

中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：众盈基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 8 月 24 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 2026 年 1 月 1 日起至 2026 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	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	43
§ 8 基金份额持有人信息.....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 盈利投资者数量占比.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	44
§ 9 开放式基金份额变动.....	44
§ 10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	45
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	47
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
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.....	48
§ 12 备查文件目录.....	49
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中科沃土沃嘉混合	
基金主代码	004763	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 6 日	
基金管理人	众盈基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	5,341,682.33 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中科沃土沃嘉混合 A	中科沃土沃嘉混合 C
下属分级基金的交易代码	004763	004764
报告期末下属分级基金的份额总额	3,295,331.03 份	2,046,351.30 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活运用资产配置策略及多种股票市场、债券市场投资策略，充分挖掘潜在的投资机会，追求基金资产长期稳定增值。
投资策略	通过对经济周期及资产价格发展变化的理解，在把握经济周期性波动的基础上，动态评估不同资产类在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置及资产的稳健增长。基于稳健投资的理念，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、可转换债券投资策略等；适当参与股指期货、权证、国债期货等金融衍生品的投资，进行分散投资，力求实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数（全价）收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期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。

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		众盈基金管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李峰	胡燕
	联系电话	0757-86208608	0571-87659392
	电子邮箱	lifeng0214@allwinfund.com.cn	zsyhzctgb@czbank.com
客户服务电话		400-018-3610	95527
传真		0757-86208604	0571-88268688

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)	杭州市萧山区鸿宁路 1788 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)	杭州市拱墅区环城西路 76 号
邮政编码	528200	310006
法定代表人	钟光正	陈海强

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.allwinfund.com.cn
基金中期报告置备地点	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	众盈基金管理有限公司	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

基金类别	中科沃土沃嘉混合 A	中科沃土沃嘉混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）	报告期（2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	491,058.69	542,360.33
本期利润	529,835.09	437,994.30
加权平均基金份额本期利润	0.1917	0.1439
本期加权平均净值利润率	10.76%	8.38%
本期基金份额净值增长率	11.06%	10.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 6 月 30 日）	
期末可供分配利润	2,141,100.06	1,222,764.00
期末可供分配基金份额利润	0.6497	0.5975
期末基金资产净值	6,183,785.38	3,721,056.07
期末基金份额净值	1.8765	1.8184

3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 6 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	87.65%	81.84%

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

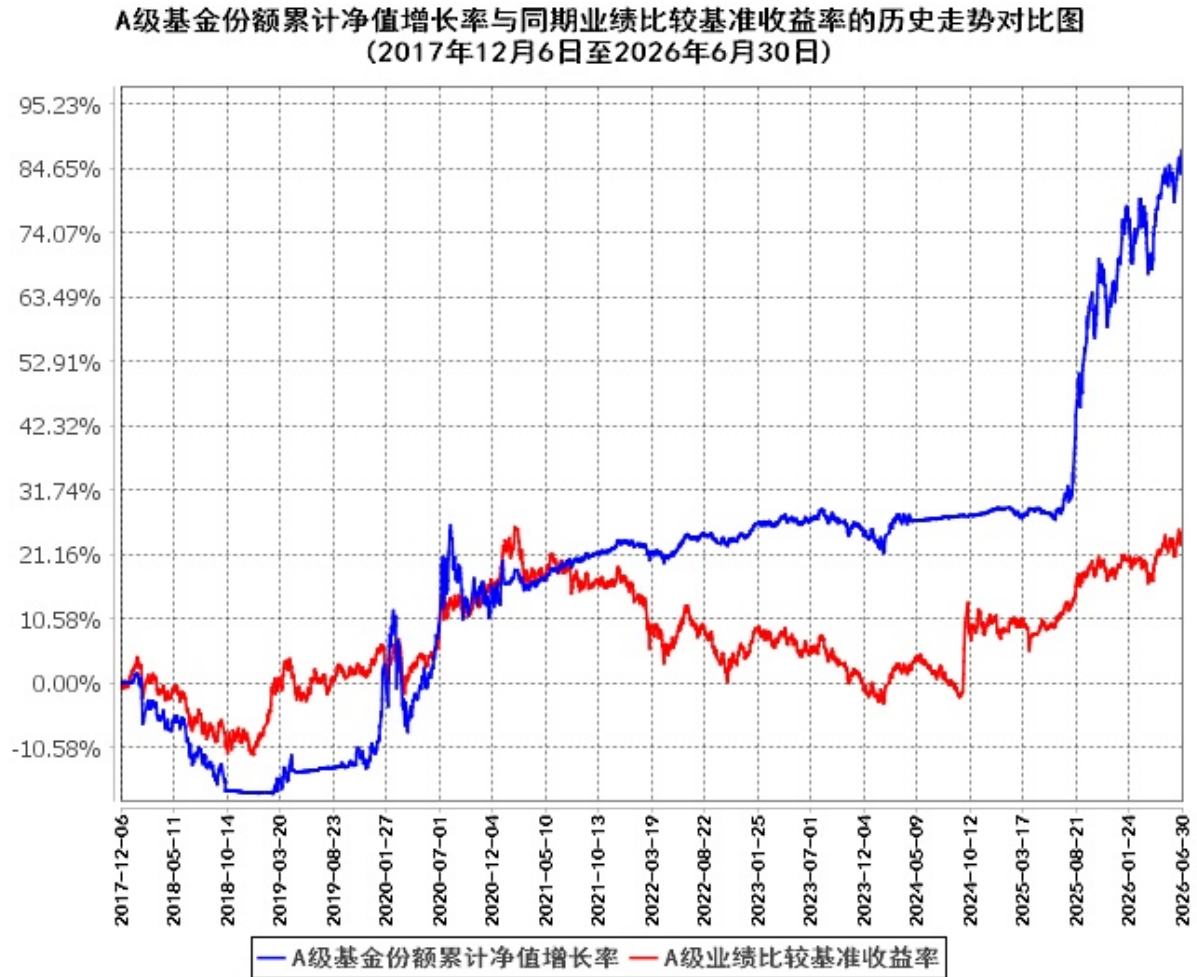
中科沃土沃嘉混合 A

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	11.64%	0.72%	6.23%	0.63%	5.41%	0.09%
过去六个月	11.06%	0.95%	4.37%	0.57%	6.69%	0.38%
过去一年	45.93%	0.96%	12.52%	0.51%	33.41%	0.45%
过去三年	47.93%	0.58%	18.09%	0.55%	29.84%	0.03%
过去五年	56.96%	0.47%	3.69%	0.55%	53.27%	-0.08%
过去七年	119.06%	0.71%	23.44%	0.58%	95.62%	0.13%
自基金合同 生效起至今	87.65%	0.69%	24.26%	0.60%	63.39%	0.09%

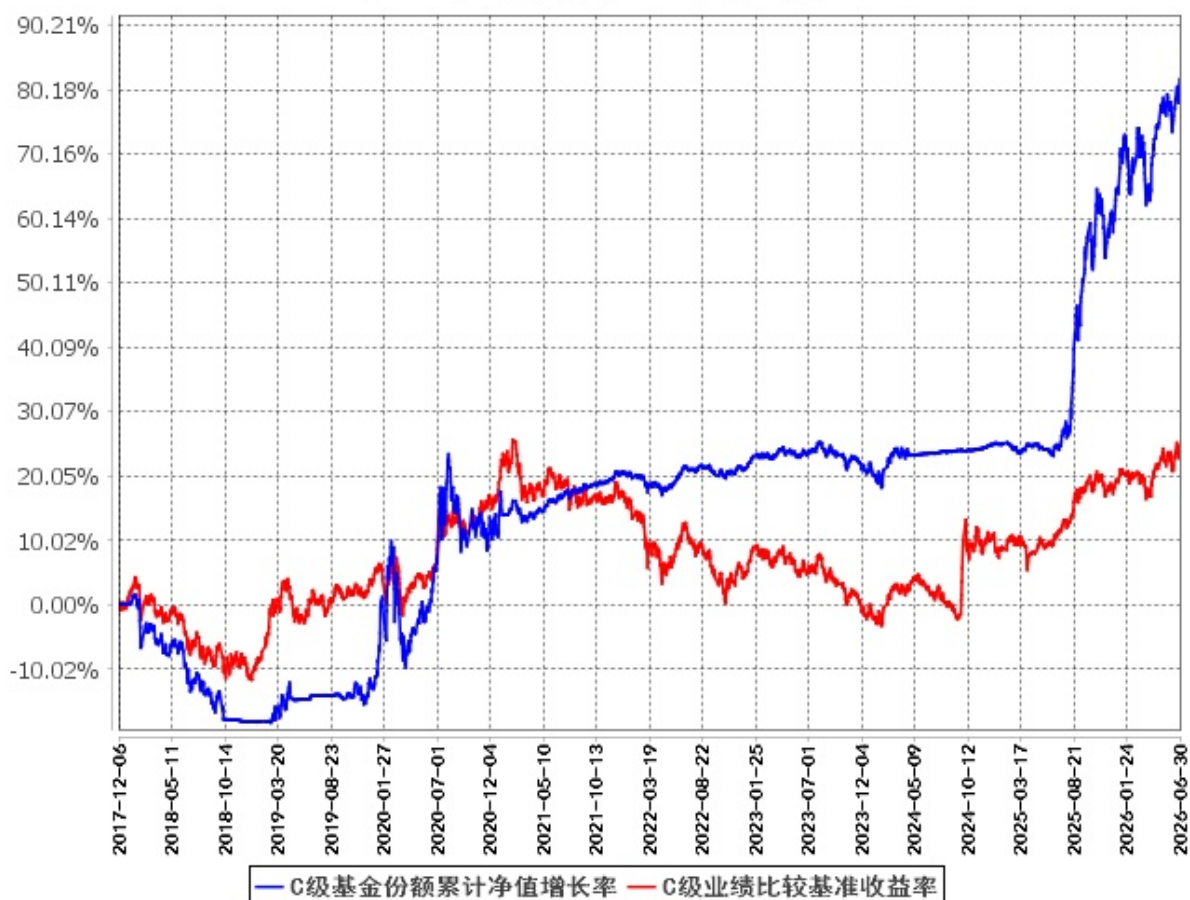
中科沃土沃嘉混合 C

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	11.57%	0.72%	6.23%	0.63%	5.34%	0.09%
过去六个月	10.87%	0.95%	4.37%	0.57%	6.50%	0.38%
过去一年	45.74%	0.96%	12.52%	0.51%	33.22%	0.45%
过去三年	47.05%	0.58%	18.09%	0.55%	28.96%	0.03%
过去五年	55.38%	0.47%	3.69%	0.55%	51.69%	-0.08%
过去七年	112.03%	0.71%	23.44%	0.58%	88.59%	0.13%
自基金合同 生效起至今	81.84%	0.69%	24.26%	0.60%	57.58%	0.09%

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



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2017年12月6日至2026年6月30日)



§ 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

众盈基金管理有限公司获证监会证监许可【2015】1937号文批准，于2015年9月6日正式成立，公司注册资本2.42亿元，是国内第100家公募基金管理公司。经营范围包括公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理等业务。2021年12月，众盈基金总部整体搬迁至佛山市南海区千灯湖创投小镇，成为佛山市唯一持牌公募基金管理机构。众盈基金始终贯彻“为持有人创造长期价值、为股东创造稳定回报、为员工创造持续发展空间”的治理理念，坚持诚信、规范、稳健的经营方针，以“服务最广大持有人”为核心定位，聚焦不同客户的差异化需求，提供专业、精品、创新的理财服务，致力于成为广受投资者信赖的公募品牌和优秀卓越的综合型财富管理平台。截至2026年6月30日，众盈基金旗下共管理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		
徐平安	研究部 副总经理（主 持工 作）、 基金经 理	2024 年 1 月 4 日	-	11 年	金融工程硕士。曾任法国邮政银行基金管理公司混合型基金分析师，安信期货有限责任公司高级金融工程分析师，东兴证券股份有限公司衍生品部投资经理，光大兴陇信托有限责任公司证券市场权益投资部权益类产品投资经理，现任众盈基金管理有限公司研究部副总经理（主持工作），众盈基金管理有限公司旗下中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金和中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
卢振荣	公司总 经理助 理、基 金经理	2025 年 3 月 5 日	2026 年 8 月 5 日	17 年	理学硕士。曾任东莞农商银行总行公司部客户经理、资金中心债券交易岗和票据交易岗，广东省农村信用社资金调剂中心交易员，广东南粤银行金融市场部主管、金融市场部债券交易部总经理、资金运营中心债券部总经理助理，现任众盈基金管理有限公司总经理助理，众盈基金管理有限公司旗下中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土货币市场基金、中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金、中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金的基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。

高晓飞	公募投资部基金经理	2026 年 8 月 3 日	-	9 年	金融管理硕士。曾任上海华瑞银行股份有限公司交易中心交易员，众盈基金管理有限公司集中交易部交易员、交易主管、部门副总经理(主持工作)，现任众盈基金管理有限公司旗下中科沃土货币市场基金、中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、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、中科沃土沃盛纯债债券型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”、“离任日期”为公告确定的聘任、离任日期；

2. 证券从业的含义遵从行业协会的相关规定；

3. 卢振荣于 2026 年 8 月 5 日起不再担任此基金的基金经理，已于 2026 年 8 月 6 日公告。

4. 高晓飞于 2026 年 8 月 3 日起担任此基金的基金经理，已于 2026 年 8 月 4 日公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

2026 年上半年我国经济在曲折中缓慢复苏。

国内方面，一季度末中东美以伊冲突导致全球能源价格抬升，造成国内 PPI 被动大幅上行。能源与原材料价格输入性被动上涨的同时社会居民购买力并没有显著改善，内需消费复苏形势明显低于市场预期，5 月社会零售单月增速甚至出现负增长。外需出口方面，上半年外需保持较强韧性，约 17% 的同比出口增速一定程度上对冲了内需的疲软。生产方面，国内工业供给总体保持韧性但结构化分化加剧。人工智能浪潮下 AI、半导体、数据中心等高科技制造方向维持较高景气，而补贴退坡后汽车、家电等传统制造领域则持续承压。投资方面，地产与基建等相关产业链继续低位摩底，仍是社会需求复苏和信用扩张的最大拖累。总体来看，新旧动能分化是上半年国内经济复苏缓慢的关键结构特征，外需和科技链维持景气，地产、消费及传统周期持续低迷。

海外方面，一季度末中东美以伊朗爆发大规模军事冲突，海湾石化能源供应链遭到严重冲击，国际能源价格大幅走高，全球风险资产大幅波动。进入二季度后中东局势的逐步缓和，地缘冲突对于全球市场的冲击逐步减弱与钝化，资本市场重新追逐 AI 技术等产业高景气方向。全球半导体产业继续保持极高景气度，存储、芯片及相关配套产业持续处于超级周期。但需要注意，欧美高通胀背景下宏观流动性存在收紧的可能，下半年美联储可能进行的加息操作或对资本市场形成一定冲击。

资本市场方面，上半年人工智能技术的发展与迭代是全球市场最重要的投资主线，虽然中东地缘局势一度对市场造成阶段性冲击，但资本市场在人工智能技术加速迭代的高景气背景下呈现出极端的结构性分化行情。AI 算力、半导体超级周期驱动下电子、通信等硬科技板块持续上行，而消费、周期与地产链等传统行业则持续承压。

报告期内，管理人持续跟踪人工智能技术发展趋势，谨慎参与了 AI 算力硬件、半导体设备与材料等硬科技板块的投资机会。后续管理人将继续勤勉尽责，把握下半年权益市场中新质生产力方向的投资机会，力争继续提高组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中科沃土沃嘉混合 A 的基金份额净值为 1.8765 元，本报告期基金份额净值增长率为 11.06%；截至本报告期末中科沃土沃嘉混合 C 的基金份额净值为 1.8184 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.87%；同期业绩比较基准收益率为 4.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，人工智能产业与传统产业的 K 型分化或将持续，通胀粘性下海外宏观流动性的紧缩风险也无法忽视。叠加上半年科技板块积累了过高的涨幅，下半年资本市场或迎来更多的不确定性。科技板块交易局部过热后或面临较大调整压力，金融、医药、公用事业等不乏基本面亮点且股价相对较低的传统行业或迎来底部反弹，成长风格相对价值风格可能出现收敛，下半年市场或迎来新一轮风格再平衡。

2026 年下半年，基金管理人将持续规范运作，勤勉尽责。本产品将审慎应对市场风险，努力把握资本市场的投资机会，在保证流动性安全的前提下力争提高基金产品的收益率。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日以上基金资产净值低于五千万元的情形，已向监管部门提交解决方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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—众盈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、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在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真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对众盈基金管理有限公司编制和披露的中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金 2026 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复核，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：中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,841,719.06	2,014,246.12
结算备付金		3,198,041.94	22,755.41
存出保证金		10,844.14	4,306.79
交易性金融资产	6.4.7.2	3,845,941.00	6,112,081.00
其中：股票投资		3,845,941.00	6,112,081.00
基金投资		—	—
债券投资		—	—
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	-	-
应收清算款		1,093,777.79	-
应收股利		-	-
应收申购款		26,959.11	33,687.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	18,600.00	14,758.96
资产总计		10,035,883.04	8,201,835.30
负债和净资产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025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		-	-
应付清算款		-	17,701.13
应付赎回款		101,643.93	31,959.92
应付管理人报酬		6,516.73	5,434.67
应付托管费		1,221.90	1,019.02
应付销售服务费		662.62	691.18
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	20,996.41	20,221.49
负债合计		131,041.59	77,027.41
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	5,341,682.33	4,881,412.30
未分配利润	6.4.7.8	4,563,159.12	3,243,395.59
净资产合计		9,904,841.45	8,124,807.89
负债和净资产总计		10,035,883.04	8,201,835.30

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 5,341,682.33 份，其中中科沃土沃嘉混合 A 基金份额净值 1.8765 元，基金份额总额 3,295,331.03 份；中科沃土沃嘉混合 C 基金份额净值 1.8184 元，基金份额总额 2,046,351.30 份。

6.2 利润表

会计主体：中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,020,707.21	-368,518.37
1. 利息收入		10,320.30	60,029.55
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,352.95	2,076.35
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,967.35	57,953.20
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,065,444.36	903,146.06
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,034,054.64	20,181.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	881,599.16
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.14	31,389.72	1,365.21
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-65,589.63	-1,332,488.65
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	10,532.18	794.67
减：二、营业总支出		52,877.82	679,093.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	40,164.23	408,200.22
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,530.83	76,537.53
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,182.76	43,013.98
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	24,740.80
其中：卖出回购金融资产支出		-	24,740.80
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用		-	126,600.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		967,829.39	-1,047,611.86
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		967,829.39	-1,047,611.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		967,829.39	-1,047,611.86

6.3 净资产变动表

会计主体：中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 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	4,881,412.30	-	3,243,395.59	8,124,807.89
二、本期期初净资产	4,881,412.30	-	3,243,395.59	8,124,807.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	460,270.03	-	1,319,763.53	1,780,033.56
（一）、综合收益总额	-	-	967,829.39	967,829.39
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	460,270.03	-	351,934.14	812,204.17
其中：1. 基金申购款	4,547,415.44	-	3,380,849.45	7,928,264.89
2. 基金赎回款	-4,087,145.41	-	-3,028,915.31	-7,116,060.72
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	5,341,682.33	-	4,563,159.12	9,904,841.45
项目	上年度可比期间			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 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	137,464,806.61	-	37,103,618.56	174,568,425.17
二、本期期初净资产	137,464,806.61	-	37,103,618.56	174,568,425.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-135,518,857.33	-	-36,565,551.43	-172,084,408.76
（一）、综合收益总额	-	-	-1,047,611.86	-1,047,611.86
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-135,518,857.33	-	-35,517,939.57	-171,036,796.90
其中：1. 基金申购款	167,180.55	-	42,929.88	210,110.43
2. 基金赎回款	-135,686,037.88	-	-35,560,869.45	-171,246,907.33
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,945,949.28	-	538,067.13	2,484,016.41

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：

钟光正	李峰	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

中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]第 625 号关于准予《中科沃土沃嘉灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由众盈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《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 205,055,950.09 元，业经安

永华明会计师事务所(特殊普通合伙) 安永华明(2017)验字第 61247680_G05 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 205,162,272.11 份基金份额,其中认购资金利息折合 106,322.02 份基金份额。本基金的基金管理人为众盈基金管理有限公司,基金托管人为浙商银行股份有限公司(以下简称“浙商银行”)。

根据《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/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。在投资人认购/申购时收取认购/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、不收取认购/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《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市交易的股票(包括中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票)、权证、股指期货、国债期货、债券(包括但不限于国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款,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。本基金投资组合中股票占基金资产的比例为 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,应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,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 $\times$ 50%+中债综合指数(全价)收益率 $\times$ 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、《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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集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>》、《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连

续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于本期末，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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[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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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。2027 年

12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,841,719.06
等于：本金	1,841,684.89
加：应计利息	34.17
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	1,841,719.06

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		3,838,983.25	-	3,845,941.00	6,957.75
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,838,983.25	-	3,845,941.00	6,957.75

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	18,600.00
待摊费用	-
合计	18,600.00

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	26.81
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	11,669.60
其中：交易所市场	11,669.60
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	9,300.00
合计	20,996.41

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中科沃土沃嘉混合 A		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,400,443.91	2,400,443.91
本期申购	1,894,236.42	1,894,236.42
本期赎回(以“-”号填列)	-999,349.30	-999,349.30
本期末	3,295,331.03	3,295,331.03

金额单位：人民币元

中科沃土沃嘉混合 C	
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,480,968.39	2,480,968.39
本期申购	2,653,179.02	2,653,179.02
本期赎回（以“-”号填列）	-3,087,796.11	-3,087,796.11
本期末	2,046,351.30	2,046,351.30

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中科沃土沃嘉混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,130,904.79	524,538.24	1,655,443.03
本期期初	1,130,904.79	524,538.24	1,655,443.03
本期利润	491,058.69	38,776.40	529,835.09
本期基金份额交易产生的变动数	519,136.58	184,039.65	703,176.23
其中：基金申购款	1,088,877.02	383,757.13	1,472,634.15
基金赎回款	-569,740.44	-199,717.48	-769,457.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,141,100.06	747,354.29	2,888,454.35

单位：人民币元

中科沃土沃嘉混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,059,861.14	528,091.42	1,587,952.56
本期期初	1,059,861.14	528,091.42	1,587,952.56
本期利润	542,360.33	-104,366.03	437,994.30
本期基金份额交易产生的变动数	-379,457.47	28,215.38	-351,242.09
其中：基金申购款	1,308,776.51	599,438.79	1,908,215.30
基金赎回款	-1,688,233.98	-571,223.41	-2,259,457.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,222,764.00	451,940.77	1,674,704.77

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	563.46
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	3,775.61
其他	13.88
合计	4,352.95

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	25,687,312.73
减：卖出股票成本总额	24,614,919.97
减：交易费用	38,338.12
买卖股票差价收入	1,034,054.64

6.4.7.11 债券投资收益

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

注：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

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	31,389.72
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	31,389.72

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-65,589.63
——股票投资	-65,589.63
——债券投资	—
——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	-65,589.63

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	10,532.18
合计	10,532.18

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。

6.4.7.17 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

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

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
浙商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
众盈基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

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 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	40,164.23	408,200.22
其中：应支付销售机构的客户维护费	16,525.62	2,319.89
应支付基金管理人的净管理费	23,638.61	405,880.33

注：支付基金管理人众盈基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%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 × 0.80% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,530.83	76,537.53

注：支付基金托管人浙商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%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 × 0.15% / 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃嘉混合 A	中科沃土沃嘉混合 C	合计
众盈基金	-	0.29	0.29
浙商银行	-	1.81	1.81
合计	-	2.10	2.10
获得销售服务费 的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃嘉混合 A	中科沃土沃嘉混合 C	合计
众盈基金	-	42,343.18	42,343.18
浙商银行	-	-	-
合计	-	42,343.18	42,343.18

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，按月支付给众盈基金，再由众盈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 × 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：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。

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

注：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。

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

注：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。

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

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行股份有限公司	1,841,719.06	563.46	1,122,639.89	1,668.37

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：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

注：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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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浙商银行，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

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。

于本报告期末，本基金的卖出回购金融资产款（若有）计息且利息金额不重大；除此之外，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，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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值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。

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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有货币资金、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,841,719.06	-	-	-	-	-	1,841,719.06
结算备付金	3,198,041.94	-	-	-	-	-	3,198,041.94
存出保证金	10,844.14	-	-	-	-	-	10,844.14
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,845,941.00	3,845,941.00
应收清算款	-	-	-	-	-	1,093,777.79	1,093,777.79
应收申购款	-	-	-	-	-	26,959.11	26,959.11
其他资产	-	-	-	-	-	18,600.00	18,600.00
资产总计	5,050,605.14	-	-	-	-	4,985,277.90	10,035,883.04
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	101,643.93	101,643.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,516.73	6,516.73
应付托管费	-	-	-	-	-	1,221.90	1,221.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-	662.62	662.62
其他负债	-	-	-	-	-	20,996.41	20,996.41
负债总计	-	-	-	-	-	131,041.59	131,041.59

利率敏感度缺口	5,050,605.14	-	-	-	-	-4,854,236.31	9,904,841.45
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	2,014,246.12	-	-	-	-	-	2,014,246.12
结算备付金	22,755.41	-	-	-	-	-	22,755.41
存出保证金	4,306.79	-	-	-	-	-	4,306.79
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-6,112,081.00	6,112,081.00
应收申购款	-	-	-	-	-	33,687.02	33,687.02
其他资产	-	-	-	-	-	14,758.96	14,758.96
资产总计	2,041,308.32	-	-	-	-	-6,160,526.98	8,201,835.30
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	17,701.13	17,701.13
应付赎回款	-	-	-	-	-	31,959.92	31,959.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,434.67	5,434.67
应付托管费	-	-	-	-	-	1,019.02	1,019.02
应付销售服务费	-	-	-	-	-	691.18	691.18
其他负债	-	-	-	-	-	20,221.49	20,221.49
负债总计	-	-	-	-	-	77,027.41	77,027.41
利率敏感度缺口	2,041,308.32	-	-	-	-	-6,083,499.57	8,124,807.89

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

注：于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（上年度末：同）。

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	3,845,941.00	38.83	6,112,081.00	75.23
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	3,845,941.00	38.83	6,112,081.00	75.23

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	168,477.80	476,956.66
	沪深 300 指数下降 5%	-168,477.80	-476,956.66

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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	3,845,941.00	6,002,993.00
第二层次	—	109,088.00
第三层次	—	—
合计	3,845,941.00	6,112,081.00

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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上期末：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	3,845,941.00	38.32
	其中：股票	3,845,941.00	38.32
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	5,039,761.00	50.22
8	其他各项资产	1,150,181.04	11.46
9	合计	10,035,883.04	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	—	—
B	采矿业	156,160.00	1.58
C	制造业	2,770,417.00	27.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	343,520.00	3.47
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	575,844.00	5.81
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,845,941.00	38.83

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通标的股票。

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	002475	立讯精密	5,000	352,000.00	3.55
2	688008	澜起科技	800	247,920.00	2.50
3	603308	应流股份	4,000	241,600.00	2.44
4	301216	万凯新材	9,800	225,302.00	2.27
5	601211	国泰海通	12,000	218,400.00	2.20
6	601688	华泰证券	9,000	185,580.00	1.87
7	002179	中航光电	4,000	184,800.00	1.87
8	601021	春秋航空	4,000	182,320.00	1.84
9	002371	北方华创	200	176,912.00	1.79
10	601318	中国平安	3,600	171,864.00	1.74
11	301338	凯格精机	1,000	162,890.00	1.64
12	601156	东航物流	10,000	161,200.00	1.63
13	601088	中国神华	4,000	156,160.00	1.58
14	603379	三美股份	2,000	151,780.00	1.53
15	603766	隆鑫通用	12,000	143,160.00	1.45
16	002222	福晶科技	1,500	138,420.00	1.40
17	300661	圣邦股份	800	114,784.00	1.16
18	300776	帝尔激光	500	107,480.00	1.09
19	605117	德业股份	1,000	106,180.00	1.07
20	300476	胜宏科技	300	103,929.00	1.05
21	688548	广钢气体	1,700	88,570.00	0.89
22	600276	恒瑞医药	1,600	83,264.00	0.84
23	600563	法拉电子	400	76,320.00	0.77
24	688390	固德威	600	65,106.00	0.66

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	601021	春秋航空	521,130.00	6.41
2	603986	兆易创新	508,679.00	6.26
3	000830	鲁西化工	479,920.00	5.91
4	600346	恒力石化	452,350.00	5.57
5	301216	万凯新材	423,556.00	5.21
6	002475	立讯精密	408,500.00	5.03
7	603259	药明康德	385,978.00	4.75
8	002156	通富微电	374,841.00	4.61
9	603308	应流股份	374,376.00	4.61
10	301338	凯格精机	362,534.00	4.46
11	002222	福晶科技	348,455.00	4.29
12	300395	菲利华	333,253.00	4.10
13	301511	德福科技	325,900.00	4.01
14	300347	泰格医药	318,680.00	3.92
15	300502	新易盛	315,399.00	3.88
16	601688	华泰证券	304,800.00	3.75
17	601088	中国神华	286,065.00	3.52
18	600183	生益科技	283,154.00	3.49
19	603296	华勤技术	276,880.00	3.41
20	300857	协创数据	264,116.00	3.25
21	605117	德业股份	263,890.00	3.25
22	601318	中国平安	262,704.00	3.23
23	002371	北方华创	253,430.00	3.12
24	002126	银轮股份	251,300.00	3.09
25	601816	京沪高铁	250,800.00	3.09
26	300373	扬杰科技	249,480.00	3.07
27	002895	川恒股份	246,720.00	3.04
28	002463	沪电股份	241,060.00	2.97
29	600426	华鲁恒升	230,776.48	2.84
30	600803	新奥股份	224,320.00	2.76
31	601156	东航物流	223,840.00	2.76
32	002384	东山精密	218,310.00	2.69
33	600123	兰花科创	211,100.00	2.60
34	002353	杰瑞股份	207,588.00	2.55
35	601211	国泰海通	206,560.00	2.54
36	688548	广钢气体	206,300.00	2.54

37	688041	海光信息	201,920.00	2.49
38	601689	拓普集团	201,764.00	2.48
39	603228	景旺电子	201,150.00	2.48
40	688008	澜起科技	196,690.00	2.42
41	688147	微导纳米	191,601.30	2.36
42	000902	新洋丰	191,400.00	2.36
43	002270	华明装备	188,380.00	2.32
44	002532	天山铝业	183,000.00	2.25
45	603766	隆鑫通用	181,280.00	2.23
46	600115	中国东航	180,600.00	2.22
47	600886	国投电力	179,040.00	2.20
48	605090	九丰能源	177,365.00	2.18
49	600276	恒瑞医药	176,000.00	2.17
50	002594	比亚迪	174,240.00	2.14
51	688072	拓荆科技	172,800.00	2.13
52	300814	中富电路	171,641.00	2.11
53	300661	圣邦股份	167,895.00	2.07
54	002179	中航光电	165,560.00	2.04
55	301018	申菱环境	165,225.00	2.03
56	600674	川投能源	162,600.00	2.00

注：买入金额按买入成交金额(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	603986	兆易创新	814,766.00	10.03
2	002384	东山精密	483,460.00	5.95
3	000830	鲁西化工	434,000.00	5.34
4	601021	春秋航空	431,520.00	5.31
5	301511	德福科技	422,050.00	5.19
6	002156	通富微电	405,450.00	4.99
7	600346	恒力石化	400,200.00	4.93
8	603259	药明康德	398,970.00	4.91
9	300395	菲利华	390,778.00	4.81
10	300750	宁德时代	385,604.00	4.75
11	600183	生益科技	385,252.00	4.74
12	002895	川恒股份	385,150.00	4.74
13	688347	华虹宏力	383,264.00	4.72
14	300502	新易盛	375,936.00	4.63
15	002916	深南电路	355,611.00	4.38
16	600584	长电科技	349,284.00	4.30

17	000988	华工科技	338,400.00	4.17
18	300814	中富电路	335,768.00	4.13
19	300373	扬杰科技	313,286.00	3.86
20	300347	泰格医药	312,501.00	3.85
21	603179	新泉股份	309,158.00	3.81
22	603296	华勤技术	307,297.00	3.78
23	300857	协创数据	295,897.00	3.64
24	002463	沪电股份	283,426.00	3.49
25	601225	陕西煤业	278,572.00	3.43
26	002409	雅克科技	276,491.00	3.40
27	688041	海光信息	272,916.00	3.36
28	603308	应流股份	270,480.00	3.33
29	002126	银轮股份	269,000.00	3.31
30	601138	工业富联	257,730.00	3.17
31	301338	凯格精机	253,000.00	3.11
32	300274	阳光电源	241,495.00	2.97
33	300570	太辰光	236,350.00	2.91
34	601816	京沪高铁	236,000.00	2.90
35	688548	广钢气体	227,559.76	2.80
36	300476	胜宏科技	224,884.00	2.77
37	001309	德明利	223,200.00	2.75
38	002353	杰瑞股份	222,000.00	2.73
39	601689	拓普集团	212,960.00	2.62
40	601688	华泰证券	211,737.00	2.61
41	688147	微导纳米	211,699.05	2.61
42	601318	中国平安	207,960.00	2.56
43	688072	拓荆科技	200,313.00	2.47
44	600803	新奥股份	200,051.00	2.46
45	600123	兰花科创	198,500.00	2.44
46	605090	九丰能源	191,580.00	2.36
47	002222	福晶科技	190,982.00	2.35
48	600938	中国海油	189,960.00	2.34
49	603067	振华股份	188,376.00	2.32
50	601156	东航物流	188,200.00	2.32
51	601898	中煤能源	187,156.00	2.30
52	600426	华鲁恒升	177,900.00	2.19
53	603228	景旺电子	177,895.00	2.19
54	301217	铜冠铜箔	176,200.00	2.17
55	301018	申菱环境	175,108.00	2.16
56	000021	深科技	174,720.00	2.15
57	603186	华正新材	168,320.00	2.07
58	002407	多氟多	167,100.00	2.06
59	002138	顺络电子	166,830.00	2.05

60	300567	精测电子	163,250.00	2.01
61	301216	万凯新材	162,624.00	2.00

注：卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	22,414,369.60
卖出股票收入（成交）总额	25,687,312.73

注：买入股票成本、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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：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

注：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

注：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，本基金未参与股指期货投资。

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

本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	10,844.14
2	应收清算款	1,093,777.79
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	26,959.11
6	其他应收款	18,600.00
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,150,181.04

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§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 土沃嘉 混合 A	522	6,312.89	1,229.60	0.04%	3,294,101.43	99.96%
中科沃 土沃嘉 混合 C	554	3,693.77	—	—	2,046,351.30	100.00%
合计	1,076	4,964.39	1,229.60	0.02%	5,340,452.73	99.98%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比	81.31%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本公司的从业人员未持有本开放式基金份额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：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 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中科沃土沃嘉混合 A	中科沃土沃嘉混合 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 6 日）基金份额总额	32,667,493.83	172,494,778.28
本报告期期初基金份额总额	2,400,443.91	2,480,968.39
本报告期基金总申购份额	1,894,236.42	2,653,179.02
减：本报告期基金总赎回份额	999,349.30	3,087,796.11
本报告期基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	—	—
本报告期末基金份额总额	3,295,331.03	2,046,351.30

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

§ 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，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议审议了《关于持续运作中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金的议案》。根据计票结果，本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一），未达到《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》规定的关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的有效开会条件。基金管理人于 2026 年 5 月 13 日发布《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》。

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，本基金管理人于 2026 年 2 月 9 日起，新聘任钟光正为总经理，于建伟不再担任总经理职务；经佛山市南海区市场监督管理局核准，本基金管理人法定代表人变更为钟光正，于建伟不再担任法定代表人，已于 2026 年 2 月 12 日公告。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本报告期内本基金投资策略无重大改变。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人相关从业人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
华创证券	1	24,603,025.99	51.15%	11,462.37	51.15%	—
长江证券	2	23,498,656.34	48.85%	10,948.07	48.85%	—
华西证券	2	—	—	—	—	—

注：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 基金租用或者通过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	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
-----	------	--------	------	------

称	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
华创证券	-	-	101,000,000.00	98.36%	-	-	-	-
长江证券	-	-	1,680,000.00	1.64%	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	中科沃土基金管理有限公司关于新增上海利得基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 15 日
2	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 22 日
3	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	中国证监会规定媒介	2026 年 2 月 10 日
4	中科沃土基金管理有限公司关于变更公司法定代表人的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 2 月 12 日
5	中科沃土基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 2 月 13 日
6	中科沃土基金管理有限公司关于终止江西正融基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 27 日
7	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 31 日
8	中科沃土基金管理有限公司关于新增排排网销售为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 1 日
9	中科沃土基金管理有限公司关于终止武汉佰鲲基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 2 日
10	中科沃土基金管理有限公司关于终止中证金牛(北京)投资咨询有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 2 日
11	中科沃土基金管理有限公司关于以通讯方式召开中科沃土沃嘉灵活配置混	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 7 日

	合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告		
12	中科沃土基金管理有限公司关于以通讯方式召开中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 8 日
13	中科沃土基金管理有限公司关于以通讯方式召开中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 9 日
14	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 17 日
15	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新 C 类份额	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 17 日
16	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新 A 类份额	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 17 日
17	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金 2026 年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 22 日
18	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 5 月 13 日
19	中科沃土基金管理有限公司关于关闭直销网上交易平台、微信服务号部分业务服务的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 4 日
20	中科沃土基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 27 日
21	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同更新	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

个人	1	2026 年 1 月 1 日 -2026 年 1 月 6 日	994,687.84	-	-	994,687.84	18.62%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。本基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，有效防控产品流动性风险，在运作中保持合适的流动性水平，保护持有人利益。							

§ 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嘉灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
- 2. 《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3. 《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5. 关于申请募集注册中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书；
- 6. 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。

众盈基金管理有限公司
2026 年 8 月 28 日