-23,227,546.07	18,571,746.82
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		-23,227,546.07	18,571,746.82
----------	--	----------------	---------------

7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31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）	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）	-88,653,083.56	-	-46,718,000.24	-135,371,083.80
（一）、综合收益总额	-	-	-23,227,546.07	-23,227,546.07
（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）	-88,653,083.56	-	-23,490,454.17	-112,143,537.73
其中：1.基金申购款	164,330,691.65	-	45,205,492.29	209,536,183.94
2.基金	-252,983,775.21	-	-68,695,946.46	-321,679,721.67

赎回款				
(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)	73,264,297.94	-	16,412,449.86	89,676,747.80
项目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31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)	-77,694,643.51	-	-5,732,446.66	-83,427,090.17
(一)、综合收益总额	-	-	18,571,746.82	18,571,746.82
(二)、本期基	-77,694,643.51	-	-24,304,193.48	-101,998,836.99

金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)				
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
(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)	161,917,381.50	-	63,130,450.10	225,047,831.60

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2023年3月27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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规

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2022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2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产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

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，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。

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。

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。

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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们都必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

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净资产比例计算的金额。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

损益占净资产比例计算的金额。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。债券投资和资产支持证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和资产支持证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。

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扣除按票面利率(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后的净额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及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确认。

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。

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(可转换债券及可交换债券除外)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(可转换债券及可交换债券除外)，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号一套期会计》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),中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》,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。

(i) 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。

ii) 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	4,520,961.67	10,774,580.53
等于：本金	4,520,292.48	10,774,580.53
加：应计利息	669.19	-
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	4,520,961.67	10,774,580.53

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	86,000,086.66	-	74,849,749.55	-11,150,337.11	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	4,985,894.00	57,927.89	5,023,815.89	-20,006.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	4,985,894.00	57,927.89	5,023,815.89	-20,006.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	90,985,980.66	57,927.89	79,873,565.44	-11,170,343.11	
项目	上年度末 2021年12月31日				
	成本	应计利息	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

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 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	359,615.58
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	359,615.58

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	38,672.14	117,998.10

其中：交易所市场	38,672.14	117,998.10
银行间市场	-	-
应付利息	-	-2,258.22
预提费用-审计费	50,000.00	50,000.00
预提费用-信息披露费	170,000.00	170,000.00
合计	258,672.14	335,739.88

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 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12月31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	100,791.06	100,791.06
本期赎回（以“-”号填列）	-23,892,881.12	-23,892,881.12
本期末	3,977,098.15	3,977,098.15

7.4.7.7.2 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12月31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	164,229,900.59	164,229,900.59
本期赎回（以“-”号填列）	-229,090,894.09	-229,090,894.09
本期末	69,287,199.79	69,287,199.79

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 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合发起A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	12,188,586.54	-1,075,210.64	11,113,375.90
本期利润	-1,010,108.64	-1,859,520.60	-2,869,629.24
本期基金份额交易产生的变动数	-9,915,805.34	2,620,779.34	-7,295,026.00
其中：基金申购款	41,868.07	-11,812.42	30,055.65
基金赎回款	-9,957,673.41	2,632,591.76	-7,325,081.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,262,672.56	-313,951.90	948,720.66

7.4.7.8.2 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	-11,160,611.96	-9,197,304.87	-20,357,916.83
本期基金份额交易产生的变动数	-25,187,615.81	8,992,187.64	-16,195,428.17
其中：基金申购款	65,610,241.12	-20,434,804.48	45,175,436.64
基金赎回款	-90,797,856.93	29,426,992.12	-61,370,864.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,980,322.16	-5,516,592.96	15,463,729.20

7.4.7.9 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 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
活期存款利息收入	42,819.61	57,589.23

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	115,890.20	173,451.31
其他	535.52	767.76
合计	159,245.33	231,808.30

7.4.7.10 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 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
卖出股票成交总额	197,734,762.67	397,409,813.00
减：卖出股票成本总额	212,487,282.02	352,856,207.14
减：交易费用	490,520.69	-
买卖股票差价收入	-15,243,040.04	44,553,605.86

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
债券投资收益——利息收入	199,026.05	-
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	26,600.48	-118,424.24
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	225,626.53	-118,424.24

7.4.7.11.2 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12月 31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	52,977,372.48	139,120,197.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	51,914,396.69	136,215,930.92
减：应计利息总额	1,036,324.48	3,022,691.26
减：交易费用	50.83	-
买卖债券差价收入	26,600.48	-118,424.24

7.4.7.12 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。

7.4.7.13 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。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 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 12月31日	上年度可比期间收益金额 2021年01月01日至2021年 12月31日
股指期货投资收益	1,828,017.97	112,342.13

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022	上年度可比期间 2021年01月01日至2021
----	------------------------	-----------------------------

	年12月31日	年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,333,130.46	2,526,351.92
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	4,333,130.46	2,526,351.92

7.4.7.16 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12 月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日
1.交易性金融资产	-11,056,825.47	-23,666,048.43
——股票投资	-11,076,300.56	-23,756,101.05
——债券投资	19,475.09	90,052.62
——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	-11,056,825.47	-23,666,048.43

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
基金赎回费收入	19,514.83	362,221.64
合计	19,514.83	362,221.64

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

2、基金转换费用由转出基金赎回费用及基金申购补差费用两部分构成。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021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
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	5,481.94	8,315.34
交易费用	-	1,044,246.40
合计	175,481.94	1,222,561.74

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
广东普瑞投资发展合伙企业(有限合伙)	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

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：1.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2.本报告期内，珠海横琴沃土创业投资有限公司更名为珠海横琴沃土投资有限公司。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间无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

本基金本报告期及上年度可比期间无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

本基金本报告期及上年度可比期间无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

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无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 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,510,028.29	3,633,885.15
其中：支付销售机构的客户维护费	673,893.51	1,053,538.56

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 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	418,338.03	605,647.51

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 2022年01月01日至2022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	0.00	39,106.91	39,106.91
合计	0.00	39,106.91	39,106.91
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间 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		

名称	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	合计
中科沃土基金	0.00	184,008.18	184,008.18
合计	0.00	184,008.18	184,008.18

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

于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本基金。

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 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021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	4,520,961.67	42,819.61	10,774,580.53	57,589.23

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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 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。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2022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	受限期	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
688231	隆达股份	2022-07-13	6个月	科创板打新限售	39.08	35.14	1,828	71,438.24	64,235.92	-
688387	信科移动	2022-09-19	6个月	科创板打新限售	6.05	4.88	11,538	69,804.90	56,305.44	-
688253	英诺特	2022-07-21	6个月	科创板打新限售	26.06	22.29	2,419	63,039.14	53,919.51	-

				售						
688184	帕瓦股份	2022-09-09	6个月	科创板打新限售	51.88	33.82	1,056	54,785.28	35,713.92	-
688132	邦彦技术	2022-09-16	6个月	科创板打新限售	28.88	22.80	1,493	43,117.84	34,040.40	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	6个月	创业板打新限售	33.65	69.68	240	8,076.00	16,723.20	-
301269	华大九天	2022-07-21	6个月	创业板打新限售	32.69	87.94	154	5,034.26	13,542.76	-
301175	中科环保	2022-06-30	6个月	创业板打新限售	3.82	6.01	2,177	8,316.14	13,083.77	-
301195	北路智控	2022-07-25	6个月	创业板打新限售	71.17	73.04	90	6,405.30	6,573.60	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个月	创业板打新限售	38.46	25.31	243	9,345.78	6,150.33	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6个月	创业板打新限售	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
3011	紫建	2022-	6个	创业	61.07	49.77	102	6,22	5,07	-

21	电子	08-01	月	板打 新限售				9.14	6.54	
3013 06	西测 测试	2022- 07-19	6个 月	创业 板打 新限售	43.23	42.29	120	5,18 7.60	5,07 4.80	-
3011 97	工大 科雅	2022- 07-29	6个 月	创业 板打 新限售	25.50	20.08	209	5,32 9.50	4,19 6.72	-
3013 18	维海 德	2022- 08-03	6个 月	创业 板打 新限售	64.68	41.74	69	4,46 2.92	2,88 0.06	-

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2022年12月31日止，本基金证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额3,888,870.30元，截至2023年1月3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、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。

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	17,476,272.50
合计	-	17,476,272.50

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	447,000.00
AAA以下	-	-
未评级	5,023,815.89	70,973.00
合计	5,023,815.89	517,973.00

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未持有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未持有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12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有3,888,870.30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公司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报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节。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。于2022年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值未超过经确认的当日净赎回金额。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 2022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	4,520,961.67	-	-	-	4,520,961.67
结算备付金	8,752,280.02	-	-	-	8,752,280.02
存出保证金	19,574.99	-	-	-	19,574.99
交易性金融资产	5,023,815.89	-	-	74,849,749.55	79,873,565.44
应收清算款	-	-	-	850,628.56	850,628.56
应收申	-	-	-	109.84	109.84

购款					
资产总计	18,316,632.57	-	-	75,700,487.95	94,017,120.52
负债					
卖出回购金融资产款	3,888,870.30	-	-	-	3,888,870.30
应付管理人报酬	-	-	-	140,088.79	140,088.79
应付托管费	-	-	-	23,348.14	23,348.14
应付销售服务费	-	-	-	17,831.69	17,831.69
应交税费	-	-	-	11,561.66	11,561.66
其他负债	-	-	-	258,672.14	258,672.14
负债总计	3,888,870.30	-	-	451,502.42	4,340,372.72
利率敏感度缺口	14,427,762.27	-	-	75,248,985.53	89,676,747.80
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
应收申购款	-	-	-	2,001,420.27	2,001,420.27
其他资产	-	-	-	359,615.58	359,615.58
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
其他负债	-	-	-	335,739.88	335,739.88
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为5.60%(2021年12月31日：8.00%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2021年12月31日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对

单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的0%-95%，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 2022年12月31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	74,849,749.55	83.47	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	74,849,749.55	83.47	163,671,050.20	72.73

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	3,100,238.87	6,971,932.51
	业绩比较基准下降5%	-3,100,238.87	-6,971,932.51

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	74,526,813.18	154,915,340.83
第二层次	5,023,815.89	23,188,971.17
第三层次	322,936.37	3,560,983.70
合计	79,873,565.44	181,665,295.70

7.4.14.2.2 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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	3,560,983.70	3,560,983.70
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	5,126,683.47	5,126,683.47
转出第三层次	-	8,707,207.48	8,707,207.48
当期利得或损失总额	-	342,476.68	342,476.68
其中：计入损益的利得或损失	-	342,476.68	342,476.68
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	322,936.37	322,936.37
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-44,195.83	-44,195.83
项目	上年度可比同期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-

当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,547,768.40	2,547,768.40
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	1,013,215.30	1,013,215.30
其中：计入损益的利得或损失	-	1,013,215.30	1,013,215.30
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	3,560,983.70	3,560,983.70
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,013,215.30	1,013,215.30

注：1、于2022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证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2022年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

2、计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期内股票投资	322,936.37	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1891-1.0144	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期内股	3,560,983.70	平均价格亚式	预期波	0.1717-2.7417	负相关

票投资		期权模型	动率		
-----	--	------	----	--	--

7.4.14.3 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(2021年12月31日：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§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	74,849,749.55	79.61
	其中：股票	74,849,749.55	79.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,023,815.89	5.34
	其中：债券	5,023,815.89	5.34
	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	13,273,241.69	14.12
8	其他各项资产	870,313.39	0.93
9	合计	94,017,120.52	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	714,844.52	0.80
B	采矿业	7,533,426.28	8.40
C	制造业	25,494,198.98	28.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,039,142.96	3.39
E	建筑业	1,643,447.21	1.83
F	批发和零售业	487,762.20	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	2,949,198.08	3.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,794,362.63	3.12
J	金融业	23,988,784.10	26.75
K	房地产业	3,669,042.39	4.09
L	租赁和商务服务业	1,175,022.24	1.31
M	科学研究和技术服务业	737,108.02	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	13,599.72	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	475,420.22	0.53
R	文化、体育和娱乐业	134,390.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	74,849,749.55	83.47

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末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	601318	中国平安	91,507	4,300,829.00	4.80
2	600036	招商银行	83,134	3,097,572.84	3.45
3	601328	交通银行	633,053	3,000,671.22	3.35
4	601988	中国银行	795,414	2,513,508.24	2.80
5	601939	建设银行	391,273	2,202,866.99	2.46
6	601166	兴业银行	91,200	1,604,208.00	1.79
7	600048	保利发展	88,931	1,345,526.03	1.50
8	001979	招商蛇口	98,173	1,239,924.99	1.38
9	600938	中国海油	76,704	1,165,900.80	1.30
10	601088	中国神华	42,146	1,164,072.52	1.30
11	600900	长江电力	54,493	1,144,353.00	1.28
12	601857	中国石油	224,326	1,114,900.22	1.24
13	601658	邮储银行	230,359	1,064,258.58	1.19
14	000983	山西焦煤	83,974	978,297.10	1.09
15	600030	中信证券	47,068	937,123.88	1.05
16	600123	兰花科创	69,103	921,834.02	1.03
17	601888	中国中免	4,063	877,729.89	0.98
18	600887	伊利股份	27,334	847,354.00	0.94
19	600383	金地集团	82,100	839,883.00	0.94
20	600276	恒瑞医药	21,029	810,247.37	0.90
21	600309	万华化学	8,616	798,272.40	0.89
22	601899	紫金矿业	67,263	672,630.00	0.75
23	000651	格力电器	18,843	609,005.76	0.68
24	603288	海天味业	7,092	564,523.20	0.63
25	603799	华友钴业	9,399	522,866.37	0.58
26	601816	京沪高铁	104,810	515,665.20	0.58
27	601985	中国核电	84,724	508,344.00	0.57
28	601288	农业银行	171,561	499,242.51	0.56
29	600031	三一重工	29,840	471,472.00	0.53

30	002714	牧原股份	9,397	458,103.75	0.51
31	002352	顺丰控股	7,658	442,326.08	0.49
32	601601	中国太保	17,829	437,167.08	0.49
33	600875	东方电气	20,582	432,633.64	0.48
34	600436	片仔癀	1,452	418,843.92	0.47
35	000333	美的集团	8,082	418,647.60	0.47
36	688111	金山办公	1,564	413,662.36	0.46
37	600050	中国联通	91,728	410,941.44	0.46
38	603259	药明康德	5,000	405,000.00	0.45
39	600919	江苏银行	51,887	378,256.23	0.42
40	000725	京东方 A	110,917	374,899.46	0.42
41	002049	紫光国微	2,833	373,446.06	0.42
42	601728	中国电信	88,973	372,796.87	0.42
43	600690	海尔智家	14,969	366,141.74	0.41
44	600104	上汽集团	25,194	363,045.54	0.40
45	600809	山西汾酒	1,273	362,792.27	0.40
46	601727	上海电气	91,300	359,722.00	0.40
47	600028	中国石化	82,445	359,460.20	0.40
48	600893	航发动力	8,497	359,253.16	0.40
49	000807	云铝股份	31,600	351,392.00	0.39
50	600519	贵州茅台	200	345,400.00	0.39
51	002092	中泰化学	45,659	340,616.14	0.38
52	600570	恒生电子	8,291	335,453.86	0.37
53	603501	韦尔股份	4,349	335,264.41	0.37
54	603986	兆易创新	3,258	333,847.26	0.37
55	600546	山煤国际	22,700	328,923.00	0.37
56	300015	爱尔眼科	10,226	317,721.82	0.35
57	601688	华泰证券	24,856	316,665.44	0.35
58	601001	晋控煤业	26,007	311,043.72	0.35
59	601766	中国中车	60,687	310,110.57	0.35
60	601669	中国电建	42,882	303,604.56	0.34

61	601211	国泰君安	22,000	298,980.00	0.33
62	601628	中国人寿	7,997	296,848.64	0.33
63	601668	中国建筑	53,715	291,672.45	0.33
64	600585	海螺水泥	10,633	291,131.54	0.32
65	600660	福耀玻璃	8,212	287,994.84	0.32
66	600009	上海机场	4,955	285,953.05	0.32
67	300122	智飞生物	3,176	278,948.08	0.31
68	600089	特变电工	13,864	278,389.12	0.31
69	600837	海通证券	31,349	272,422.81	0.30
70	600027	华电国际	45,532	267,728.16	0.30
71	601919	中远海控	25,915	266,665.35	0.30
72	000933	神火股份	17,300	258,808.00	0.29
73	300498	温氏股份	13,079	256,740.77	0.29
74	601390	中国中铁	45,458	252,746.48	0.28
75	600426	华鲁恒升	7,581	251,310.15	0.28
76	000063	中兴通讯	9,705	250,971.30	0.28
77	600958	东方证券	27,840	248,889.60	0.28
78	603806	福斯特	3,736	248,219.84	0.28
79	600438	通威股份	6,266	241,742.28	0.27
80	002027	分众传媒	35,895	239,778.60	0.27
81	300142	沃森生物	5,954	239,291.26	0.27
82	600588	用友网络	9,834	237,687.78	0.27
83	300124	汇川技术	3,406	236,717.00	0.26
84	600019	宝钢股份	42,031	234,953.29	0.26
85	002410	广联达	3,876	232,366.20	0.26
86	600600	青岛啤酒	2,148	230,910.00	0.26
87	600150	中国船舶	9,983	222,421.24	0.25
88	601989	中国重工	63,199	220,564.51	0.25
89	600026	中远海能	18,263	220,069.15	0.25
90	600760	中航沈飞	3,711	217,575.93	0.24
91	002475	立讯精密	6,691	212,439.25	0.24

92	600010	包钢股份	109,840	210,892.80	0.24
93	601128	常熟银行	27,473	207,421.15	0.23
94	601186	中国铁建	26,362	203,778.26	0.23
95	601138	工业富联	21,816	200,270.88	0.22
96	600745	闻泰科技	3,769	198,174.02	0.22
97	600547	山东黄金	10,221	195,834.36	0.22
98	600905	三峡能源	34,548	195,196.20	0.22
99	000338	潍柴动力	19,032	193,745.76	0.22
100	600029	南方航空	25,436	193,313.60	0.22
101	601006	大秦铁路	28,880	192,918.40	0.22
102	688012	中微公司	1,967	192,785.67	0.21
103	688008	澜起科技	3,073	192,369.80	0.21
104	600452	涪陵电力	12,449	187,979.90	0.21
105	002179	中航光电	3,229	186,507.04	0.21
106	600795	国电电力	43,538	185,907.26	0.21
107	600176	中国巨石	13,417	183,947.07	0.21
108	600132	重庆啤酒	1,420	180,879.60	0.20
109	300347	泰格医药	1,703	178,474.40	0.20
110	000166	申万宏源	44,595	177,488.10	0.20
111	000895	双汇发展	6,799	176,298.07	0.20
112	600886	国投电力	16,211	175,565.13	0.20
113	002353	杰瑞股份	6,265	174,856.15	0.19
114	601100	恒立液压	2,752	173,788.80	0.19
115	600075	新疆天业	30,995	169,542.65	0.19
116	601800	中国交建	20,660	166,313.00	0.19
117	601868	中国能建	71,944	164,751.76	0.18
118	603290	斯达半导	500	164,650.00	0.18
119	601012	隆基绿能	3,842	162,362.92	0.18
120	600703	三安光电	9,450	162,162.00	0.18
121	600584	长电科技	6,982	160,935.10	0.18
122	688036	传音控股	2,017	160,391.84	0.18

123	600085	同仁堂	3,585	160,177.80	0.18
124	600346	恒力石化	10,277	159,601.81	0.18
125	000937	冀中能源	25,005	159,031.80	0.18
126	000963	华东医药	3,394	158,839.20	0.18
127	603993	洛阳钼业	34,524	157,084.20	0.18
128	600989	宝丰能源	12,913	155,859.91	0.17
129	601377	兴业证券	27,132	155,737.68	0.17
130	600406	国电南瑞	6,339	154,671.60	0.17
131	600115	中国东航	27,402	151,533.06	0.17
132	601111	中国国航	14,218	150,710.80	0.17
133	601333	广深铁路	63,587	144,342.49	0.16
134	300408	三环集团	4,700	144,337.00	0.16
135	601066	中信建投	6,043	143,521.25	0.16
136	603019	中科曙光	6,446	142,714.44	0.16
137	688015	交控科技	5,895	141,480.00	0.16
138	601901	方正证券	22,119	141,119.22	0.16
139	603833	欧派家居	1,151	139,881.03	0.16
140	603392	万泰生物	1,101	139,496.70	0.16
141	601838	成都银行	9,107	139,337.10	0.16
142	600188	兖矿能源	4,149	139,323.42	0.16
143	603882	金域医学	1,754	137,162.80	0.15
144	601633	长城汽车	4,600	136,252.00	0.15
145	000768	中航西飞	5,306	135,037.70	0.15
146	601799	星宇股份	1,056	134,502.72	0.15
147	600741	华域汽车	7,734	134,030.22	0.15
148	002532	天山铝业	17,043	131,571.96	0.15
149	688561	奇安信	1,998	131,408.46	0.15
150	601336	新华保险	4,360	131,148.80	0.15
151	601021	春秋航空	2,020	129,785.00	0.14
152	601238	广汽集团	11,282	124,440.46	0.14
153	603899	晨光股份	2,261	124,309.78	0.14

154	003816	中国广核	45,259	121,746.71	0.14
155	600332	白云山	4,065	121,096.35	0.14
156	603369	今世缘	2,370	120,633.00	0.13
157	600845	宝信软件	2,687	120,377.60	0.13
158	601788	光大证券	8,071	120,015.77	0.13
159	000538	云南白药	2,203	119,755.08	0.13
160	002821	凯莱英	800	118,400.00	0.13
161	601108	财通证券	16,623	118,355.76	0.13
162	300782	卓胜微	1,000	114,300.00	0.13
163	002001	新和成	6,031	113,081.25	0.13
164	000425	徐工机械	22,272	112,919.04	0.13
165	600018	上港集团	21,028	112,289.52	0.13
166	601618	中国中冶	35,274	112,171.32	0.13
167	000157	中联重科	20,600	112,064.00	0.12
168	000938	紫光股份	5,736	111,909.36	0.12
169	600109	国金证券	12,772	111,116.40	0.12
170	000876	新希望	8,412	108,598.92	0.12
171	002050	三花智控	5,107	108,370.54	0.12
172	600362	江西铜业	6,211	108,257.73	0.12
173	000786	北新建材	4,058	105,021.04	0.12
174	601225	陕西煤业	5,563	103,360.54	0.12
175	300759	康龙化成	1,500	102,000.00	0.11
176	002028	思源电气	2,655	101,474.10	0.11
177	300628	亿联网络	1,659	100,518.81	0.11
178	002252	上海莱士	15,801	100,178.34	0.11
179	002007	华兰生物	4,422	100,069.86	0.11
180	600918	中泰证券	15,186	97,342.26	0.11
181	300595	欧普康视	2,722	97,175.40	0.11
182	600803	新奥股份	6,000	96,600.00	0.11
183	600183	生益科技	6,696	96,489.36	0.11
184	688396	华润微	1,798	94,664.70	0.11

185	688065	凯赛生物	1,540	94,386.60	0.11
186	002736	国信证券	10,487	93,124.56	0.10
187	300413	芒果超媒	3,100	93,062.00	0.10
188	002384	东山精密	3,749	92,712.77	0.10
189	000977	浪潮信息	4,300	92,536.00	0.10
190	600061	国投资本	14,426	92,182.14	0.10
191	000733	振华科技	800	91,384.00	0.10
192	601990	南京证券	11,502	91,210.86	0.10
193	002601	龙佰集团	4,795	90,721.40	0.10
194	601898	中煤能源	10,482	90,354.84	0.10
195	600011	华能国际	11,660	88,732.60	0.10
196	002008	大族激光	3,453	88,569.45	0.10
197	002841	视源股份	1,473	86,965.92	0.10
198	002236	大华股份	7,622	86,204.82	0.10
199	002938	鹏鼎控股	3,099	85,036.56	0.09
200	000069	华侨城 A	15,899	84,741.67	0.09
201	601155	新城控股	4,129	84,644.50	0.09
202	600487	亨通光电	5,613	84,531.78	0.09
203	300433	蓝思科技	8,027	84,524.31	0.09
204	688126	沪硅产业	4,675	82,326.75	0.09
205	000066	中国长城	7,978	81,375.60	0.09
206	600941	中国移动	1,173	79,376.91	0.09
207	002120	韵达股份	5,426	78,025.88	0.09
208	600111	北方稀土	3,112	77,955.60	0.09
209	601319	中国人保	14,920	77,882.40	0.09
210	600039	四川路桥	7,000	77,840.00	0.09
211	000783	长江证券	14,603	77,833.99	0.09
212	601878	浙商证券	7,693	76,391.49	0.09
213	601696	中银证券	7,087	74,909.59	0.08
214	603195	公牛集团	522	74,781.72	0.08
215	002555	三七互娱	4,108	74,354.80	0.08

216	002456	欧菲光	15,646	73,692.66	0.08
217	002916	深南电路	1,012	73,015.80	0.08
218	000708	中信特钢	4,143	71,093.88	0.08
219	600606	绿地控股	23,681	70,569.38	0.08
220	601995	中金公司	1,847	70,426.11	0.08
221	002602	世纪华通	18,475	70,389.75	0.08
222	300999	金龙鱼	1,600	69,696.00	0.08
223	600657	信达地产	13,500	69,390.00	0.08
224	688169	石头科技	280	69,370.00	0.08
225	000776	广发证券	4,439	68,760.11	0.08
226	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.08
227	601216	君正集团	17,008	67,861.92	0.08
228	600025	华能水电	10,150	66,990.00	0.07
229	601162	天风证券	22,628	64,942.36	0.07
230	000001	平安银行	4,922	64,773.52	0.07
231	688231	隆达股份	1,828	64,235.92	0.07
232	601966	玲珑轮胎	3,000	61,440.00	0.07
233	601881	中国银河	6,607	61,379.03	0.07
234	301102	兆讯传媒	1,565	57,513.75	0.06
235	002463	沪电股份	4,828	57,453.20	0.06
236	600118	中国卫星	2,659	57,301.45	0.06
237	300896	爱美客	100	56,635.00	0.06
238	688387	信科移动	11,538	56,305.44	0.06
239	300529	健帆生物	1,800	55,746.00	0.06
240	002508	老板电器	1,986	55,131.36	0.06
241	301233	盛帮股份	1,576	54,354.58	0.06
242	688253	英诺特	2,419	53,919.51	0.06
243	605499	东鹏饮料	300	53,370.00	0.06
244	301121	紫建电子	1,013	52,038.59	0.06
245	300601	康泰生物	1,648	51,961.44	0.06
246	301306	西测测试	1,198	51,633.62	0.06

247	601600	中国铝业	11,472	51,279.84	0.06
248	002600	领益智造	11,119	50,480.26	0.06
249	603666	亿嘉和	1,548	49,210.92	0.05
250	300136	信维通信	2,840	46,888.40	0.05
251	002064	华峰化学	6,600	44,880.00	0.05
252	002414	高德红外	3,902	42,922.00	0.05
253	301197	工大科雅	2,085	42,635.96	0.05
254	002032	苏泊尔	861	42,585.06	0.05
255	002180	纳思达	800	41,512.00	0.05
256	002739	万达电影	2,952	41,328.00	0.05
257	600233	圆通速递	2,000	40,180.00	0.04
258	600482	中国动力	2,478	37,888.62	0.04
259	002558	巨人网络	4,625	36,815.00	0.04
260	688184	帕瓦股份	1,056	35,713.92	0.04
261	688132	邦彦技术	1,493	34,040.40	0.04
262	601698	中国卫通	2,809	32,078.78	0.04
263	002673	西部证券	5,194	31,631.46	0.04
264	300760	迈瑞医疗	100	31,597.00	0.04
265	000596	古井贡酒	117	31,227.30	0.03
266	000800	一汽解放	3,790	29,296.70	0.03
267	601022	宁波远洋	1,883	25,420.50	0.03
268	000877	天山股份	2,700	23,004.00	0.03
269	000568	泸州老窖	100	22,428.00	0.03
270	301239	普瑞眼科	294	20,535.60	0.02
271	002493	荣盛石化	1,652	20,319.60	0.02
272	300750	宁德时代	45	17,703.90	0.02
273	002311	海大集团	273	16,852.29	0.02
274	002371	北方华创	73	16,446.90	0.02
275	300223	北京君正	200	14,088.00	0.02
276	301175	中科环保	2,262	13,599.72	0.02
277	301269	华大九天	154	13,542.76	0.02

278	600926	杭州银行	1,031	13,485.48	0.02
279	002241	歌尔股份	730	12,285.90	0.01
280	002230	科大讯飞	346	11,359.18	0.01
281	002304	洋河股份	65	10,432.50	0.01
282	002271	东方雨虹	305	10,238.85	0.01
283	002129	TCL中环	271	10,205.86	0.01
284	300496	中科创达	100	10,030.00	0.01
285	000400	许继电气	393	7,848.21	0.01
286	300033	同花顺	78	7,691.58	0.01
287	600312	平高电气	938	7,419.58	0.01
288	301195	北路智控	100	7,320.60	0.01
289	301139	元道通信	280	7,092.72	0.01
290	002594	比亚迪	25	6,424.25	0.01
291	000002	万科 A	271	4,932.20	0.01
292	601126	四方股份	283	4,131.80	0.00
293	301318	维海德	84	3,517.56	0.00
294	601236	红塔证券	448	3,315.20	0.00
295	300919	中伟股份	50	3,280.50	0.00
296	688390	固德威	10	3,230.90	0.00
297	002415	海康威视	86	2,982.48	0.00
298	300059	东方财富	113	2,192.20	0.00
299	300274	阳光电源	19	2,124.20	0.00
300	600016	民生银行	600	2,070.00	0.00
301	300763	锦浪科技	10	1,800.50	0.00
302	300545	联得装备	100	1,583.00	0.00
303	601229	上海银行	245	1,447.95	0.00
304	000625	长安汽车	100	1,231.00	0.00
305	000100	TCL科技	259	963.48	0.00
306	002142	宁波银行	25	811.25	0.00
307	002466	天齐锂业	9	710.91	0.00
308	688290	景业智能	9	648.72	0.00

309	600497	驰宏锌锗	59	298.54	0.00
310	601077	渝农商行	59	208.27	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	000001	平安银行	8,341,990.00	3.71
2	300750	宁德时代	6,337,841.00	2.82
3	600519	贵州茅台	5,215,458.00	2.32
4	001979	招商蛇口	3,755,189.00	1.67
5	601012	隆基绿能	3,720,033.76	1.65
6	002594	比亚迪	3,582,434.68	1.59
7	600036	招商银行	3,373,527.00	1.50
8	300274	阳光电源	2,817,555.00	1.25
9	601328	交通银行	2,805,758.00	1.25
10	000933	神火股份	2,600,297.00	1.16
11	601988	中国银行	2,553,969.00	1.13
12	601318	中国平安	2,344,340.00	1.04
13	601939	建设银行	2,244,931.00	1.00
14	002142	宁波银行	2,219,820.00	0.99
15	601166	兴业银行	1,913,527.00	0.85
16	002466	天齐锂业	1,587,761.00	0.71
17	600383	金地集团	1,539,357.00	0.68
18	601728	中国电信	1,483,500.00	0.66
19	600048	保利发展	1,439,410.00	0.64
20	600188	兖矿能源	1,426,205.00	0.63

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	600519	贵州茅台	11,641,689.70	5.17
2	000001	平安银行	9,048,893.00	4.02
3	300750	宁德时代	8,128,714.96	3.61
4	002142	宁波银行	7,490,117.50	3.33
5	600941	中国移动	5,056,238.51	2.25
6	600188	兖矿能源	4,896,229.30	2.18
7	601012	隆基绿能	4,380,796.60	1.95
8	002594	比亚迪	4,125,938.60	1.83
9	001979	招商蛇口	3,151,847.00	1.40
10	000858	五粮液	2,739,634.25	1.22
11	600036	招商银行	2,715,330.29	1.21
12	601225	陕西煤业	2,578,990.14	1.15
13	601728	中国电信	2,540,461.00	1.13
14	000933	神火股份	2,450,031.00	1.09
15	300274	阳光电源	2,342,223.75	1.04
16	600905	三峡能源	2,187,693.66	0.97
17	601166	兴业银行	2,123,930.30	0.94
18	002466	天齐锂业	1,907,575.46	0.85
19	000568	泸州老窖	1,826,483.00	0.81
20	603259	药明康德	1,806,303.92	0.80

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	134,742,281.93
卖出股票收入（成交）总额	197,734,762.67

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	5,023,815.89	5.60

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	5,023,815.89	5.60

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	019638	20国债09	48,000	4,862,075.18	5.42
2	010303	03国债(3)	1,600	161,740.71	0.18

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 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，本基金以保持股票仓位平稳与套期保值为目的，通过投资交易活跃、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 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

招商银行（代码：600036）为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前十大持仓证券。2022年3月21日，中国银行保险监督管理委员会对招商银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在偏差、漏报或错报等行为予以行政处罚，罚款300万元。2022年9月9日中国银行保险监督管理委员会对招商银行因个人经营贷款挪用至房地产市场、个人经营贷款“三查”不到位、总行对分支机构管控不力等行为予以行政处罚，罚款460万元。

交通银行（代码：601328）为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前十大持仓证券。2022年3月21日，中国银行保险监督管理委员会对交通银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在偏差、漏报或错报等行为予以行政处罚，罚款420万元。2022年9月9日中国银行保险监督管理委员会对交通银行因个人经营贷款挪用至房地产市场、个人经营贷款“三查”不到位、总行对分支机构管控不力等行为予以行政处罚，罚款500万元。

中国银行（代码：601988）为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前十大持仓证券。2022年3月21日，中国银行保险监督管理委员会对中国银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在偏差、漏报或错报等行为予以行政处罚，罚款480万元。2022年5月26日，中国银行保险监督管理委员会对中国银行理财业务存在违法违规行为予以行政处罚，罚款200万元。

建设银行（代码：601939）为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前十大持仓证券。2022年3月21日，中国银行保险监督管理委员会对建设银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在偏差、漏报或错报等行为予以行政处罚，罚款470万元。2022年9月30日，中国银行保险监督管理委员会对建设银行理财业务存在违法违规行为予以行政处罚，罚款200万元。2022年9月9日中国银行保险监督管理委员会对建设银行因个人经营贷款挪用至房地产市场、个人经营贷款“三查”不到位、总行对分支机构管控不力等行为予以行政处罚，罚款260万元。

兴业银行（代码：601166）为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前十大持仓证券。2022年3月21日，中国银行保险监督管理委员会对兴业银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在偏差、漏报或错报等行为予以行政处罚，罚款350万元。2022年9月28日，中国银行保险监督管理委员会对兴业银行

理财业务存在违法违规行为予以行政处罚，罚款450万元。2022年9月9日，中国银行保险监督管理委员会对兴业银行债券承销业务严重违反审慎经营规则予以行政处罚，罚款150万元。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述证券外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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	19,574.99
2	应收清算款	850,628.56
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	109.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	870,313.39

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§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	438	9,080.13	0.00	0.00%	3,977,098.15	100.00%
中科沃土沃鑫成长混合发起C	19	3,646,694.73	69,229,831.24	99.92%	57,368.55	0.08%
合计	457	160,315.75	69,229,831.24	94.49%	4,034,466.70	5.51%

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	806,880.04	20.29%
	中科沃土沃鑫成长混合发起C	0.00	0.00%
	合计	806,880.04	1.10%

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

截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资、研究部门负责人和本基金基金经理未持有本开放式基金份额。

9.4 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。

§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	27,769,188.21	134,148,193.29
本报告期基金总申购份额	100,791.06	164,229,900.59
减：本报告期基金总赎回份额	23,892,881.12	229,090,894.09
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,977,098.15	69,287,199.79

注：本基金 C 类份额于 2020 年成立，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2022年公司高级管理人员任免情况具体如下：2022年11月16日，罗方女士担任公司财务负责人。

本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内为基金进行审计的会计师事务所是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

11.6.1 管理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及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金托管人及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	110,707,679.69	34.37%	80,960.70	32.70%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	79,397,102.68	24.65%	58,063.17	23.45%	-
东莞证券	2	60,993,003.96	18.94%	56,803.18	22.94%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	62,509,984.84	19.41%	45,713.35	18.46%	-
国信证券	2	2,736,987.00	0.85%	2,001.64	0.81%	-
恒泰	2	-	-	-	-	-

证券						
华泰证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	3,403,729.88	1.06%	2,489.22	1.01%	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	1,728,125.15	0.54%	1,263.80	0.51%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	591,079.49	0.18%	314.36	0.13%	-

注：1、交易席位选择标准：

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

2、交易席位选择流程：

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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	23,669,777.11	34.34%	594,620,000.00	47.20%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东莞证券	43,918,392.32	63.72%	257,500,000.00	20.44%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	100,936.16	0.15%	172,160,000.00	13.67%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	107,511.00	0.16%	123,000,000.00	9.76%	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	1,125,685.37	1.63%	112,500,000.00	8.93%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中科沃土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	中国证券报及基金管理人网站	2022-06-24

	关于新增泰信财富基金为旗下部分基金销售机构的公告	站	
7	中科沃土基金管理有限公司关于新增福克斯（北京）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	2022-06-28
8	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年第二季度报告	中国证券报及基金管理人网站	2022-07-21
9	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	中国证券报及基金管理人网站	2022-08-31
10	中科沃土基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资北交所上市股票的风险提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2022-09-09
11	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	2022-09-19
12	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	2022-09-19
13	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招募说明书更新	中国证券报及基金管理人网站	2022-09-19
14	中科沃土基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证券报及基金管理人网站	2022-09-19
15	中科沃土基金管理有限公司关于新增深圳众禄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	2022-10-13
16	中科沃土基金管理有限公司	中国证券报及基金管理人网	2022-10-22

	北京分公司负责人变更公告	站	
17	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年第三季度报告	中国证券报及基金管理人网站	2022-10-26
18	中科沃土基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报及基金管理人网站	2022-11-17
19	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招募说明书更新	中国证券报及基金管理人网站	2022-11-18
20	中科沃土基金管理有限公司关于终止深圳信诚基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的通知	中国证券报及基金管理人网站	2022-12-01

§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	20220101-20220822	36,302,844.89	31,789,709.75	60,830,000.00	7,262,554.64	9.91%
	2	20220126-20221201	23,089,238.83	50,142,573.96	61,600,000.00	11,631,812.79	15.88%
	3	20220323-20221231	0.00	54,423,991.53	15,400,000.00	39,023,991.53	53.26%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p>							

§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
二〇二三年三月三十日