

中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券
投资基金
2020 年年度报告

2020 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2020 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.....	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、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 其他指标.....	错误! 未定义书签。
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	20
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.....	20
§6 审计报告	21
6.1 审计报告基本信息.....	21
6.2 审计报告的基本内容.....	23
§7 年度财务报表	24
7.1 资产负债表.....	24
7.2 利润表.....	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	26
7.4 报表附注.....	27
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	54
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.....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	83
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.....	83

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	83
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	83
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	83
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	83
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	84
8.12 投资组合报告附注	84
§ 9 基金份额持有人信息	86
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	86
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	86
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的情况	86
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	87
§ 10 开放式基金份额变动	88
§ 11 重大事件揭示	89
11.1 基金份额持有人大会决议	89
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	89
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	89
11.4 基金投资策略的改变	89
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	89
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	89
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	89
11.8 其他重大事件	90
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	92
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	92
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	错误! 未定义书签。
§ 13 备查文件目录	93
13.1 备查文件目录	93
13.2 存放地点	93
13.3 查阅方式	93

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	中科沃土沃瑞混合发起	
基金主代码	005855	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 1 月 14 日	
基金管理人	中科沃土基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	28,138,944.20 份	
下属分级基金的基金简称:	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C
下属分级基金的交易代码:	005855	005856
报告期末下属分级基金的份额总额	17,688,154.37 份	10,450,789.83 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过系统化的方法精选环境、财务可持续的上市公司，通过精选个股和风险控制，力争为投资者创造超越业绩比较基准的回报。
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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数(全价)收益率×40%
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、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	中科沃土基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曹萍
	联系电话	020-37128608
	电子邮箱	caoping@richlandasm.com.cn
客户服务电话	400-018-3610	95559
传真	020-23388997	021-62701216
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)	中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	广东省广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 21 楼 01 单元自编 06-08 号	中国(上海)长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	510620	200336
法定代表人	于建伟	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 21 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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	广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 2107

§ 3 主要财务指标、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	2020 年		2019 年 1 月 14 日(基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日	
	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C
本期已实现收益	15,732,144.93	15,735,002.75	1,629,784.08	228,226.17
本期利润	17,421,588.17	17,366,496.69	2,330,707.66	320,470.63
加权平均基金份额本期利润	1.1277	1.4939	0.2315	0.2347
本期加权平均净值利润率	63.78%	84.17%	21.36%	21.71%
本期基金份额净值增长率	81.25%	80.93%	23.13%	22.26%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末	
期末可供分配利润	18,665,323.65	10,831,649.90	1,723,450.60	252,381.41
期末可供分配基金份额利润	1.0552	1.0364	0.1613	0.1530
期末基金资产净值	39,474,849.06	23,118,069.46	13,151,728.93	2,017,302.10
期末基金份额净值	2.2317	2.2121	1.2313	1.2226
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末	
基金份额累计净值增长率	123.17%	121.21%	23.13%	22.26%

带格式表格

注：1. 本基金合同生效日为 2019 年 1 月 14 日，上年度可比期间数据不完整。

2. 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。

3. 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。

4. 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

中科沃土沃瑞混合发起 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	18.13%	1.63%	8.41%	0.59%	9.72%	1.04%
过去六个月	33.10%	1.68%	14.75%	0.80%	18.35%	0.88%
过去一年	81.25%	1.57%	16.30%	0.85%	64.95%	0.72%
自基金合同生效起至今	123.17%	1.35%	41.30%	0.80%	81.87%	0.55%

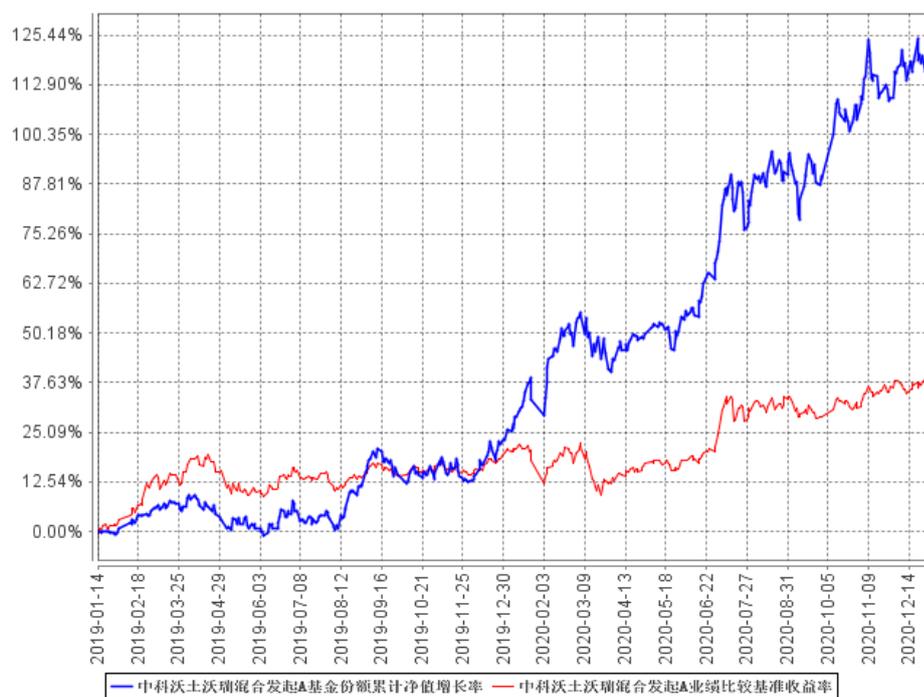
中科沃土沃瑞混合发起 C

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	17.99%	1.63%	8.41%	0.59%	9.58%	1.04%
过去六个月	32.41%	1.68%	14.75%	0.80%	17.66%	0.88%
过去一年	80.93%	1.57%	16.30%	0.85%	64.63%	0.72%
自基金合同生效起至今	121.21%	1.35%	41.30%	0.80%	79.91%	0.55%

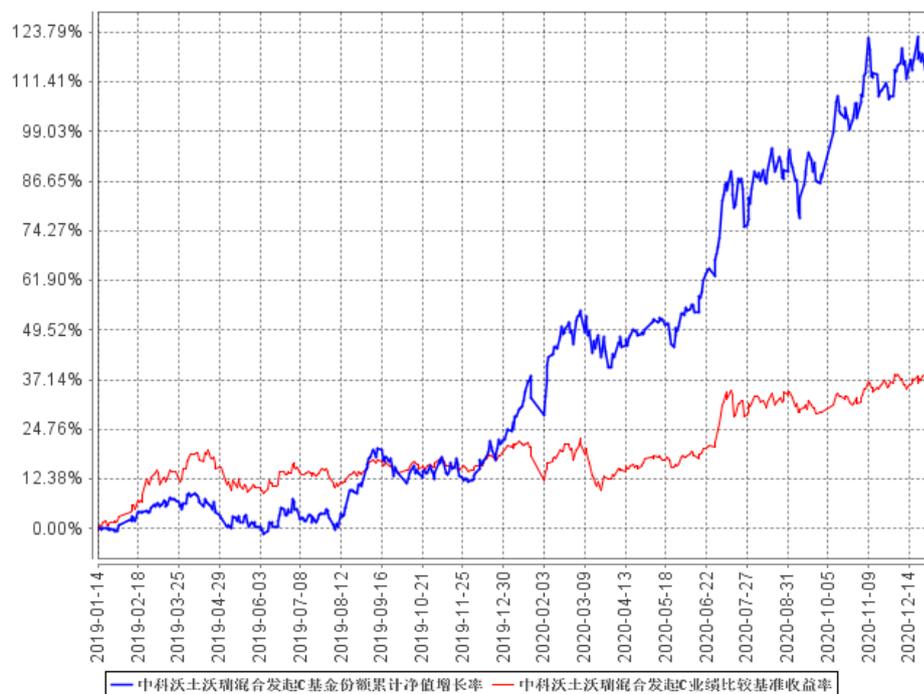
注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

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



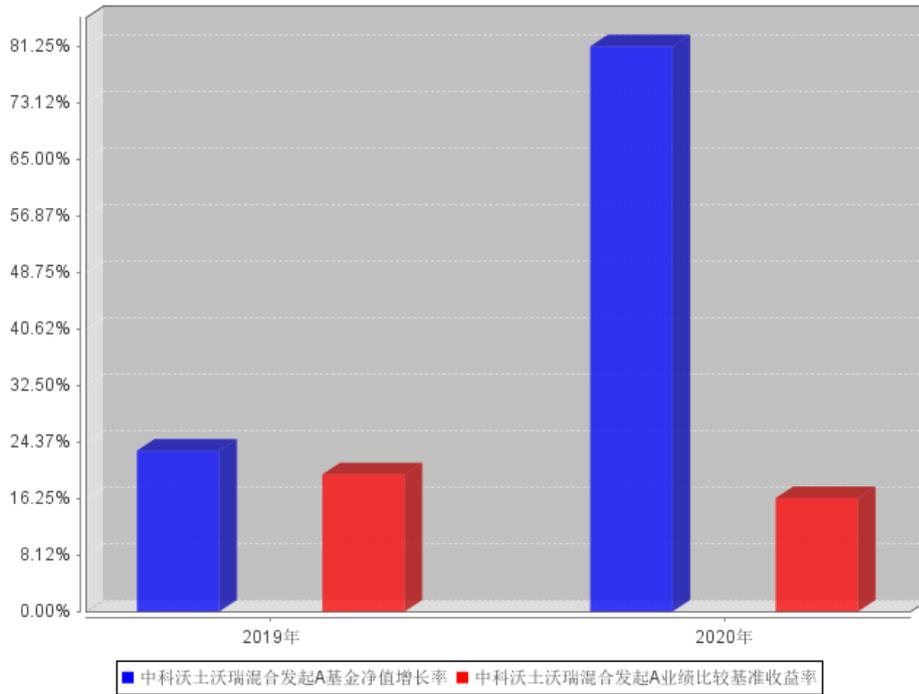
中科沃土沃瑞混合发起C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



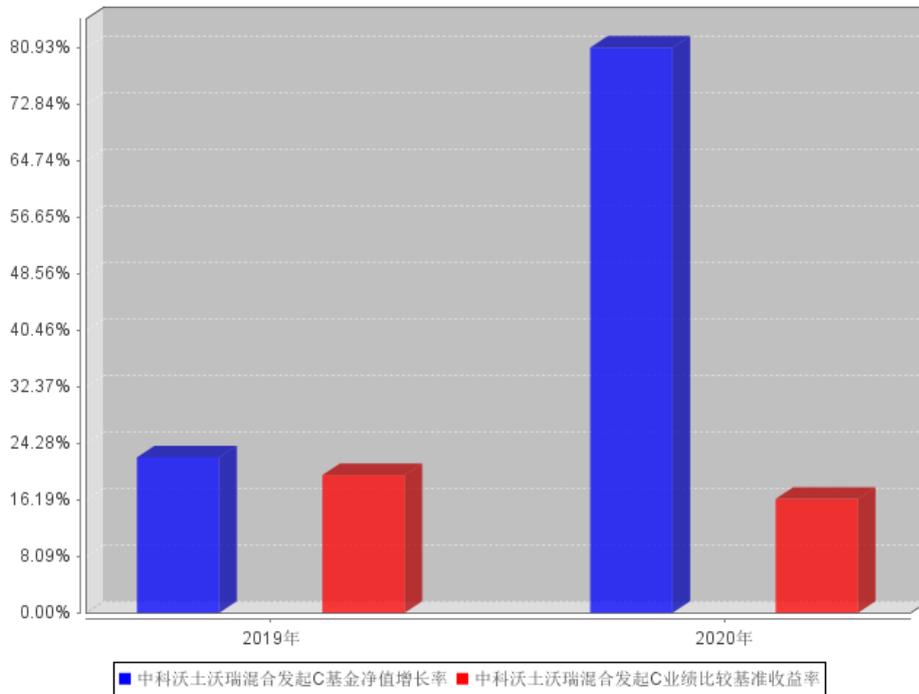
注：本基金建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合自本基金合同的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来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

中科沃土沃瑞混合发起A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



中科沃土沃瑞混合发起C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2019年1月14日）至报告期末未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中科沃土基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2015]1937 号文批准，于 2015 年 9 月 6 日正式成立，注册资本 1.42 亿元，是国内第 101 家公募基金管理公司，也是一家拥有 PE 背景的公募基金管理公司。中科沃土带着中科招商、粤科金融等主要股东强大的精神基因和优秀的文化基因，始终贯彻“持有人利益至上”的首要经营准则，遵循诚信、规范、稳健的经营方针，崇尚价值投资理念和长期、平稳、盈利的投资风格，致力于为持有人提供专业、精品、创新的投资理财服务，创造成长价值，汇聚阳光财富。截至 2020 年 12 月 31 日，中科沃土旗下共管理 7 只开放式基金：中科沃土货币市场基金、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金、中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金和中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄艺明	权益投资部副总经理、基金经理	2019 年 1 月 14 日	-	11 年	经济学硕士。曾任广东粤财信托有限公司研究员，金鹰基金管理有限公司基金经理助理、研究总监助理，七匹狼控股集团有限公司投资经理助理，广东富业盛德资产管理有限公司执行董事、投资总监，中科沃土基金管理有限公司专户投资部副总经理、投资经理，现任中科沃土基金管理有限公司权益投资部副总经理、中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。中国国籍，

					具有基金从业资格。
林皓	基金经理	2019年11月8日	-	4年	工学硕士。曾任中科沃土基金管理有限公司研究部研究员，现任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“离任日期”为公告确定的解聘日期，黄艺明的“任职日期”为基金合同生效之日，林皓的“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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中科沃土基金管理有限公司公平交易管理办法》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、交易执行的内部控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各投资组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统的公平交易功能将自动启用，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序 and 分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常

问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3 日内、5 日内），对我司旗下所有投资组合本年度的同向交易价差情况进行了分析，根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中未出现交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年是中科沃土沃瑞基金全年完整运作的第一年，策略上坚守多元策略，核心策略为精选业绩加速增长的行业与公司，辅助策略上把握事件驱动阶段性投资机会。

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瑞混合发起 A 基金份额净值为 2.2317 元，本报告期基金份额净值增长率为 81.25%；截至本报告期末中科沃土沃瑞混合发起 C 基金份额净值为 2.2121 元，本报告期基金份额净值增长率为 80.93%；同期业绩比较基准收益率为 16.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

冬意浓浓，雪飘寒至，腊梅绚烂，暖阳消融，万物欲动。

在党中央的坚强领导下，全国各族人民共同努力下，我国是经济大国中唯一在 2020 年实现经济正增长的国家，实属不易。以沪深 300 为代表的蓝筹指数创 10 多年新高，振奋人心。投资结构上，主流投资围绕“内循环、碳中和”，“喝酒吃药避免税、风光无限新能源车”更是恰如其分。

然而，近半年来，以中证 1000 为代表的中小市值公司表现乏力，步入 2021，市场更是呈现“二八”效应，投资者普遍赚了指数难赚钱。这里面可能有存量经济，供给侧改革、需求侧管理下，龙头公司做大做强，受益集中度提升的缘故，也有可能是注册制、退市新规下，投资者对中小市值公司投资偏好阶段性下降原因。因此，尊重市场，适应不同行业、不同公司新型估值定价体系的重构，是当前投研人员急需解决的课题。

降低 2021 年权益投资回报率的期望，应当是一个理性的思考。经过过去两年市场对结构性投资机会的不断挖掘，不少龙头核心资产的估值叠创历史新高，流动性、确定性在估值定价中已赋予不低权重。中央定调 2021 政策“转弯”，尽管“不急”，但伴随后续疫情的进一步有效控制，货币政策逐渐回归常态，权益市场估值整体性进一步提升的难度加大，投资机会更多在于行业景气、业绩加速的公司上。

回顾沃瑞基金过去两年的投资运作，整体收益差强人意。基金风险控制，回撤把握，夏普比率达到了预期。然而，对投资机会的挖掘，如何放大有效持仓收益，仍有较大提升空间。对于 500 亿-1000 亿以上市值公司的研究深度、投资理解，与很多头部兄弟基金公司优秀投研人员相比，我们凸显浅薄，短板频现，错失了以白酒为代表大市值公司系统性历史罕见重大估值提升机会，深以为憾。这导致我们过去、现在，或者可能未来仍将维持一段时间跑输市场及优秀的同行。好在沃瑞基金基金经理团队是个学习型组织，总结经验、加快学习、补齐短板已在路上。

纵使清明无雨色，入云深处亦沾衣。开年布局，评估原有持仓结构，我们阶段性兑现了部分涨幅较大，估值过高的新能源汽车产业链及其它行业标的，我们对新能源行业长期发展空间坚定不疑，但注重回撤，坚守估值、安全边际、股价匹配业绩增速是我们一贯投资风控体系。核心资产再好，行业成长空间再大，也应该有个合理的定价，赋予过高的估值，可能需要相当长的时间消化。

投资不应当只是一个“押大押小”的选择题，更不应当只是遵从从一个简化版的“赛道投资”，价值投资更不仅仅是“市值投资”。合理评估行业成长空间、竞争趋势、政策导向，并落地至具体标的业绩增速、增长质量上才是题中应有之意。

一岁枯荣一岁寒，且待新春花开暖。柳暗花明之外，终有世外桃源之时。当前，很多细分行业龙头，市值可能仅 100-200 亿之下，相较及成长性，投资吸引力极大，尽管阶段不受资

金偏好，但伴随行业景气上行，业绩加速兑现，2021 重估价值正当其时。

莫怪严凝切，春冬正月交。自主可控芯片、操作系统上经过国家政策导向，企业多年加大研发攻关，运用场景不断适配扩大，2021 年有望实现行业主流公司首次盈利并加速，“十四五”期间加速推行，行业投资有望实现从主题投资向成长投资过渡。另外，尽管新能源汽车电动化下锂电相关材料的重估阶段较为充分，但智能化下相关汽车电子的重估仍大有可为。

青山一路同风雨，你我携手砥砺前行。作为沃瑞基金经理，亦是基金份额持有人，惟愿与各位基金持有人守住这峥嵘岁月，共创下一段未来。

雪过梅开，微敞轩窗，安坐品茗，等风送香来！

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

本基金管理人按照相关法律法规、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，定期对估值政策和程序进行评价。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

基金日常估值由运营科技部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，提出估值建议，确保估值的公允性。监察风控部负责对基金估值程序和方法进行核查，确保估值相关各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关固定收益品种的估值数据。

4.8 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，本基金本年度未进行利润分配，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，本基金不存在连续二十个工作日以上基金份额持有人数量不满二百人或者基金

资产净值低于五千万元的情形。

§ 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，基金托管人在中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中科沃土基金管理有限公司在中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中科沃土基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 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	中科沃土沃瑞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瑞混合发起式基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	<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。</p> <p>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瑞混合发起式基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>中科沃土沃瑞混合发起式基金的基金管理人中科沃土基金管理有 限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和 中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实 务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必 要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错 报。</p> <p>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瑞混合 发起式基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适 用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算中科 沃土沃瑞混合发起式基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中科沃土沃瑞混合发起式基金的财务 报告过程。</p>

<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>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：</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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，就可能导致对中科沃土沃瑞混合发起式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瑞混合发起式基金不能持续经营。</p>

	<p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <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。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛竞	周祎
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	2021 年 3 月 29 日	

6.2 审计报告基本信息

-

6.3 审计报告的基本内容

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	3,473,933.17	1,197,514.80
结算备付金		1,627,127.18	226,843.28
存出保证金		202,109.60	17,854.81
交易性金融资产	7.4.7.2	58,215,107.32	13,955,755.00
其中：股票投资		58,166,607.32	13,955,755.00
基金投资		-	-
债券投资		48,500.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,171,363.35	-
应收利息	7.4.7.5	1,576.43	380.42
应收股利		-	-
应收申购款		229,118.75	136,269.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		65,920,335.80	15,534,618.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 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		-	-
应付证券清算款		1,961,855.74	146,974.62
应付赎回款		547,688.31	72,821.91
应付管理人报酬		78,321.14	18,109.93
应付托管费		13,053.51	3,018.33
应付销售服务费		15,816.59	1,222.93
应付交易费用	7.4.7.7	670,639.18	93,438.29
应交税费		0.15	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	40,042.66	30,001.20
负债合计		3,327,417.28	365,587.21
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	28,138,944.20	12,331,524.85
未分配利润	7.4.7.10	34,453,974.32	2,837,506.18
所有者权益合计		62,592,918.52	15,169,031.03
负债和所有者权益总计		65,920,335.80	15,534,618.24

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 28,138,944.20 份，其中 A 类基金份额净值 2.2317 元，A 类基金份额总额 17,688,154.37 份；C 类基金份额净值 2.2121 元，C 类基金份额总额 10,450,789.83 份。

7.2 利润表

会计主体：中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 14 日(基 金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		40,281,020.20	3,546,864.29
1.利息收入		121,334.58	66,704.82
其中：存款利息收入	7.4.7.11	80,864.73	18,543.01
债券利息收入		4.32	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		40,465.53	48,161.81
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		36,425,209.03	2,682,049.19
其中：股票投资收益	7.4.7.12	36,168,601.44	2,583,583.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-274,040.00	-
股利收益	7.4.7.16	530,647.59	98,465.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	3,320,937.18	793,168.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	413,539.41	4,942.24
减：二、费用		5,492,935.34	895,686.00
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	712,131.57	178,631.92
2. 托管费	7.4.10.2.2	118,688.54	29,772.01
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	163,764.25	11,362.23
4. 交易费用	7.4.7.19	4,453,912.67	644,889.84
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.01	-
7. 其他费用	7.4.7.20	44,438.30	31,030.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		34,788,084.86	2,651,178.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34,788,084.86	2,651,178.29

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	12,331,524.85	2,837,506.18	15,169,031.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	34,788,084.86	34,788,084.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	15,807,419.35	-3,171,616.72	12,635,802.63
其中：1. 基金申购款	111,687,176.59	70,708,872.90	182,396,049.49
2. 基金赎回款	-95,879,757.24	-73,880,489.62	-169,760,246.86
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者权益（基金净值）	28,138,944.20	34,453,974.32	62,592,918.52
项目	上年度可比期间 2019年1月14日(基金合同生效日)至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	10,478,812.69	-	10,478,812.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,651,178.29	2,651,178.29
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,852,712.16	186,327.89	2,039,040.05
其中：1. 基金申购款	3,174,056.48	354,770.22	3,528,826.70
2. 基金赎回款	-1,321,344.32	-168,442.33	-1,489,786.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	12,331,524.85	2,837,506.18	15,169,031.03

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：

于建伟 程文卫 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

中科沃土沃瑞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[2018]第590号《关于准予中科沃土沃瑞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公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中科沃土沃瑞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10,472,931.26元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)(瑞华)验字第(2019)48090001号验证报告予以验证。经向中国证监会备案,《中科沃土沃瑞灵活配置混合型发

起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 1 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,478,812.69 份基金份额，其中认购资金利息折合 5,881.43 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，基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,006,686.86 基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中科沃土沃瑞灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，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《中科沃土沃瑞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)、股指期货、国债期货、权证、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、货币市场工具、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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中债综合全价(总值)指数收益率×40%。

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 2021 年 3 月 29 日批准报出。

批注 [JXJ(-A1)]: 请修改

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中科沃土沃瑞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 2020 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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认

金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

4、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关

于发布《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

7.4.4.13(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、资产支持证券和私募债券除外)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、资产支持证券和私募债券除外),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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	3,473,933.17	1,197,514.80
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	3,473,933.17	1,197,514.80

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		54,052,502.10	58,166,607.32	4,114,105.22
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	48,500.00	48,500.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	48,500.00	48,500.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		54,101,002.10	58,215,107.32	4,114,105.22
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		13,162,586.96	13,955,755.00	793,168.04
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		13,162,586.96	13,955,755.00	793,168.04

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均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	788.11	259.23
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	683.87	112.39
应收债券利息	4.46	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	99.99	8.80
合计	1,576.43	380.42

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	670,639.18	93,438.29
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	670,639.18	93,438.29

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	42.66	1.20
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	40,000.00	30,000.00
合计	40,042.66	30,001.20

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中科沃土沃瑞混合发起 A		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,681,489.09	10,681,489.09
本期申购	31,349,199.79	31,349,199.79
本期赎回（以“-”号填列）	-24,342,534.51	-24,342,534.51
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	17,688,154.37	17,688,154.37

金额单位：人民币元

中科沃土沃瑞混合发起 C		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,650,035.76	1,650,035.76
本期申购	80,337,976.80	80,337,976.80
本期赎回（以“-”号填列）	-71,537,222.73	-71,537,222.73
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	10,450,789.83	10,450,789.83

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中科沃土沃瑞混合发起 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,723,450.60	746,789.24	2,470,239.84
本期利润	15,732,144.93	1,689,443.24	17,421,588.17
本期基金份额交易产生的变动数	1,209,728.12	685,138.56	1,894,866.68
其中：基金申购款	17,626,030.40	2,780,834.66	20,406,865.06
基金赎回款	-16,416,302.28	-2,095,696.10	-18,511,998.38
本期已分配利润	-	-	-

本期末	18,665,323.65	3,121,371.04	21,786,694.69
-----	---------------	--------------	---------------

单位：人民币元

中科沃土沃瑞混合发起 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	252,381.41	114,884.93	367,266.34
本期利润	15,735,002.75	1,631,493.94	17,366,496.69
本期基金份额交易产生的变动数	-5,155,734.26	89,250.86	-5,066,483.40
其中：基金申购款	43,805,544.10	6,496,463.74	50,302,007.84
基金赎回款	-48,961,278.36	-6,407,212.88	-55,368,491.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,831,649.90	1,835,629.73	12,667,279.63

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月14日(基金合同生效日) 至2019年12月31日
活期存款利息收入	52,099.93	12,728.79
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	23,690.31	5,372.01
其他	5,074.49	442.21
合计	80,864.73	18,543.01

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月14日(基金 合同生效日)至2019年12月 31日
卖出股票成交总额	1,684,612,530.92	241,023,998.17
减：卖出股票成本总额	1,648,443,929.48	238,440,414.64
买卖股票差价收入	36,168,601.44	2,583,583.53

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.13.1 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均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间收益金额 2019年1月14日(基金合同生效日)至2019年12月31日
国债期货投资收益	-	-
股指期货-投资收益	-274,040.00	-

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月14日(基金合同生效日)至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	530,647.59	98,465.66
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	530,647.59	98,465.66

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月14日(基金合同生效日)至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	3,320,937.18	793,168.04
——股票投资	3,320,937.18	793,168.04
——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	3,320,937.18	793,168.04

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月14日(基金合同生 效日)至2019年12月31日
基金赎回费收入	412,364.52	4,942.24
基金转换费收入	1,174.89	-
合计	413,539.41	4,942.24

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

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月14日(基金合同生 效日)至2019年12月31日
交易所市场交易费用	4,453,912.67	644,889.84
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	4,453,912.67	644,889.84

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月14日(基金合同 生效日)至2019年12月31日

审计费用	40,000.00	30,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	4,438.30	630.00
其他	-	400.00
合计	44,438.30	31,030.00

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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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、基金发起人
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
珠海横琴沃土创业投资有限公司	基金管理人的股东
珠海横琴沃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
中科招商投资管理集团股份有限公司	基金管理人股东的控股股东
珠海横琴沃信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
广州西拓投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东、基金发起人

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. 根据 2020 年 7 月 17 日《中科沃土基金管理有限公司关于公司股东名称变更的公告》，公司股东名称由“珠海横琴西拓投资合伙企业（有限合伙）”变更为“广州西拓投资合伙企业（有限合伙）”。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 14 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	712,131.57	178,631.92
其中：支付销售机构的客户维护费	176,372.64	15,436.12

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	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月14日(基金合同生效日)至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	118,688.54	29,772.01

注：支付基金托管人交通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		
	2020年1月1日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C	合计
交通银行	-	1,041.33	1,041.33
中科沃土基金	-	26,284.30	26,284.30
合计	-	27,325.63	27,325.63
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019年1月14日(基金合同生效日)至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C	合计
交通银行	-	-	-
中科沃土基金	-	9,521.04	9,521.04
合计	-	9,521.04	9,521.04

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 0.80%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公司，再由中科沃土基金公司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 0.80%/ 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行证券出借业务。

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自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未出现基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中科沃土沃瑞混合发起 A				
关联方名称	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
广州西拓投资 合伙企业（有 限合伙）	8,003,602.74	28.4400%	8,003,602.74	64.9000%

份额单位：份

中科沃土沃瑞混合发起 C				
关联方名称	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
广东中科科创 创业投资管理 有限责任公司	1,000,410.96	3.5600%	1,000,410.96	8.1100%

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2019 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
交通银行股份有 限公司	3,473,933.17	52,099.93	1,197,514.80	12,728.79

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	16.95	16.95	405	6,864.75	6,864.75	-
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	15.18	15.18	432	6,557.76	6,557.76	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128142	新乳转债	2020年12月18日	2021年1月19日	新债未上市	100.00	100.00	485	48,500.00	48,500.00	-

注：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。

带格式的：缩进：首行缩进：0 字符

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期无转融通业务。

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

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

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资部门负责人和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察风控部、集中交易部和基金事务部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为混合型基金，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、货币市场基金。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。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。

批注 [JXJ(-A2)]: 建议如上修改

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工商交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。对于定期银行存款，本基金通过选择具备适当信用水平的银行作为交易对手，平衡信用风险与投资收益率，综合参考内外部信用评级信息评价及调整投资限额，管理相关信用风险并定期评估减值损失。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。

批注 [JXJ(-A3)]: 托管行是交行

批注 [JXJ(-A4)]: 没有定存，建议不披露

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.08% (2019 年 12 月 31 日：同)。

批注 [JXJ(-A5)]: 有比例

带格式的：缩进：首行缩进： 0 字符

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 2020 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。~~于 2020 年 12 月 31 日，本基金无流动性受限资产。~~

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,473,933.17	-	-	-	3,473,933.17
结算备付金	1,627,127.18	-	-	-	1,627,127.18
存出保证金	202,109.60	-	-	-	202,109.60
交易性金融资产	48,500.00	-	-	58,166,607.32	58,215,107.32
应收证券清算款	-	-	-	2,171,363.35	2,171,363.35
应收利息	-	-	-	1,576.43	1,576.43
应收申购款	-	-	-	229,118.75	229,118.75
资产总计	5,351,669.95	-	-	60,568,665.85	65,920,335.80
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,961,855.74	1,961,855.74
应付赎回款	-	-	-	547,688.31	547,688.31
应付管理人报酬	-	-	-	78,321.14	78,321.14
应付托管费	-	-	-	13,053.51	13,053.51
应付销售服务费	-	-	-	15,816.59	15,816.59
应付交易费用	-	-	-	670,639.18	670,639.18

应交税费	-	-	-	0.15	0.15
其他负债	-	-	-	40,042.66	40,042.66
负债总计	-	-	-	3,327,417.28	3,327,417.28
利率敏感度缺口	5,351,669.95	-	-	-57,241,248.57	62,592,918.52
上年度末 2019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	1,197,514.80	-	-	-	1,197,514.80
结算备付金	226,843.28	-	-	-	226,843.28
存出保证金	17,854.81	-	-	-	17,854.81
交易性金融资产	-	-	-	13,955,755.00	13,955,755.00
应收利息	-	-	-	380.42	380.42
应收申购款	-	-	-	136,269.93	136,269.93
资产总计	1,442,212.89	-	-	14,092,405.35	15,534,618.24
负债					
应付证券清算款	-	-	-	146,974.62	146,974.62
应付赎回款	-	-	-	72,821.91	72,821.91
应付管理人报酬	-	-	-	18,109.93	18,109.93
应付托管费	-	-	-	3,018.33	3,018.33
应付销售服务费	-	-	-	1,222.93	1,222.93
应付交易费用	-	-	-	93,438.29	93,438.29
其他负债	-	-	-	30,001.20	30,001.20
负债总计	-	-	-	365,587.21	365,587.21
利率敏感度缺口	1,442,212.89	-	-	-13,726,818.14	15,169,031.03

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 2020 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资产净值的比例为 0.08% (2019 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2019 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。基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 0% - 95%；权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%；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%。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 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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	58,166,607.32	92.93	13,955,755.00	92.00
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	48,500.00	0.08	-	-
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	58,215,107.32	93.01	13,955,755.00	92.00

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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	业绩比较基准下降 5%	3,206,599.31	832,366.56
业绩比较基准上升 5%	-3,206,599.31	-832,366.56	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 58,147,275.32 元，属于第二层次的余额为 67,832.00 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 13,955,755.00 元，无第二或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 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(2019 年 12 月 31

日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	58,166,607.32	88.24
	其中：股票	58,166,607.32	88.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	48,500.00	0.07
	其中：债券	48,500.00	0.07
	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	5,101,060.35	7.74
8	其他各项资产	2,604,168.13	3.95
9	合计	65,920,335.80	100.00

8.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	36,109,775.08	57.69
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,364,521.24	29.34
J	金融业	1,475,166.00	2.36
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,746,990.00	2.79
M	科学研究和技术服务业	470,155.00	0.75

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	58,166,607.32	92.93

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

~~注~~：本报告期末本基金未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000066	中国长城	177,700	3,374,523.00	5.39
2	300379	东方通	57,700	2,636,890.00	4.21
3	300598	诚迈科技	21,300	2,553,444.00	4.08
4	603690	至纯科技	63,300	2,488,956.00	3.98
5	300073	当升科技	37,000	2,399,450.00	3.83
6	600536	中国软件	30,000	2,362,800.00	3.77
7	603456	九洲药业	65,700	2,352,060.00	3.76
8	603787	新日股份	77,700	2,299,143.00	3.67
9	688006	杭可科技	27,000	2,241,810.00	3.58
10	300035	中科电气	177,000	2,168,250.00	3.46
11	300578	会畅通讯	50,000	2,003,000.00	3.20
12	300659	中孚信息	40,000	1,963,200.00	3.14
13	300115	长盈精密	77,700	1,915,305.00	3.06
14	300890	翔丰华	34,400	1,826,296.00	2.92
15	002027	分众传媒	177,000	1,746,990.00	2.79
16	002409	雅克科技	27,700	1,664,493.00	2.66
17	688037	芯源微	15,700	1,617,885.00	2.58
18	688058	宝兰德	17,700	1,560,078.00	2.49
19	603520	司太立	23,300	1,533,839.00	2.45
20	300568	星源材质	47,700	1,443,879.00	2.31
21	300188	美亚柏科	63,300	1,363,482.00	2.18
22	002597	金禾实业	37,000	1,199,910.00	1.92
23	688023	安恒信息	4,400	1,144,440.00	1.83
24	603232	格尔软件	37,700	1,008,852.00	1.61

25	002240	盛新锂能	41,000	1,002,040.00	1.60
26	688561	奇安信	7,700	970,970.00	1.55
27	603799	华友钴业	12,000	951,600.00	1.52
28	002335	科华恒盛	40,000	893,600.00	1.43
29	601377	兴业证券	100,000	868,000.00	1.39
30	688127	蓝特光学	23,300	839,266.00	1.34
31	300596	利安隆	21,000	824,880.00	1.32
32	600745	闻泰科技	7,700	762,300.00	1.22
33	688599	天合光能	23,300	539,395.00	0.86
34	600030	中信证券	17,700	520,380.00	0.83
35	002600	领益智造	40,000	479,600.00	0.77
36	603859	能科股份	13,300	470,155.00	0.75
37	688093	世华科技	17,700	439,137.00	0.70
38	002970	锐明技术	7,700	408,177.00	0.65
39	300687	赛意信息	13,300	305,102.00	0.49
40	300378	鼎捷软件	10,000	272,500.00	0.44
41	300802	矩子科技	7,700	241,087.00	0.39
42	002368	太极股份	7,700	201,047.00	0.32
43	688063	派能科技	600	155,172.00	0.25
44	300033	同花顺	700	86,786.00	0.14
45	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.03
46	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.03
47	002709	天赐材料	100	10,380.00	0.02
48	605277	新亚电子	405	6,864.75	0.01
49	003030	祖名股份	432	6,557.76	0.01
50	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.01

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	300115	长盈精密	31,699,328.85	208.97
2	300433	蓝思科技	26,171,080.52	172.53
3	600745	闻泰科技	22,542,799.52	148.61
4	002384	东山精密	21,725,271.00	143.22
5	600030	中信证券	20,586,584.46	135.71

6	002675	东诚药业	20,163,873.54	132.93
7	002138	顺络电子	20,100,863.85	132.51
8	300073	当升科技	18,607,684.35	122.67
9	300035	中科电气	18,140,725.40	119.59
10	603686	龙马环卫	17,833,919.99	117.57
11	300451	创业慧康	17,373,974.62	114.54
12	300003	乐普医疗	17,283,259.52	113.94
13	601377	兴业证券	17,281,943.73	113.93
14	300815	玉禾田	17,225,781.42	113.56
15	300253	卫宁健康	16,921,474.01	111.55
16	300686	智动力	15,381,292.00	101.40
17	688006	杭可科技	15,240,897.65	100.47
18	000002	万科 A	15,139,182.27	99.80
19	601636	旗滨集团	13,993,370.01	92.25
20	002128	露天煤业	13,904,518.66	91.66
21	603799	华友钴业	13,901,980.22	91.65
22	300037	新宙邦	13,495,434.00	88.97
23	300618	寒锐钴业	13,485,337.00	88.90
24	603659	璞泰来	13,452,921.46	88.69
25	601688	华泰证券	13,221,818.96	87.16
26	002600	领益智造	12,888,886.31	84.97
27	600383	金地集团	12,845,704.40	84.68
28	002973	侨银股份	12,717,423.53	83.84
29	002241	歌尔股份	12,408,951.54	81.80
30	002850	科达利	11,269,167.09	74.29
31	600837	海通证券	11,238,207.40	74.09
32	002055	得润电子	11,022,444.61	72.66
33	002407	多氟多	11,007,940.20	72.57
34	300373	扬杰科技	10,937,040.12	72.10
35	002709	天赐材料	10,653,893.89	70.23
36	002043	兔宝宝	10,529,677.24	69.42
37	002273	水晶光电	10,519,736.22	69.35
38	688396	华润微	10,386,571.13	68.47
39	000933	神火股份	10,206,205.76	67.28
40	000786	北新建材	10,185,810.11	67.15
41	603690	至纯科技	9,893,886.28	65.22

42	000401	冀东水泥	9,883,869.00	65.16
43	603180	金牌厨柜	9,825,258.75	64.77
44	600048	保利地产	9,814,394.00	64.70
45	002301	齐心集团	9,759,174.86	64.34
46	002497	雅化集团	9,682,230.00	63.83
47	300409	道氏技术	9,647,741.60	63.60
48	601601	中国太保	9,219,163.81	60.78
49	601088	中国神华	9,136,407.00	60.23
50	603043	广州酒家	8,923,399.13	58.83
51	000723	美锦能源	8,728,215.00	57.54
52	000807	云铝股份	8,660,267.00	57.09
53	002736	国信证券	8,629,276.00	56.89
54	600549	厦门钨业	8,570,201.41	56.50
55	002335	科华恒盛	8,426,019.17	55.55
56	603456	九洲药业	8,264,540.29	54.48
57	000975	银泰黄金	8,099,264.20	53.39
58	601933	永辉超市	8,045,353.50	53.04
59	603920	世运电路	7,983,830.00	52.63
60	600050	中国联通	7,847,320.00	51.73
61	000547	航天发展	7,732,379.74	50.97
62	002409	雅克科技	7,721,850.00	50.91
63	002508	老板电器	7,551,315.57	49.78
64	688139	海尔生物	7,533,015.35	49.66
65	002027	分众传媒	7,349,677.02	48.45
66	000066	中国长城	7,338,944.90	48.38
67	002063	远光软件	7,323,277.23	48.28
68	603787	新日股份	7,244,848.81	47.76
69	300088	长信科技	7,061,743.76	46.55
70	000983	山西焦煤	6,985,755.80	46.05
71	601881	中国银河	6,937,256.00	45.73
72	002156	通富微电	6,889,441.67	45.42
73	603305	旭升股份	6,887,465.00	45.40
74	600111	北方稀土	6,783,923.00	44.72
75	002777	久远银海	6,725,911.20	44.34
76	688015	交控科技	6,715,242.33	44.27
77	601699	潞安环能	6,697,863.00	44.15

78	300122	智飞生物	6,493,352.26	42.81
79	000166	申万宏源	6,477,422.00	42.70
80	600958	东方证券	6,379,994.00	42.06
81	601001	晋控煤业	6,378,841.65	42.05
82	300369	绿盟科技	6,293,936.88	41.49
83	000671	阳光城	6,208,849.00	40.93
84	600985	淮北矿业	6,161,711.00	40.62
85	600109	国金证券	6,031,186.10	39.76
86	000012	南玻 A	6,026,533.02	39.73
87	600489	中金黄金	6,023,694.57	39.71
88	300693	盛弘股份	5,954,678.50	39.26
89	603801	志邦家居	5,942,336.72	39.17
90	300142	沃森生物	5,751,929.64	37.92
91	300603	立昂技术	5,684,271.00	37.47
92	600802	福建水泥	5,634,103.42	37.14
93	000656	金科股份	5,618,887.00	37.04
94	688127	蓝特光学	5,607,061.22	36.96
95	000961	中南建设	5,338,444.00	35.19
96	603520	司太立	5,233,298.00	34.50
97	002572	索菲亚	5,197,234.66	34.26
98	300671	富满电子	5,196,012.00	34.25
99	603195	公牛集团	5,194,991.47	34.25
100	300457	赢合科技	5,177,283.00	34.13
101	300598	诚迈科技	5,063,059.00	33.38
102	002993	奥海科技	5,006,693.71	33.01
103	603986	兆易创新	4,996,248.00	32.94
104	300476	胜宏科技	4,990,127.81	32.90
105	603005	晶方科技	4,979,415.01	32.83
106	002916	深南电路	4,942,791.24	32.58
107	300659	中孚信息	4,934,821.20	32.53
108	601666	平煤股份	4,867,323.60	32.09
109	002812	恩捷股份	4,580,265.26	30.19
110	300578	会畅通讯	4,551,863.00	30.01
111	603993	洛阳钼业	4,550,809.00	30.00
112	605336	帅丰电器	4,542,263.37	29.94
113	601166	兴业银行	4,506,513.00	29.71

114	002739	万达电影	4,499,349.00	29.66
115	300059	东方财富	4,474,344.24	29.50
116	688037	芯源微	4,467,581.24	29.45
117	000725	京东方 A	4,407,739.00	29.06
118	600586	金晶科技	4,362,385.00	28.76
119	300246	宝莱特	4,347,104.00	28.66
120	002524	光正眼科	4,338,803.00	28.60
121	300568	星源材质	4,336,347.06	28.59
122	600131	国网信通	4,275,956.00	28.19
123	600536	中国软件	4,252,539.00	28.03
124	603019	中科曙光	4,137,810.20	27.28
125	688005	容百科技	4,050,431.99	26.70
126	300602	飞荣达	4,038,628.78	26.62
127	600183	生益科技	3,999,874.00	26.37
128	002035	华帝股份	3,952,365.78	26.06
129	000937	冀中能源	3,881,633.00	25.59
130	600153	建发股份	3,828,194.00	25.24
131	601336	新华保险	3,742,166.00	24.67
132	002237	恒邦股份	3,676,121.60	24.23
133	300408	三环集团	3,667,133.98	24.18
134	300737	科顺股份	3,636,571.00	23.97
135	688981	中芯国际	3,634,156.26	23.96
136	003010	若羽臣	3,632,406.80	23.95
137	000810	创维数字	3,576,021.00	23.57
138	002416	爱施德	3,447,870.72	22.73
139	600497	驰宏锌锗	3,422,808.51	22.56
140	300890	翔丰华	3,421,308.00	22.55
141	300453	三鑫医疗	3,403,601.00	22.44
142	688023	安恒信息	3,296,711.08	21.73
143	600711	盛屯矿业	3,290,734.00	21.69
144	603898	好莱客	3,274,775.00	21.59
145	002810	山东赫达	3,253,497.36	21.45
146	002258	利尔化学	3,247,247.32	21.41
147	002223	鱼跃医疗	3,197,194.95	21.08
148	000651	格力电器	3,183,552.00	20.99
149	002036	联创电子	3,173,334.00	20.92

150	300119	瑞普生物	3,172,775.00	20.92
151	600887	伊利股份	3,141,022.36	20.71
152	600325	华发股份	3,130,880.89	20.64
153	000783	长江证券	3,104,511.70	20.47
154	688003	天准科技	3,079,678.90	20.30
155	600230	沧州大化	3,072,979.88	20.26
156	600425	青松建化	3,047,815.00	20.09
157	002579	中京电子	3,025,016.31	19.94
158	300136	信维通信	3,005,355.00	19.81
159	000400	许继电气	2,993,655.00	19.74
160	688058	宝兰德	2,963,081.97	19.53
161	601318	中国平安	2,917,875.00	19.24
162	300044	赛为智能	2,883,846.80	19.01
163	600259	广晟有色	2,874,662.12	18.95
164	300379	东方通	2,872,168.17	18.93
165	002939	长城证券	2,862,103.58	18.87
166	605111	新洁能	2,839,972.53	18.72
167	300188	美亚柏科	2,824,931.58	18.62
168	300496	中科创达	2,818,659.00	18.58
169	000001	平安银行	2,810,949.00	18.53
170	002959	小熊电器	2,794,502.94	18.42
171	000831	五矿稀土	2,769,598.49	18.26
172	688599	天合光能	2,725,241.17	17.97
173	688093	世华科技	2,670,256.58	17.60
174	688358	祥生医疗	2,668,332.06	17.59
175	000060	中金岭南	2,642,496.00	17.42
176	601009	南京银行	2,637,987.00	17.39
177	000603	盛达资源	2,619,921.00	17.27
178	300616	尚品宅配	2,610,144.00	17.21
179	600584	长电科技	2,603,962.87	17.17
180	601186	中国铁建	2,600,078.00	17.14
181	002626	金达威	2,568,998.00	16.94
182	688388	嘉元科技	2,559,308.00	16.87
183	688021	奥福环保	2,530,146.46	16.68
184	688008	澜起科技	2,517,289.42	16.59
185	300674	宇信科技	2,507,486.00	16.53

186	000100	TCL 科技	2,502,222.00	16.50
187	300559	佳发教育	2,500,482.50	16.48
188	002155	湖南黄金	2,479,733.00	16.35
189	601168	西部矿业	2,479,418.00	16.35
190	300251	光线传媒	2,478,055.00	16.34
191	002460	赣锋锂业	2,430,767.00	16.02
192	300238	冠昊生物	2,425,526.00	15.99
193	002405	四维图新	2,419,848.50	15.95
194	600997	开滦股份	2,398,749.00	15.81
195	300687	赛意信息	2,356,763.00	15.54
196	300378	鼎捷软件	2,343,832.00	15.45
197	600977	中国电影	2,326,232.00	15.34
198	603859	能科股份	2,312,857.00	15.25
199	600395	盘江股份	2,291,957.04	15.11
200	600348	阳泉煤业	2,280,575.00	15.03
201	002240	盛新锂能	2,259,707.00	14.90
202	002635	安洁科技	2,258,084.00	14.89
203	002123	梦网集团	2,255,339.00	14.87
204	002853	皮阿诺	2,198,810.00	14.50
205	600060	海信视像	2,191,064.00	14.44
206	002511	中顺洁柔	2,173,929.00	14.33
207	601116	三江购物	2,152,415.00	14.19
208	002847	盐津铺子	2,146,390.00	14.15
209	002912	中新赛克	2,133,955.00	14.07
210	600061	国投资本	2,116,922.70	13.96
211	600529	山东药玻	2,105,721.00	13.88
212	600188	兖州煤业	2,100,268.99	13.85
213	002024	苏宁易购	2,056,037.00	13.55
214	601211	国泰君安	2,047,008.56	13.49
215	688012	中微公司	2,023,207.61	13.34
216	000728	国元证券	1,995,407.00	13.15
217	600114	东睦股份	1,992,960.00	13.14
218	002648	卫星石化	1,983,647.00	13.08
219	600989	宝丰能源	1,975,129.00	13.02
220	002065	东华软件	1,973,642.00	13.01
221	002605	姚记科技	1,969,252.00	12.98

222	600496	精工钢构	1,956,079.00	12.90
223	300787	海能实业	1,944,139.00	12.82
224	688399	硕世生物	1,941,022.73	12.80
225	600218	全柴动力	1,940,802.00	12.79
226	002049	紫光国微	1,937,954.00	12.78
227	000878	云南铜业	1,925,066.00	12.69
228	300438	鹏辉能源	1,904,510.00	12.56
229	002897	意华股份	1,884,732.00	12.42
230	003005	竞业达	1,882,588.83	12.41
231	300715	凯伦股份	1,870,989.52	12.33
232	002475	立讯精密	1,866,051.00	12.30
233	002044	美年健康	1,858,873.00	12.25
234	300648	星云股份	1,853,022.00	12.22
235	601995	中金公司	1,846,101.00	12.17
236	002182	云海金属	1,834,377.00	12.09
237	600875	东方电气	1,824,706.10	12.03
238	002456	欧菲光	1,806,347.00	11.91
239	600196	复星医药	1,790,126.00	11.80
240	300607	拓斯达	1,786,148.00	11.77
241	688567	孚能科技	1,778,394.00	11.72
242	002697	红旗连锁	1,775,657.00	11.71
243	002129	中环股份	1,737,014.15	11.45
244	300450	先导智能	1,727,860.00	11.39
245	300596	利安隆	1,723,883.36	11.36
246	000977	浪潮信息	1,702,651.52	11.22
247	300206	理邦仪器	1,696,686.00	11.19
248	603533	掌阅科技	1,678,508.00	11.07
249	600055	万东医疗	1,663,648.00	10.97
250	002251	步步高	1,655,037.00	10.91
251	300759	康龙化成	1,638,793.00	10.80
252	601231	环旭电子	1,634,826.00	10.78
253	000750	国海证券	1,633,119.00	10.77
254	000333	美的集团	1,622,001.01	10.69
255	002970	锐明技术	1,608,819.18	10.61
256	601800	中国交建	1,565,666.00	10.32
257	600547	山东黄金	1,558,175.00	10.27

258	603626	科森科技	1,552,465.60	10.23
259	300058	蓝色光标	1,534,038.00	10.11
260	603187	海容冷链	1,527,703.00	10.07
261	603138	海量数据	1,498,929.21	9.88
262	600185	格力地产	1,496,413.00	9.86
263	300133	华策影视	1,496,247.94	9.86
264	300623	捷捷微电	1,477,160.72	9.74
265	603010	万盛股份	1,466,519.00	9.67
266	688118	普元信息	1,464,816.14	9.66
267	600988	赤峰黄金	1,454,648.00	9.59
268	601198	东兴证券	1,444,111.00	9.52
269	000877	天山股份	1,442,215.66	9.51
270	603501	韦尔股份	1,418,722.00	9.35
271	002041	登海种业	1,413,577.20	9.32
272	000050	深天马 A	1,408,993.00	9.29
273	601878	浙商证券	1,402,922.05	9.25
274	002772	众兴菌业	1,401,112.00	9.24
275	600760	中航沈飞	1,394,178.00	9.19
276	300001	特锐德	1,393,316.00	9.19
277	300418	昆仑万维	1,387,813.00	9.15
278	601818	光大银行	1,377,803.00	9.08
279	600036	招商银行	1,365,648.00	9.00
280	600862	中航高科	1,363,629.00	8.99
281	600267	海正药业	1,354,812.00	8.93
282	300435	中泰股份	1,350,681.00	8.90
283	002597	金禾实业	1,339,037.04	8.83
284	002028	思源电气	1,316,262.00	8.68
285	300192	科德教育	1,309,549.00	8.63
286	300127	银河磁体	1,302,784.00	8.59
287	300511	雪榕生物	1,274,804.00	8.40
288	002249	大洋电机	1,263,846.00	8.33
289	601390	中国中铁	1,242,784.00	8.19
290	688369	致远互联	1,238,481.96	8.16
291	688030	山石网科	1,219,760.77	8.04
292	688561	奇安信	1,207,272.06	7.96
293	300562	乐心医疗	1,207,160.17	7.96

294	002382	蓝帆医疗	1,205,094.00	7.94
295	000069	华侨城 A	1,203,536.00	7.93
296	002429	兆驰股份	1,200,106.87	7.91
297	002385	大北农	1,198,863.00	7.90
298	600406	国电南瑞	1,192,663.00	7.86
299	600872	中炬高新	1,188,241.00	7.83
300	300738	奥飞数据	1,178,776.00	7.77
301	601598	中国外运	1,176,220.00	7.75
302	688016	心脉医疗	1,163,226.10	7.67
303	601899	紫金矿业	1,160,958.19	7.65
304	601939	建设银行	1,148,407.00	7.57
305	002930	宏川智慧	1,142,304.26	7.53
306	002946	新乳业	1,135,410.00	7.49
307	600699	均胜电子	1,134,300.00	7.48
308	601788	光大证券	1,125,356.00	7.42
309	603128	华贸物流	1,119,416.80	7.38
310	002551	尚荣医疗	1,114,060.00	7.34
311	603833	欧派家居	1,112,060.00	7.33
312	603927	中科软	1,102,981.00	7.27
313	600690	海尔智家	1,102,014.00	7.26
314	603313	梦百合	1,094,261.00	7.21
315	002351	漫步者	1,090,164.00	7.19
316	688039	当虹科技	1,088,012.97	7.17
317	603939	益丰药房	1,077,076.00	7.10
318	601577	长沙银行	1,069,848.00	7.05
319	300550	和仁科技	1,059,369.00	6.98
320	300753	爱朋医疗	1,059,266.00	6.98
321	300260	新莱应材	1,037,092.88	6.84
322	600459	贵研铂业	1,034,955.00	6.82
323	002230	科大讯飞	1,020,473.00	6.73
324	002340	格林美	1,015,545.00	6.69
325	603506	南都物业	1,005,803.00	6.63
326	600528	中铁工业	1,002,472.00	6.61
327	603232	格尔软件	1,001,283.00	6.60
328	600138	中青旅	992,222.00	6.54
329	603233	大参林	990,826.00	6.53

330	002987	京北方	978,118.24	6.45
331	603323	苏农银行	967,104.00	6.38
332	002007	华兰生物	936,814.00	6.18
333	000538	云南白药	917,000.00	6.05
334	600521	华海药业	912,320.00	6.01
335	300624	万兴科技	911,263.00	6.01
336	600702	ST 舍得	906,804.00	5.98
337	000789	万年青	904,153.05	5.96
338	601658	邮储银行	900,229.00	5.93
339	603283	赛腾股份	900,083.62	5.93
340	603103	横店影视	900,022.00	5.93
341	002918	蒙娜丽莎	897,004.00	5.91
342	000998	隆平高科	896,477.00	5.91
343	002233	塔牌集团	889,883.00	5.87
344	688051	佳华科技	887,328.26	5.85
345	688116	天奈科技	884,012.20	5.83
346	002034	旺能环境	869,342.12	5.73
347	002532	天山铝业	864,709.00	5.70
348	600409	三友化工	857,623.00	5.65
349	600517	国网英大	845,799.00	5.58
350	300788	中信出版	813,008.00	5.36
351	603279	景津环保	812,441.00	5.36
352	600499	科达制造	811,114.00	5.35
353	300166	东方国信	804,236.00	5.30
354	300770	新媒股份	803,254.00	5.30
355	000756	新华制药	796,933.00	5.25
356	601689	拓普集团	795,085.00	5.24
357	600908	无锡银行	787,260.00	5.19
358	300327	中颖电子	779,822.00	5.14
359	603136	天目湖	776,914.00	5.12
360	600588	用友网络	757,808.00	5.00
361	000960	锡业股份	749,850.00	4.94
362	002398	垒知集团	744,642.00	4.91
363	603212	赛伍技术	744,556.00	4.91
364	688086	紫光存储	741,287.74	4.89
365	600703	三安光电	740,564.00	4.88

366	002264	新华都	740,341.00	4.88
367	002859	洁美科技	737,388.40	4.86
368	002727	一心堂	736,155.00	4.85
369	601555	东吴证券	726,468.00	4.79
370	600867	通化东宝	725,473.00	4.78
371	000059	华锦股份	720,204.67	4.75
372	600392	盛和资源	715,687.08	4.72
373	002332	仙琚制药	700,769.00	4.62
374	688200	华峰测控	698,734.00	4.61
375	603890	春秋电子	695,743.00	4.59
376	000063	中兴通讯	691,922.00	4.56
377	605358	立昂微	666,817.64	4.40
378	300223	北京君正	659,631.00	4.35
379	600346	恒力石化	645,750.00	4.26
380	688036	传音控股	641,776.07	4.23
381	300248	新开普	635,853.00	4.19
382	603378	亚士创能	633,965.00	4.18
383	000681	视觉中国	626,443.00	4.13
384	002106	莱宝高科	625,320.00	4.12
385	603883	老百姓	618,591.00	4.08
386	600999	招商证券	614,625.00	4.05
387	000915	山大华特	613,514.00	4.04
388	688168	安博通	613,123.60	4.04
389	002677	浙江美大	606,703.00	4.00
390	002371	北方华创	602,642.00	3.97
391	300306	远方信息	598,879.00	3.95
392	600233	圆通速递	595,108.00	3.92
393	601225	陕西煤业	593,677.00	3.91
394	688363	华熙生物	586,498.36	3.87
395	688066	航天宏图	583,116.84	3.84
396	688595	芯海科技	583,057.42	3.84
397	300182	捷成股份	568,800.00	3.75
398	002110	三钢闽光	563,770.00	3.72
399	002189	中光学	563,254.00	3.71
400	601877	正泰电器	562,120.00	3.71
401	000612	焦作万方	552,611.00	3.64

402	600054	黄山旅游	547,553.00	3.61
403	002343	慈文传媒	533,200.00	3.52
404	002623	亚玛顿	526,606.00	3.47
405	000717	韶钢松山	524,979.00	3.46
406	600598	北大荒	523,371.00	3.45
407	601808	中海油服	518,033.00	3.42
408	300661	圣邦股份	516,384.16	3.40
409	002570	贝因美	509,740.00	3.36
410	300033	同花顺	502,598.00	3.31
411	603068	博通集成	499,941.00	3.30
412	603056	德邦股份	499,078.00	3.29
413	600657	信达地产	496,107.00	3.27
414	000888	峨眉山 A	493,451.00	3.25
415	600831	广电网络	487,866.00	3.22
416	603387	基蛋生物	483,209.56	3.19
417	002975	博杰股份	481,957.00	3.18
418	300396	迪瑞医疗	480,376.00	3.17
419	002353	杰瑞股份	477,460.32	3.15
420	000768	中航西飞	474,752.00	3.13
421	002026	山东威达	471,047.00	3.11
422	002466	天齐锂业	468,525.22	3.09
423	002135	东南网架	466,611.00	3.08
424	002669	康达新材	465,673.00	3.07
425	688111	金山办公	462,895.68	3.05
426	002867	周大生	459,201.00	3.03
427	688095	福昕软件	458,609.00	3.02
428	600566	济川药业	455,830.00	3.01
429	000524	岭南控股	455,260.00	3.00
430	002146	荣盛发展	445,955.00	2.94
431	002905	金逸影视	444,447.00	2.93
432	300388	国祯环保	441,667.00	2.91
433	603825	华扬联众	440,072.00	2.90
434	688300	联瑞新材	435,474.53	2.87
435	300474	景嘉微	430,987.00	2.84
436	000026	飞亚达	427,587.00	2.82
437	603336	宏辉果蔬	414,976.00	2.74

438	002236	大华股份	414,400.22	2.73
439	605099	共创草坪	414,318.72	2.73
440	300497	富祥药业	412,389.00	2.72
441	002056	横店东磁	410,511.00	2.71
442	688185	康希诺	407,120.00	2.68
443	002747	埃斯顿	401,165.00	2.64
444	002489	浙江永强	399,924.00	2.64
445	601838	成都银行	396,284.40	2.61
446	000703	恒逸石化	394,269.00	2.60
447	600918	中泰证券	388,859.00	2.56
448	300793	佳禾智能	386,173.00	2.55
449	300175	朗源股份	380,051.00	2.51
450	300273	和佳医疗	379,560.00	2.50
451	603816	顾家家居	375,780.00	2.48
452	601319	中国人保	367,335.00	2.42
453	601003	柳钢股份	365,831.00	2.41
454	300525	博思软件	362,616.00	2.39
455	000559	万向钱潮	362,483.00	2.39
456	002984	森麒麟	356,732.65	2.35
457	300463	迈克生物	356,281.00	2.35
458	603980	吉华集团	356,225.00	2.35
459	300316	晶盛机电	356,057.00	2.35
460	603260	合盛硅业	352,506.00	2.32
461	603697	有友食品	351,630.00	2.32
462	300224	正海磁材	348,793.00	2.30
463	000099	中信海直	340,719.00	2.25
464	002796	世嘉科技	338,998.00	2.23
465	600996	贵广网络	336,565.00	2.22
466	300610	晨化股份	334,471.00	2.20
467	601609	金田铜业	333,200.00	2.20
468	002839	张家港行	329,869.00	2.17
469	002291	星期六	328,903.00	2.17
470	000027	深圳能源	326,146.00	2.15
471	002390	信邦制药	324,588.00	2.14
472	000932	华菱钢铁	324,124.00	2.14
473	002861	瀛通通讯	321,089.00	2.12

474	600742	一汽富维	319,619.00	2.11
475	002139	拓邦股份	316,522.00	2.09
476	002262	恩华药业	314,376.00	2.07
477	603612	索通发展	308,188.26	2.03
478	600926	杭州银行	305,575.00	2.01

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300115	长盈精密	30,543,794.53	201.36
2	300433	蓝思科技	27,077,153.70	178.50
3	600745	闻泰科技	22,906,275.48	151.01
4	002384	东山精密	21,820,358.79	143.85
5	600030	中信证券	21,549,612.00	142.06
6	002675	东诚药业	20,543,156.97	135.43
7	002138	顺络电子	20,217,642.30	133.28
8	300073	当升科技	18,940,954.06	124.87
9	300253	卫宁健康	18,225,267.26	120.15
10	300451	创业慧康	18,186,592.15	119.89
11	603686	龙马环卫	18,091,922.30	119.27
12	300815	玉禾田	17,837,922.49	117.59
13	300003	乐普医疗	17,522,195.55	115.51
14	300035	中科电气	17,177,620.40	113.24
15	601377	兴业证券	16,491,517.62	108.72
16	000002	万科 A	15,766,924.50	103.94
17	300686	智动力	15,487,624.76	102.10
18	300037	新宙邦	15,055,918.46	99.25
19	601636	旗滨集团	14,733,743.65	97.13
20	300618	寒锐钴业	14,591,987.75	96.20
21	688006	杭可科技	14,244,194.40	93.90
22	002128	露天煤业	14,117,520.30	93.07
23	603659	璞泰来	13,777,783.40	90.83

24	603799	华友钴业	13,741,440.92	90.59
25	600383	金地集团	13,543,758.62	89.29
26	002709	天赐材料	13,256,385.36	87.39
27	601688	华泰证券	13,164,370.31	86.78
28	002973	侨银股份	13,038,524.31	85.95
29	002241	歌尔股份	12,716,564.33	83.83
30	002850	科达利	12,331,634.99	81.29
31	600837	海通证券	12,178,514.00	80.29
32	002600	领益智造	12,085,154.78	79.67
33	002407	多氟多	11,550,378.00	76.14
34	300373	扬杰科技	10,986,162.21	72.42
35	002273	水晶光电	10,952,587.00	72.20
36	688396	华润微	10,895,608.70	71.83
37	002055	得润电子	10,668,067.00	70.33
38	002043	兔宝宝	10,606,288.86	69.92
39	000786	北新建材	10,511,429.56	69.30
40	603180	金牌厨柜	10,384,877.06	68.46
41	000933	神火股份	10,292,110.00	67.85
42	600048	保利地产	10,132,239.94	66.80
43	000401	冀东水泥	10,040,358.33	66.19
44	002497	雅化集团	9,779,208.62	64.47
45	002301	齐心集团	9,699,094.87	63.94
46	601601	中国太保	9,623,574.52	63.44
47	300409	道氏技术	9,573,751.69	63.11
48	601088	中国神华	9,272,427.07	61.13
49	603043	广州酒家	8,964,071.71	59.09
50	000807	云铝股份	8,957,139.78	59.05
51	688139	海尔生物	8,725,660.31	57.52
52	002736	国信证券	8,639,242.87	56.95
53	000723	美锦能源	8,615,849.05	56.80
54	600549	厦门钨业	8,516,709.56	56.15
55	603920	世运电路	8,337,099.00	54.96
56	000975	银泰黄金	8,314,866.42	54.81
57	601933	永辉超市	8,117,291.00	53.51
58	002508	老板电器	8,017,120.25	52.85
59	688015	交控科技	7,848,338.74	51.74
60	000547	航天发展	7,732,241.04	50.97
61	600050	中国联通	7,723,317.00	50.92

62	002335	科华恒盛	7,564,828.30	49.87
63	603690	至纯科技	7,532,214.80	49.66
64	300088	长信科技	7,501,761.18	49.45
65	002063	远光软件	7,392,879.58	48.74
66	601881	中国银河	7,173,940.54	47.29
67	002156	通富微电	7,071,386.58	46.62
68	000983	山西焦煤	6,996,695.20	46.12
69	002027	分众传媒	6,944,758.00	45.78
70	600111	北方稀土	6,909,086.99	45.55
71	300122	智飞生物	6,906,952.00	45.53
72	601699	潞安环能	6,787,027.00	44.74
73	603305	旭升股份	6,720,047.06	44.30
74	600958	东方证券	6,661,023.00	43.91
75	002409	雅克科技	6,647,430.98	43.82
76	002777	久远银海	6,638,945.48	43.77
77	603456	九洲药业	6,488,431.67	42.77
78	000166	申万宏源	6,458,754.03	42.58
79	603801	志邦家居	6,448,628.19	42.51
80	600985	淮北矿业	6,373,781.00	42.02
81	601001	晋控煤业	6,285,279.64	41.43
82	300369	绿盟科技	6,259,586.00	41.27
83	000671	阳光城	6,236,896.85	41.12
84	000012	南玻 A	5,943,257.02	39.18
85	000656	金科股份	5,936,546.93	39.14
86	600109	国金证券	5,915,052.51	38.99
87	600489	中金黄金	5,908,027.00	38.95
88	300693	盛弘股份	5,902,932.00	38.91
89	002572	索菲亚	5,835,266.95	38.47
90	600802	福建水泥	5,803,878.00	38.26
91	300142	沃森生物	5,586,641.68	36.83
92	300457	赢合科技	5,373,626.50	35.42
93	300603	立昂技术	5,362,971.00	35.35
94	000961	中南建设	5,308,537.00	35.00
95	603787	新日股份	5,198,856.00	34.27
96	300476	胜宏科技	5,158,413.00	34.01
97	601666	平煤股份	5,154,653.00	33.98
98	002812	恩捷股份	5,136,627.62	33.86
99	603986	兆易创新	5,129,861.44	33.82

100	688127	蓝特光学	5,080,166.91	33.49
101	603005	晶方科技	5,065,086.00	33.39
102	002916	深南电路	5,049,418.46	33.29
103	300246	宝莱特	4,998,028.00	32.95
104	603195	公牛集团	4,962,087.00	32.71
105	300671	富满电子	4,880,429.00	32.17
106	002993	奥海科技	4,761,547.12	31.39
107	000725	京东方 A	4,696,414.00	30.96
108	300059	东方财富	4,645,240.00	30.62
109	603993	洛阳钼业	4,558,544.00	30.05
110	605336	帅丰电器	4,535,083.80	29.90
111	601166	兴业银行	4,521,884.00	29.81
112	000066	中国长城	4,401,716.00	29.02
113	002739	万达电影	4,400,692.00	29.01
114	600131	国网信通	4,375,953.00	28.85
115	600586	金晶科技	4,341,729.00	28.62
116	002035	华帝股份	4,225,705.00	27.86
117	603019	中科曙光	4,153,205.44	27.38
118	002524	光正眼科	4,146,972.00	27.34
119	300602	飞荣达	4,102,185.77	27.04
120	601336	新华保险	4,043,483.00	26.66
121	688005	容百科技	4,039,768.17	26.63
122	600183	生益科技	3,978,344.45	26.23
123	600153	建发股份	3,847,970.00	25.37
124	603520	司太立	3,819,052.00	25.18
125	000937	冀中能源	3,808,625.00	25.11
126	688003	天准科技	3,785,402.14	24.95
127	002237	恒邦股份	3,771,028.86	24.86
128	300737	科顺股份	3,740,231.24	24.66
129	002416	爱施德	3,736,579.44	24.63
130	300408	三环集团	3,690,588.79	24.33
131	688981	中芯国际	3,675,220.88	24.23
132	000810	创维数字	3,556,859.20	23.45
133	002810	山东赫达	3,439,759.30	22.68
134	688358	祥生医疗	3,419,627.55	22.54
135	002258	利尔化学	3,406,346.09	22.46
136	003010	若羽臣	3,377,351.22	22.26
137	600497	驰宏锌锗	3,337,369.00	22.00

138	605111	新洁能	3,331,273.84	21.96
139	600711	盛屯矿业	3,319,853.33	21.89
140	300453	三鑫医疗	3,295,842.00	21.73
141	600325	华发股份	3,284,802.20	21.65
142	002036	联创电子	3,245,288.33	21.39
143	600230	沧州大化	3,229,067.20	21.29
144	002223	鱼跃医疗	3,223,544.86	21.25
145	603898	好莱客	3,209,127.65	21.16
146	000651	格力电器	3,168,317.00	20.89
147	300119	瑞普生物	3,141,608.00	20.71
148	600887	伊利股份	3,134,066.00	20.66
149	000783	长江证券	3,109,527.00	20.50
150	688037	芯源微	3,089,889.79	20.37
151	300136	信维通信	3,076,023.68	20.28
152	600425	青松建化	3,074,813.00	20.27
153	002579	中京电子	3,071,205.50	20.25
154	300568	星源材质	3,049,998.68	20.11
155	002959	小熊电器	3,044,921.00	20.07
156	688399	硕世生物	2,993,415.31	19.73
157	300659	中孚信息	2,982,545.25	19.66
158	601318	中国平安	2,958,724.00	19.51
159	688008	澜起科技	2,955,434.25	19.48
160	000400	许继电气	2,938,768.15	19.37
161	600259	广晟有色	2,881,825.00	19.00
162	000001	平安银行	2,869,416.00	18.92
163	300496	中科创达	2,865,443.00	18.89
164	300044	赛为智能	2,799,005.20	18.45
165	000831	五矿稀土	2,765,865.27	18.23
166	002939	长城证券	2,732,189.03	18.01
167	300578	会畅通讯	2,704,349.20	17.83
168	600584	长电科技	2,668,884.09	17.59
169	601009	南京银行	2,619,888.60	17.27
170	000603	盛达资源	2,597,280.00	17.12
171	000060	中金岭南	2,587,479.00	17.06
172	601186	中国铁建	2,571,475.22	16.95
173	300674	宇信科技	2,543,317.00	16.77
174	300616	尚品宅配	2,541,909.00	16.76
175	300598	诚迈科技	2,539,745.00	16.74

176	300559	佳发教育	2,528,650.50	16.67
177	688388	嘉元科技	2,527,641.03	16.66
178	300251	光线传媒	2,519,619.00	16.61
179	688021	奥福环保	2,514,567.85	16.58
180	000100	TCL 科技	2,510,123.00	16.55
181	601168	西部矿业	2,480,333.30	16.35
182	002155	湖南黄金	2,447,875.00	16.14
183	000728	国元证券	2,436,279.50	16.06
184	002626	金达威	2,431,803.00	16.03
185	002847	盐津铺子	2,403,074.00	15.84
186	688012	中微公司	2,369,996.76	15.62
187	002460	赣锋锂业	2,354,246.00	15.52
188	002405	四维图新	2,331,404.00	15.37
189	600997	开滦股份	2,321,752.00	15.31
190	300238	冠昊生物	2,297,976.00	15.15
191	688023	安恒信息	2,292,913.00	15.12
192	600977	中国电影	2,270,543.44	14.97
193	600395	盘江股份	2,266,086.55	14.94
194	600060	海信视像	2,253,699.85	14.86
195	002912	中新赛克	2,221,614.80	14.65
196	600348	阳泉煤业	2,207,476.00	14.55
197	688599	天合光能	2,185,666.88	14.41
198	002511	中顺洁柔	2,177,379.38	14.35
199	601231	环旭电子	2,170,703.00	14.31
200	600529	山东药玻	2,152,863.00	14.19
201	601116	三江购物	2,142,838.00	14.13
202	002123	梦网集团	2,135,805.00	14.08
203	002635	安洁科技	2,103,800.00	13.87
204	002024	苏宁易购	2,084,516.00	13.74
205	688093	世华科技	2,081,697.58	13.72
206	600188	兖州煤业	2,081,165.00	13.72
207	002853	皮阿诺	2,064,840.00	13.61
208	600061	国投资本	2,053,381.37	13.54
209	688058	宝兰德	2,042,849.35	13.47
210	601211	国泰君安	2,042,269.00	13.46
211	002049	紫光国微	2,031,718.37	13.39
212	600114	东睦股份	2,020,803.00	13.32
213	601995	中金公司	2,013,140.00	13.27

214	600536	中国软件	2,007,765.00	13.24
215	002648	卫星石化	2,004,522.00	13.21
216	688567	孚能科技	1,997,840.50	13.17
217	600989	宝丰能源	1,994,906.37	13.15
218	300378	鼎捷软件	1,991,276.00	13.13
219	688016	心脉医疗	1,989,555.41	13.12
220	002475	立讯精密	1,950,161.17	12.86
221	600496	精工钢构	1,927,865.00	12.71
222	002065	东华软件	1,925,495.00	12.69
223	002605	姚记科技	1,906,426.00	12.57
224	000878	云南铜业	1,900,935.00	12.53
225	300715	凯伦股份	1,898,550.00	12.52
226	000750	国海证券	1,895,382.00	12.50
227	600218	全柴动力	1,894,976.00	12.49
228	300648	星云股份	1,887,787.00	12.45
229	300687	赛意信息	1,874,824.00	12.36
230	688118	普元信息	1,869,199.97	12.32
231	300438	鹏辉能源	1,867,765.00	12.31
232	300607	拓斯达	1,848,119.00	12.18
233	002182	云海金属	1,830,296.35	12.07
234	002897	意华股份	1,828,623.02	12.05
235	003005	竞业达	1,809,810.33	11.93
236	002044	美年健康	1,808,274.00	11.92
237	002240	盛新锂能	1,808,124.00	11.92
238	300450	先导智能	1,805,128.00	11.90
239	600875	东方电气	1,803,655.00	11.89
240	002697	红旗连锁	1,793,235.00	11.82
241	300787	海能实业	1,789,256.00	11.80
242	002456	欧菲光	1,783,096.00	11.75
243	300206	理邦仪器	1,757,982.00	11.59
244	600196	复星医药	1,753,804.00	11.56
245	603859	能科股份	1,753,372.00	11.56
246	002129	中环股份	1,737,530.00	11.45
247	300759	康龙化成	1,735,699.00	11.44
248	603533	掌阅科技	1,705,407.00	11.24
249	000977	浪潮信息	1,685,709.00	11.11
250	600055	万东医疗	1,661,102.00	10.95
251	688039	当虹科技	1,658,289.80	10.93

252	002251	步步高	1,658,119.00	10.93
253	000333	美的集团	1,616,310.00	10.66
254	601788	光大证券	1,583,205.00	10.44
255	600547	山东黄金	1,570,039.00	10.35
256	601800	中国交建	1,547,470.00	10.20
257	603187	海容冷链	1,534,271.00	10.11
258	603626	科森科技	1,528,790.00	10.08
259	300418	昆仑万维	1,525,770.00	10.06
260	300058	蓝色光标	1,507,177.00	9.94
261	603138	海量数据	1,495,834.00	9.86
262	603010	万盛股份	1,478,875.88	9.75
263	600988	赤峰黄金	1,474,245.26	9.72
264	300133	华策影视	1,460,714.00	9.63
265	300188	美亚柏科	1,459,204.00	9.62
266	300623	捷捷微电	1,440,923.00	9.50
267	300511	雪榕生物	1,434,478.00	9.46
268	600185	格力地产	1,434,330.00	9.46
269	601198	东兴证券	1,428,700.00	9.42
270	300562	乐心医疗	1,425,731.41	9.40
271	000877	天山股份	1,420,539.00	9.36
272	300001	特锐德	1,418,914.94	9.35
273	002041	登海种业	1,412,338.00	9.31
274	600036	招商银行	1,401,761.00	9.24
275	000050	深天马 A	1,401,126.00	9.24
276	002772	众兴菌业	1,385,931.00	9.14
277	300890	翔丰华	1,384,195.00	9.13
278	601818	光大银行	1,375,112.00	9.07
279	600760	中航沈飞	1,373,420.00	9.05
280	300435	中泰股份	1,373,323.00	9.05
281	600267	海正药业	1,362,499.00	8.98
282	601878	浙商证券	1,351,280.00	8.91
283	603501	韦尔股份	1,350,578.19	8.90
284	603833	欧派家居	1,350,081.00	8.90
285	600862	中航高科	1,349,666.00	8.90
286	300738	奥飞数据	1,312,388.50	8.65
287	002028	思源电气	1,311,776.00	8.65
288	300127	银河磁体	1,290,283.00	8.51
289	688030	山石网科	1,281,840.86	8.45

290	300192	科德教育	1,277,731.85	8.42
291	002249	大洋电机	1,234,439.00	8.14
292	601390	中国中铁	1,234,338.00	8.14
293	002429	兆驰股份	1,220,354.00	8.05
294	688369	致远互联	1,215,796.28	8.01
295	002385	大北农	1,206,253.00	7.95
296	002970	锐明技术	1,201,670.00	7.92
297	002551	尚荣医疗	1,192,135.00	7.86
298	601899	紫金矿业	1,184,653.55	7.81
299	002382	蓝帆医疗	1,184,350.00	7.81
300	600406	国电南瑞	1,175,521.00	7.75
301	600872	中炬高新	1,169,736.00	7.71
302	603927	中科软	1,157,938.99	7.63
303	000069	华侨城 A	1,157,053.00	7.63
304	601598	中国外运	1,155,998.00	7.62
305	600699	均胜电子	1,134,473.19	7.48
306	601939	建设银行	1,126,618.00	7.43
307	002930	宏川智慧	1,094,461.00	7.22
308	600690	海尔智家	1,093,680.00	7.21
309	002946	新乳业	1,092,937.00	7.21
310	603939	益丰药房	1,081,102.00	7.13
311	601577	长沙银行	1,080,014.00	7.12
312	603313	梦百合	1,079,863.00	7.12
313	603128	华贸物流	1,076,099.00	7.09
314	002351	漫步者	1,069,689.00	7.05
315	300550	和仁科技	1,069,350.00	7.05
316	300753	爱朋医疗	1,068,973.00	7.05
317	688018	乐鑫科技	1,058,639.33	6.98
318	600459	贵研铂业	1,030,622.68	6.79
319	605358	立昂微	1,028,047.34	6.78
320	002007	华兰生物	1,021,755.00	6.74
321	603506	南都物业	1,019,542.00	6.72
322	002340	格林美	1,008,957.00	6.65
323	002230	科大讯飞	999,010.00	6.59
324	002987	京北方	990,270.27	6.53
325	603233	大参林	989,946.00	6.53
326	600528	中铁工业	988,988.00	6.52
327	688363	华熙生物	968,233.55	6.38

328	300260	新莱应材	966,347.00	6.37
329	603323	苏农银行	960,637.00	6.33
330	600138	中青旅	939,393.00	6.19
331	600409	三友化工	935,899.00	6.17
332	600521	华海药业	920,000.00	6.06
333	002233	塔牌集团	917,138.66	6.05
334	688051	佳华科技	910,640.52	6.00
335	000998	隆平高科	906,723.00	5.98
336	002034	旺能环境	905,227.00	5.97
337	000538	云南白药	905,105.94	5.97
338	300624	万兴科技	899,603.00	5.93
339	601658	邮储银行	894,458.00	5.90
340	000789	万年青	894,050.00	5.89
341	603103	横店影视	883,097.00	5.82
342	002918	蒙娜丽莎	875,186.00	5.77
343	300596	利安隆	874,145.00	5.76
344	688116	天奈科技	870,540.61	5.74
345	600702	ST 舍得	863,286.00	5.69
346	603283	赛腾股份	852,655.00	5.62
347	600517	国网英大	850,752.00	5.61
348	002532	天山铝业	845,813.00	5.58
349	300793	佳禾智能	834,907.00	5.50
350	002398	垒知集团	834,235.00	5.50
351	300788	中信出版	820,857.00	5.41
352	603279	景津环保	812,959.00	5.36
353	600908	无锡银行	807,925.00	5.33
354	300327	中颖电子	790,909.00	5.21
355	600499	科达制造	783,657.00	5.17
356	000756	新华制药	781,633.00	5.15
357	300770	新媒股份	779,283.00	5.14
358	300166	东方国信	774,563.98	5.11
359	601689	拓普集团	768,212.00	5.06
360	600588	用友网络	766,169.00	5.05
361	603212	赛伍技术	763,575.00	5.03
362	002264	新华都	748,949.00	4.94
363	600392	盛和资源	748,259.00	4.93
364	002727	一心堂	746,206.00	4.92
365	000960	锡业股份	743,231.00	4.90

366	688086	紫晶存储	733,060.00	4.83
367	603136	天目湖	731,195.00	4.82
368	600867	通化东宝	730,539.00	4.82
369	002859	洁美科技	728,602.20	4.80
370	600703	三安光电	725,463.00	4.78
371	601555	东吴证券	715,589.00	4.72
372	002332	仙琚制药	696,570.00	4.59
373	688036	传音控股	686,585.55	4.53
374	000059	华锦股份	678,850.00	4.48
375	000063	中兴通讯	676,430.00	4.46
376	603890	春秋电子	675,749.00	4.45
377	688200	华峰测控	666,634.49	4.39
378	600346	恒力石化	644,033.00	4.25
379	688168	安博通	638,593.68	4.21
380	000681	视觉中国	631,003.00	4.16
381	300223	北京君正	630,754.00	4.16
382	603378	亚士创能	630,679.00	4.16
383	300379	东方通	629,018.00	4.15
384	600657	信达地产	625,342.00	4.12
385	603883	老百姓	624,819.16	4.12
386	002371	北方华创	621,065.00	4.09
387	002106	莱宝高科	616,524.00	4.06
388	300306	远方信息	616,307.00	4.06
389	300248	新开普	610,049.00	4.02
390	600999	招商证券	598,668.40	3.95
391	000915	山大华特	596,195.00	3.93
392	000612	焦作万方	595,382.00	3.92
393	688595	芯海科技	594,424.82	3.92
394	600233	圆通速递	588,236.00	3.88
395	601225	陕西煤业	576,851.00	3.80
396	688066	航天宏图	565,697.19	3.73
397	300182	捷成股份	564,140.00	3.72
398	002677	浙江美大	564,080.00	3.72
399	601877	正泰电器	558,299.00	3.68
400	002110	三钢闽光	557,329.00	3.67
401	002189	中光学	541,200.00	3.57
402	600054	黄山旅游	537,764.00	3.55
403	300661	圣邦股份	534,287.00	3.52

404	002343	慈文传媒	527,378.00	3.48
405	600598	北大荒	522,557.14	3.44
406	000717	韶钢松山	521,543.00	3.44
407	002623	亚玛顿	519,439.00	3.42
408	603387	基蛋生物	512,157.70	3.38
409	002570	贝因美	510,140.00	3.36
410	603068	博通集成	507,574.00	3.35
411	002975	博杰股份	502,461.00	3.31
412	601808	中海油服	497,718.00	3.28
413	603056	德邦股份	496,881.00	3.28
414	000703	恒逸石化	494,772.00	3.26
415	002466	天齐锂业	490,290.00	3.23
416	000888	峨眉山 A	490,287.00	3.23
417	688111	金山办公	490,189.78	3.23
418	002353	杰瑞股份	484,431.00	3.19
419	000768	中航西飞	477,624.00	3.15
420	300396	迪瑞医疗	471,481.00	3.11
421	002867	周大生	468,181.00	3.09
422	002026	山东威达	466,800.00	3.08
423	002135	东南网架	466,648.00	3.08
424	688095	福昕软件	459,445.00	3.03
425	002669	康达新材	455,264.00	3.00
426	300388	国祯环保	453,551.00	2.99
427	688185	康希诺	452,402.80	2.98
428	600566	济川药业	447,115.00	2.95
429	002146	荣盛发展	446,639.00	2.94
430	603825	华扬联众	445,623.00	2.94
431	002905	金逸影视	441,837.00	2.91
432	300474	景嘉微	428,974.00	2.83
433	000524	岭南控股	427,804.00	2.82
434	688300	联瑞新材	423,032.00	2.79
435	601838	成都银行	419,224.00	2.76
436	000026	飞亚达	418,994.00	2.76
437	605099	共创草坪	415,475.00	2.74
438	002056	横店东磁	413,400.00	2.73
439	002489	浙江永强	413,364.00	2.73
440	600831	广电网络	412,706.00	2.72
441	002236	大华股份	410,210.00	2.70

442	300273	和佳医疗	405,176.00	2.67
443	688561	奇安信	403,879.50	2.66
444	300497	富祥药业	402,873.00	2.66
445	300033	同花顺	399,532.00	2.63
446	603336	宏辉果蔬	397,731.00	2.62
447	600918	中泰证券	392,988.00	2.59
448	002747	埃斯顿	386,758.00	2.55
449	688001	华兴源创	383,610.86	2.53
450	002984	森麒麟	378,572.00	2.50
451	603816	顾家家居	374,248.00	2.47
452	601319	中国人保	373,000.00	2.46
453	300525	博思软件	370,758.00	2.44
454	601609	金田铜业	365,239.00	2.41
455	603980	吉华集团	362,940.00	2.39
456	601003	柳钢股份	361,204.60	2.38
457	300316	晶盛机电	357,500.00	2.36
458	300175	朗源股份	356,752.00	2.35
459	000559	万向钱潮	354,600.00	2.34
460	300463	迈克生物	352,530.00	2.32
461	603260	合盛硅业	348,940.00	2.30
462	603697	有友食品	345,933.00	2.28
463	300224	正海磁材	336,324.00	2.22
464	000099	中信海直	336,055.99	2.22
465	002291	星期六	335,933.00	2.21
466	002796	世嘉科技	334,404.00	2.20
467	300610	晨化股份	330,016.00	2.18
468	000027	深圳能源	328,313.00	2.16
469	000932	华菱钢铁	324,170.00	2.14
470	600742	一汽富维	322,920.00	2.13
471	002139	拓邦股份	322,878.00	2.13
472	603612	索通发展	320,218.00	2.11
473	002390	信邦制药	319,473.00	2.11
474	002839	张家港行	318,000.00	2.10
475	002262	恩华药业	317,812.00	2.10
476	600096	云天化	316,244.00	2.08
477	002861	瀛通通讯	315,000.00	2.08
478	600926	杭州银行	303,750.00	2.00

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	1,689,333,844.62
卖出股票收入（成交）总额	1,684,612,530.92

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	-	-
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）	48,500.00	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	48,500.00	0.08

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	128142	新乳转债	485	48,500.00	0.08

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/	合约市值	公允价值变	风险说明
----	----	--------	------	-------	------

	卖)	(元)	动(元)	
-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)				-
股指期货投资本期收益(元)				-274,040.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)				0.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

=

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

=

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期本基金未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

=

8.12 投资组合报告附注

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

(1) 诚迈科技(代码: 300598)是中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金的前十大持仓债券,因业绩预测结果不准确或不及时,深圳证券交易所于 2020-06-15 依据相关法规给予:监管关注处分决定

(2) 杭可科技(代码:688006)是中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金的前十大持仓债券,因未及时披露公司重大事项,中国证券监督管理委员会于 2020-04-10 依据相关法规给予:其他处分决定

上述股票投资决策符合公司投资制度的规定,除诚迈科技、杭可科技外,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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

带格式的: 缩进: 首行缩进: 0 字符

序号	名称	金额
1	存出保证金	202,109.60
2	应收证券清算款	2,171,363.35
3	应收股利	-
4	应收利息	1,576.43
5	应收申购款	229,118.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,604,168.13

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。

§ 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
中科沃土沃瑞混合发起 A	1,607	11,006.94	8,003,602.74	45.25%	9,684,551.63	54.75%
中科沃土沃瑞混合发起 C	2,782	3,756.57	2,123,946.35	20.32%	8,326,843.48	79.68%
合计	4,224	6,661.68	10,127,549.09	35.99%	18,011,395.11	64.01%

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	中科沃土沃瑞混合发起 A	1,725,816.51	6.1300%
	中科沃土沃瑞混合发起 C	80,389.05	0.2900%
	合计	1,806,205.56	6.4200%

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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中科沃土沃瑞混合发起 A	50~100
	中科沃土沃瑞混合发起 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	中科沃土沃瑞混合发起 A	50~100

	中科沃土沃瑞混合发起 C	0~10
	合计	>100

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	108,749.48	0.39	108,749.48	0.88	3 年
基金经理等人员	804,089.32	2.89	804,089.32	6.52	3 年
基金管理人股东	9,004,013.70	32.00	9,004,013.70	73.02	3 年
其他	89,834.36	0.32	89,834.36	0.73	3 年
合计	10,006,686.86	35.59	10,006,686.86	81.15	3 年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中科沃土沃瑞混合 发起 A	中科沃土沃瑞混合 发起 C
基金合同生效日（2019 年 1 月 14 日）基金 份额总额	8,992,376.24	1,486,436.45
本报告期期初基金份额总额	10,681,489.09	1,650,035.76
本报告期基金总申购份额	31,349,199.79	80,337,976.80
减：本报告期基金总赎回份额	24,342,534.51	71,537,222.73
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	17,688,154.37	10,450,789.83

§ 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

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。本基金管理人 2020 年公司高级管理人员任免情况具体如下：2020 年 4 月 28 日，傅军先生离任公司副总经理、首席信息官职务，李峰先生担任公司首席信息官职务；2020 年 5 月 18 日，于建伟先生担任公司总经理职务，程文卫先生离任公司总经理职务并转任公司常务副总经理职务；2020 年 6 月 22 日起，林峰先生担任公司副总经理职务。以上事项均于发布公告。

本报告期内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由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，审计费用 40,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

报告期内，公司收到中国证券监督管理委员会广东监管局对我司采取责令改正措施的决定，对公司提出整改要求。公司已及时完成了整改。

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	
银河证券	2	856,430,245.23	25.39%	626,287.65	25.39%	-
长城证券	1	576,071,506.26	17.08%	421,267.70	17.08%	-

东方财富证券	2	505,814,772.41	15.00%	369,904.15	15.00%	-
国融证券	1	487,464,272.72	14.45%	356,483.56	14.45%	-
中信建投	2	397,081,804.65	11.77%	290,362.41	11.77%	-
东兴证券	1	379,354,844.64	11.25%	277,422.40	11.25%	-
国盛证券	1	170,870,593.00	5.07%	124,958.14	5.07%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-

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	
	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
银河证券	-	-	53,000,000.00	11.82%	-	-
长城证券	-	-	188,700,000.00	42.07%	-	-
东方财富证券	-	-	35,000,000.00	7.80%	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	171,800,000.00	38.31%	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

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	中科沃土其他重大事项公告	公司网站、上海证券报	2020年2月3日
2	中科沃土其他重大事项公告	公司网站、上海证券报	2020年2月17日
3	中科沃土其他重大事项公告	公司网站、上海证券报	2020年3月25日
4	中科沃土其他重大事项公告	公司网站、上海证券报	2020年3月30日
5	中科沃土基金营销活动相关公告	公司网站、上海证券报	2020年4月9日
6	中科沃土沃瑞混合发起基金营销活动相关公告	公司网站、上海证券报	2020年5月8日

7	中科沃土基金关于旗下基金在泰诚财富基金销售（大连）有限公司暂停办理相关销售业务的公告	公司网站、上海证券报	2020 年 6 月 6 日
8	中科沃土基金管理有限公司关于旗下基金参加银河证券申购费率优惠活动的公告	公司网站、上海证券报	2020 年 6 月 8 日
9	中科沃土基金管理有限公司关于公司股东名称及住所变更的公告	公司网站、上海证券报	2020 年 7 月 17 日
10	中科沃土基金管理有限公司关于新增恒泰证券为旗下部分基金销售机构的公告	公司网站、上海证券报	2020 年 9 月 3 日
11	中科沃土基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告	公司网站、上海证券报	2020 年 9 月 15 日
12	中科沃土基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	公司网站、上海证券报	2020 年 11 月 2 日
13	中科沃土基金管理有限公司关于新增招商证券为旗下部分基金销售机构的公告	公司网站、上海证券报	2020 年 12 月 1 日

§ 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	20210101-20210312	8,003,602.74	-	-	8,003,602.74	28.44%
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瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的文件；
2. 《中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金合同》；
3. 《中科沃土沃瑞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瑞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

2021 年 3 月 30 日