

# 中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

## 2024 年年度报告

2024 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: 浙商银行股份有限公司

送出日期: 2025 年 03 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年3月27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。容诚会计师事务所（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2024年1月1日起至12月31日止。

## 1.2 目录

|                                              |    |
|----------------------------------------------|----|
| §1 重要提示及目录.....                              | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| 1.2 目录.....                                  | 3  |
| §2 基金简介.....                                 | 5  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6  |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....                 | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 10 |
| §4 管理人报告.....                                | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 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.....             | 16 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 16 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 17 |
| 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.....                                | 18 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 18 |
| 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..... | 18 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....       | 18 |
| §6 审计报告.....                                 | 18 |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 19 |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 19 |
| §7 年度财务报表.....                               | 22 |
| 7.1 资产负债表.....                               | 22 |
| 7.2 利润表.....                                 | 23 |
| 7.3 净资产变动表.....                              | 25 |
| 7.4 报表附注.....                                | 27 |
| §8 投资组合报告.....                               | 58 |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 58 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 59 |
| 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.....       | 59 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 60 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 62 |
| 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.....      | 62 |
| 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.....   | 62 |
| 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.....   | 62 |
| 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.....      | 62 |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                     | 63 |

|                                          |    |
|------------------------------------------|----|
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....           | 63 |
| 8.12 投资组合报告附注.....                       | 63 |
| §9 基金份额持有人信息.....                        | 64 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....               | 64 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....            | 64 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....    | 64 |
| §10 开放式基金份额变动.....                       | 64 |
| §11 重大事件揭示.....                          | 65 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                    | 65 |
| 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.....    | 65 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....         | 65 |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                      | 65 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....               | 65 |
| 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.....       | 65 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....              | 66 |
| 11.8 其他重大事件.....                         | 67 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息.....                  | 70 |
| 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..... | 70 |
| §13 备查文件目录.....                          | 70 |
| 13.1 备查文件目录.....                         | 70 |
| 13.2 存放地点.....                           | 71 |
| 13.3 查阅方式.....                           | 71 |

## §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06日         |                |
| 基金管理人           | 中科沃土基金管理有限公司        |                |
| 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      | 137,464,806.61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 | 75,405,540.28份      | 62,059,266.33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      |      | 中科沃土基金管理有限公司                           | 浙商银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 李峰                                     | 林彬                   |
|         | 联系电话 | 0757-86208608                          | 0571-88269636        |
|         | 电子邮箱 | lifeng0214@richlandasm.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   |      | 于建伟                                    | 陆建强                  |

## 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                                                                      |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.richlandasm.com.cn">http://www.richlandasm.com.cn</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号千灯湖创投小镇核心区（自编号）十三座（B4）                                    |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称               | 办公地址                               |
|--------|------------------|------------------------------------|
| 会计师事务所 | 容诚会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26 |

|        |              |                                                |
|--------|--------------|------------------------------------------------|
| 注册登记机构 | 中科沃土基金管理有限公司 | 佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号<br>千灯湖创投小镇核心区（自编号）<br>十三座（B4） |
|--------|--------------|------------------------------------------------|

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2024年          |                | 2023年          |                | 2022年          |                |
|---------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
|               | 中科沃土沃嘉混合A      | 中科沃土沃嘉混合C      | 中科沃土沃嘉混合A      | 中科沃土沃嘉混合C      | 中科沃土沃嘉混合A      | 中科沃土沃嘉混合C      |
| 本期已实现收益       | -15,000,250.24 | -13,960,696.90 | 8,355,334.50   | 4,645,410.93   | 23,795,867.75  | 9,697,232.73   |
| 本期利润          | 1,498,415.45   | 2,691,476.80   | 8,953,402.65   | 4,323,627.44   | 4,864,142.64   | 1,525,646.83   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0152         | 0.0317         | 0.0285         | 0.0220         | 0.0085         | 0.0060         |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.21%          | 2.58%          | 2.25%          | 1.78%          | 0.69%          | 0.50%          |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.64%          | 2.43%          | 0.79%          | 0.59%          | 0.70%          | 0.51%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2024年末         |                | 2023年末         |                | 2022年末         |                |
| 期末可供分配利润      | 13,119,835.17  | 8,697,738.12   | 52,435,913.19  | 30,872,425.79  | 120,859,597.32 | 52,568,257.53  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1740         | 0.1402         | 0.2532         | 0.2204         | 0.2434         | 0.2133         |
| 期末基金资产净值      | 96,996,281.14  | 77,572,144.03  | 259,506,309.19 | 170,951,635.40 | 617,468,041.76 | 299,030,426.98 |
| 期末基金份额净值      | 1.2863         | 1.2500         | 1.2532         | 1.2204         | 1.2434         | 1.2133         |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2024年末         |                | 2023年末         |                | 2022年末         |                |
| 基金份额累计净值增长率   | 28.63%         | 25.00%         | 25.32%         | 22.04%         | 24.34%         | 21.33%         |

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<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 0.89%        | 0.03%               | 0.29%              | 0.86%                     | 0.60%  | -0.83% |
| 过去六个月          | 1.20%        | 0.03%               | 8.42%              | 0.81%                     | -7.22% | -0.78% |
| 过去一年           | 2.64%        | 0.22%               | 10.35%             | 0.66%                     | -7.71% | -0.44% |
| 过去三年           | 4.18%        | 0.21%               | -6.18%             | 0.58%                     | 10.36% | -0.37% |
| 过去五年           | 44.01%       | 0.71%               | 5.21%              | 0.61%                     | 38.80% | 0.10%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 28.63%       | 0.67%               | 10.30%             | 0.62%                     | 18.33% | 0.05%  |

中科沃土沃嘉混合C

| 阶段    | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④    |
|-------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.84%        | 0.03%               | 0.29%              | 0.86%                     | 0.55%  | -0.83% |
| 过去六个月 | 1.10%        | 0.03%               | 8.42%              | 0.81%                     | -7.32% | -0.78% |
| 过去一年  | 2.43%        | 0.22%               | 10.35%             | 0.66%                     | -7.92% | -0.44% |
| 过去三年  | 3.55%        | 0.21%               | -6.18%             | 0.58%                     | 9.73%  | -0.37% |
| 过去五年  | 42.53%       | 0.71%               | 5.21%              | 0.61%                     | 37.32% | 0.10%  |
| 自基金合同 | 25.00%       | 0.67%               | 10.30%             | 0.62%                     | 14.70% | 0.05%  |



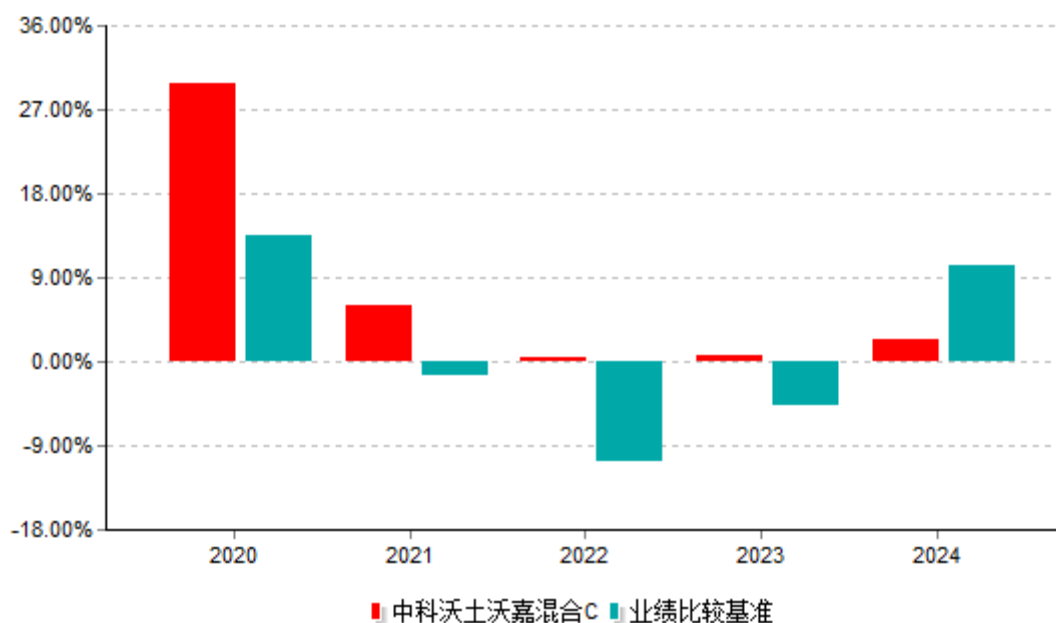
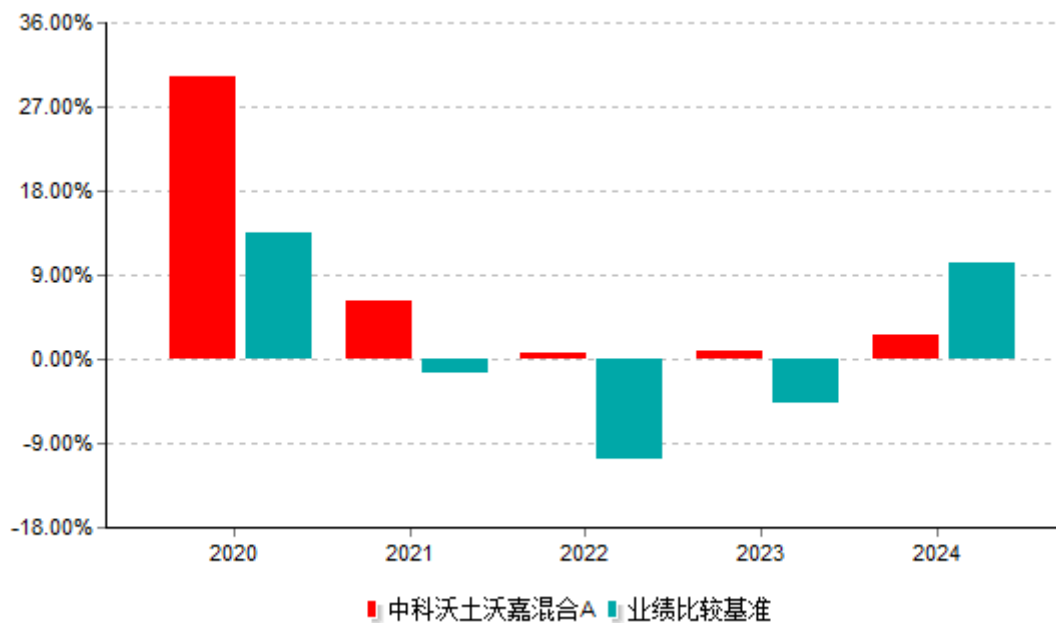
|       |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|

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



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中科沃土基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2015]1937号文批准，于2015年9月6日正式成立，注册资本2.42亿元，是国内第100家公募基金管理公司，也是一家拥有PE背景的公募基金管理公司。中科沃土带着中科招商、粤科金融等主要股东强大的精神基因和优秀的文化基因，始终贯彻“持有人利益至上”的首要经营原则，遵循诚信、规范、稳健的经营方针，崇尚价值投资理念和长期、平稳、盈利的投资风格，致力于为持有人提供专业、精品、创新的投资理财服务，创造成长价值，汇聚阳光财富。截至2024年12月31日，中科沃土旗下共管理6只开放式基金：中科沃土货币市场基金、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金和中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                    |
|-----|----------|-----------------|------|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |          | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                       |
| 董清源 | 基金经理     | 2022-04-29      | -    | 11年    | 金融学硕士。曾任北京康思资本管理有限公司债券交易员、投资经理、投资总监，首建投信和（北京）资产管理有限公司常务副总经理，北京康思资本管理有限公司副总经理，现任中科沃土基金管理有限公司中科沃土沃盛纯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、中科沃土货币市场基金和中科沃土沃安中短期利率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。 |
| 徐平安 | 权益研究部副总经 | 2024-01-04      | -    | 10年    | 金融工程硕士。曾任法国邮                                                                                                                                                                          |

|     |                      |            |            |     |                                                                                                                                                                                     |
|-----|----------------------|------------|------------|-----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     | 理（主持工作）、基金经理         |            |            |     | 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，现任中科沃土基金管理有限公司权益研究部副总经理（主持工作），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。 |
| 孟禄程 | 权益研究部副总经理（主持工作）、基金经理 | 2019-11-08 | 2024-01-04 | 9年  | 理学硕士。曾任广东东阳光药业研究院研发工程师，广东中科招商创业投资管理有限公司公募筹备组组员，中科沃土基金管理有限公司权益研究部副总经理（主持工作）、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。                                            |
| 李欣桐 | 固定收益总监兼固定收益部总经理、基金经理 | 2021-04-09 | 2024-01-02 | 10年 | 国际经济法硕士。曾任粤开证券（原联讯证券）固定收益部交易员、资产管理部投资经理，北京康思资本管理有限公司投资交易部投资总监，中科沃土基金管理有                                                                                                             |

|     |                       |            |   |     |                                                                                                                                                                                                                      |
|-----|-----------------------|------------|---|-----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                       |            |   |     | 限公司固定收益部副总经理（主持工作）、中科沃土货币市场基金、中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金和中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，现任中科沃土基金管理有限公司固定收益总监兼固定收益部总经理。中国国籍，具有基金从业资格。                                                                                                |
| 卢振荣 | 公司总经理助理、固定收益部总经理、基金经理 | 2025-03-05 | - | 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，现任中科沃土基金管理有限公司总经理助理、固定收益部总经理，中科沃土基金管理有限公司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和中科沃土沃安中短期利率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.李欣桐于2024年1月2日起不再担任此基金的基金经理，已于2024年1月3日公告；  
4.孟禄程于2024年1月4日起不再担任此基金的基金经理，徐平安于2024年1月4日起担任

此基金的基金经理，已于2024年1月5日公告。

5.卢振荣自2025年3月5日起担任此基金的基金经理，已于2025年3月6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 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

国内宏观经济震荡寻底。2024年全年GDP增速5%，完成年初预期目标，规模以上工业增加值同比增长5.8%，CPI同比上涨0.2%，PPI同比下降2.2%，物价运行总体稳定，失业率为5.1%，就业形势总体稳定。全国固定资产投资同比增长3.2%，其中制造业投资同比增长9.2%，对经济稳增长起到积极作用；基础设施投资同比增长4.4%；房地产开发投资同比下降10.6%，对投资端起到拖累作用。国内消费品社会零售总额同比增长3.5%，实现平稳增长。进出口贸易总额同比增长5%，出口同比增长7%，在动荡的国际经济形势背景下，外贸整体维持了强有力的韧性。分季度看，第一和第四季度受稳增长政策影响，整体数据好于二三季度。

国内政策方面：宽松的货币政策和积极的财政政策助力稳增长的诉求。今年以来降低存款准备金率2次，累计降准100bp，幅度超过去年。同时，降息3次，1年期LPR累计调降35bp,5年期累计调降60bp，降幅较大，助力全社会降低融资成本，减轻债务压力。财政政策方面，通过加力落实存量政策和增量财政政策推动经济回稳向好，此外，一系列的房地产支持政策落地也有利于房地产行业加速寻底。

债券二级市场方面：2024年银行间资金面整体维持合理宽裕水平，为债市收益率整体下行提供了良好的资金环境。同时，受降准、降息等宽松的货币政策和相对疲弱的经济数据以及供需不平衡等共同作用的综合影响，信用债和利率债的收益率都有明显的下行，各类型的利差压缩明显，收益率曲线整体下移。其中，10年期国债收益率从年初2.56%下行至1.68%，30年期国债也从2.84%跌至1.91%，均刷新了记录低位。

权益市场方面：全年A股走势与国民经济的运行节奏如出一辙。前三季度，受国内经济复苏缓慢影响，A股市场整体呈区间震荡下行格局。而三季度末国内宏观政策出现重大转向后，市场各大指数触底反弹，并于国庆假期后第一个交易日迅速突破前高。四季度在积极的政策预期引导下，权益市场中枢点位已显著上移，投资者风险偏好明显改善，沪深两市成交额显著放量，各主要指数年内均录得正收益。回顾全年，沪深300指

数全年上涨超过14%，半导体自主可控、人工智能及AI计算等高景气热门硬科技赛道表现突出。

2024年面对复杂多变的资本市场，本基金产品采用灵活的资产配置方案，基于宏观政策和基本面的变化，对组合内不同资产占比、杠杆率及组合久期等积极调节优化，在保证产品安全运行的前提下，努力提高产品收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中科沃土沃嘉混合A基金份额净值为1.2863元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.64%，同期业绩比较基准收益率为10.35%；截至报告期末中科沃土沃嘉混合C基金份额净值为1.2500元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.43%，同期业绩比较基准收益率为10.35%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

为稳定经济增长，推动经济回稳向好，刚过去的4季度中央经济工作会议强调要实施更加积极的财政政策，提高财政赤字率，确保财政政策持续用力，更加给力。同时，要实施适度宽松的货币政策，发挥好货币政策工具和结构双重功能，适时降准降息，保持流动性充裕。会议对2025年的财政政策和货币政策进行了有力指导和方向定调，预计更加宽松的货币政策将会降低全社会资金融资成本。基于债市收益率4季度对2025年降息降准的预期较为充分，抢跑效应明显，且随着稳增长政策的逐步落地，经济基本面有企稳向好的更大动力，预计全年债市收益率波动会加剧。同时，在绝对收益率处于历史低位的同时，债券波段交易将是债券型基金获利的重要手段。同时，应该警惕因阶段性债券供给加大，导致的流动性紧张，从而引发债市收益率短期快速回调的风险。国外方面，随着特朗普总统上台，各种政策和政令的颁布预计会对国内的制造业实体和外贸企业产生或多或少的影响，对我国汇率也会有影响，进而影响国内货币政策出台的时间及力度，我们应予以关注。

2025年，基金管理人将继续规范运作，勤勉尽责。本基金将积极把握市场机会，灵活运用久期策略、杠杆策略，优化投资组合，在保证流动性安全的前提下，提高组合收益率。

#### 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,促进公司合规文化建设；不断完善相关机制流程，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易和市场操纵等违法违规行为，完善利益冲突管理相关制度机制。

(3) 坚持规范运作、稳健经营的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统，积极配合各类新产品、新业务、新投资工具的推出和应用，重点加强对高风险业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，加强对投资、交易等业务运作的日常合规检查和反馈提示，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规和基金合同的要求稳健、规范运作。

(4) 对投资交易、销售宣传、人员规范及个人投资申报、运营维稳、反洗钱、IT 治理等方面开展了定期或专项监察检查，推动公司合规、内控体系的健全完善。

(5) 积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关的合规、风控问题提供意见和建议。

(6) 切实把好法律风险和业务风险关；根据公司业务发展的需要，紧贴业务需求，不断提高合同审核效率，有效控制法律风险和业务风险；

(7) 深入贯彻风险为本的监管精神，加强公司洗钱风险管理体系建设，建立优化客户、产品、业务的洗钱风险识别和洗钱风险自评估工作机制，探索实施符合基金业务特征的可疑交易监控模型和方法，开展反洗钱宣传培训、内部审计、信息报送、意见反馈等各项工作。

(8) 紧跟法规变化和业务发展，认真做好公司及旗下各基金的各项信息披露工作，力求信息披露真实、完整、准确、及时、简明易懂。

(9) 不断促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，充分法规合规监控与监察稽核的独立性、规范性、针对性与有效性。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规的要求履行估值和净值计算的复核责任。

本基金管理人已制定基金估值和份额计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；设有估值委员会，负责指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运营等方面的专业胜任能力。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。基金管理人改变估值技术，导致基金净值变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“（三）基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期末未进行利润分配，符合合同规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，无相关预警说明。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人--中科沃土基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中科沃土基金管理有限公司编制和披露的中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金2024年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

### §6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                   |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见             |
| 审计报告编号     | 容诚审字[2025]200Z1605号 |

6.2 审计报告的基本内容

|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-----------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计报告标题    | 审计报告                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 审计报告收件人   | 中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 审计意见      | <p>我们审计了中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金（以下简称"中科沃土沃嘉混合基金"）财务报表，包括2024年12月31日的资产负债表，2024年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>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嘉混合基金2024年12月31日的财务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况。</p> |
| 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。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嘉混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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>                                                                                                                       |
| 强调事项      | -                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 其他事项      | -                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 其他信息      | 中科沃土沃嘉混合基金的基金管理人中科沃土                                                                                                                                                                                                                                                                 |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 | <p>基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括中科沃土沃嘉混合基金2024年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>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嘉混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中科沃土沃嘉混合基金、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嘉混合基金的财务报告过程。</p>                     |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <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</p>                                                                                                                                                             |

|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|-----------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|           | <p>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>（1）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>（2）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>（3）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>（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对中科沃土沃嘉混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中科沃土沃嘉混合基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报、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 | 容诚会计师事务所（特殊普通合伙）                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

|           |                                    |     |
|-----------|------------------------------------|-----|
| 注册会计师的姓名  | 周祎                                 | 姜爱悦 |
| 会计师事务所的地址 | 北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26 |     |
| 审计报告日期    | 2025-03-27                         |     |

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024年12月31日

单位：人民币元

| 资产       | 附注号     | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|----------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产：      |         |                    |                     |
| 货币资金     | 7.4.7.1 | 1,075,333.48       | 29,383,576.83       |
| 结算备付金    |         | 2,282.25           | 1,476,968.05        |
| 存出保证金    |         | 94.42              | 24,425.25           |
| 交易性金融资产  | 7.4.7.2 | 135,826,012.55     | 390,043,511.74      |
| 其中：股票投资  |         | 25,701.11          | 132,182,589.61      |
| 基金投资     |         | -                  | -                   |
| 债券投资     |         | 135,800,311.44     | 257,860,922.13      |
| 资产支持证券投资 |         | -                  | -                   |
| 贵金属投资    |         | -                  | -                   |
| 其他投资     |         | -                  | -                   |
| 衍生金融资产   | 7.4.7.3 | -                  | -                   |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | 38,005,076.72      | 10,093,355.60       |
| 应收清算款    |         | -                  | 151,089.71          |
| 应收股利     |         | -                  | -                   |
| 应收申购款    |         | 89.94              | 63.62               |
| 递延所得税资产  |         | -                  | -                   |
| 其他资产     | 7.4.7.6 | -                  | -                   |
| 资产总计     |         | 174,908,889.36     | 431,172,990.80      |

| 负债和净资产    | 附注号     | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023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 |         | -                  | -                   |
| 应付清算款     |         | -                  | -                   |
| 应付赎回款     |         | 2,999.49           | 67,295.09           |
| 应付管理人报酬   |         | 118,059.25         | 289,980.99          |
| 应付托管费     |         | 22,136.12          | 54,371.43           |
| 应付销售服务费   |         | 13,119.17          | 28,863.32           |
| 应付投资顾问费   |         | -                  | -                   |
| 应交税费      |         | -                  | 26,068.86           |
| 应付利润      |         | -                  | -                   |
| 递延所得税负债   |         | -                  | -                   |
| 其他负债      | 7.4.7.7 | 184,150.16         | 248,466.52          |
| 负债合计      |         | 340,464.19         | 715,046.21          |
| 净资产:      |         |                    |                     |
| 实收基金      | 7.4.7.8 | 137,464,806.61     | 347,149,605.61      |
| 未分配利润     | 7.4.7.9 | 37,103,618.56      | 83,308,338.98       |
| 净资产合计     |         | 174,568,425.17     | 430,457,944.59      |
| 负债和净资产总计  |         | 174,908,889.36     | 431,172,990.80      |

注：报告截止日2024年12月31日，基金份额总额137,464,806.61份，其中A类基金份额净值1.2863元，A类基金份额总额75,405,540.28份；C类基金份额净值1.2500元，C类基金份额总额62,059,266.33份。

7.2 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：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期 |
|-----|-----|----|--------|
|-----|-----|----|--------|

|                       |            | 2024年01月01日至20<br>24年12月31日 | 间<br>2023年01月01<br>日至2023年12<br>月31日 |
|-----------------------|------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>        |            | 6,832,858.07                | 20,971,889.14                        |
| 1.利息收入                |            | 963,294.31                  | 3,443,252.73                         |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.10   | 49,496.43                   | 141,850.55                           |
| 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            |            | 913,797.88                  | 3,301,402.18                         |
| 其他利息收入                |            | -                           | -                                    |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | -27,300,920.40              | 17,225,049.44                        |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.11   | -31,873,469.72              | -6,336,120.68                        |
| 基金投资收益                |            | -                           | -                                    |
| 债券投资收益                | 7.4.7.12   | 4,548,299.24                | 20,051,476.54                        |
| 资产支持证券投资收益            | 7.4.7.13   | -                           | -                                    |
| 贵金属投资收益               |            | -                           | -                                    |
| 衍生工具收益                | 7.4.7.14   | -                           | 49,103.81                            |
| 股利收益                  | 7.4.7.15   | 24,250.08                   | 3,460,589.77                         |
| 其他投资收益                |            | -                           | -                                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16   | 33,150,839.39               | 276,284.66                           |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                           | -                                    |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.17   | 19,644.77                   | 27,302.31                            |
| <b>减：二、营业总支出</b>      |            | 2,642,965.82                | 7,694,859.05                         |
| 1.管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 1,838,033.37                | 5,152,810.84                         |
| 2.托管费                 | 7.4.10.2.2 | 344,631.25                  | 966,152.07                           |
| 3.销售服务费               | 7.4.10.2.3 | 210,155.06                  | 487,330.13                           |
| 4.投资顾问费               |            | -                           | -                                    |



|                     |          |              |               |
|---------------------|----------|--------------|---------------|
| 5.利息支出              |          | 16,262.02    | 780,503.43    |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | 16,262.02    | 780,503.43    |
| 6.信用减值损失            | 7.4.7.18 | -            | -             |
| 7.税金及附加             |          | 6,384.12     | 56,462.58     |
| 8.其他费用              | 7.4.7.19 | 227,500.00   | 251,600.00    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 4,189,892.25 | 13,277,030.09 |
| 减：所得税费用             |          | -            | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 4,189,892.25 | 13,277,030.09 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |          | -            | -             |
| 六、综合收益总额            |          | 4,189,892.25 | 13,277,030.09 |

7.3 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：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

| 项 目                      | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 |                |                 |
|--------------------------|-------------------------------|----------------|-----------------|
|                          | 实收基金                          | 未分配利润          | 净资产合计           |
| 一、上期期末净资产                | 347,149,605.61                | 83,308,338.98  | 430,457,944.59  |
| 二、本期期初净资产                | 347,149,605.61                | 83,308,338.98  | 430,457,944.59  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）     | -209,684,799.00               | -46,204,720.42 | -255,889,519.42 |
| （一）、综合收益总额               | -                             | 4,189,892.25   | 4,189,892.25    |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资 | -209,684,799.00               | -50,394,612.67 | -260,079,411.67 |

|                                          |                                    |                 |                 |
|------------------------------------------|------------------------------------|-----------------|-----------------|
| 产减少以“-”号填列)                              |                                    |                 |                 |
| 其中：1.基金申购款                               | 456,307.39                         | 110,918.68      | 567,226.07      |
| 2.基金赎回款                                  | -210,141,106.39                    | -50,505,531.35  | -260,646,637.74 |
| (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                                | 137,464,806.61                     | 37,103,618.56   | 174,568,425.17  |
| 项 目                                      | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |                 |                 |
|                                          | 实收基金                               | 未分配利润           | 净资产合计           |
| 一、上期期末净资产                                | 743,070,613.89                     | 173,427,854.85  | 916,498,468.74  |
| 二、本期期初净资产                                | 743,070,613.89                     | 173,427,854.85  | 916,498,468.74  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -395,921,008.28                    | -90,119,515.87  | -486,040,524.15 |
| (一)、综合收益总额                               | -                                  | 13,277,030.09   | 13,277,030.09   |
| (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)      | -395,921,008.28                    | -103,396,545.96 | -499,317,554.24 |
| 其中：1.基金申购款                               | 321,141,177.27                     | 78,192,731.92   | 399,333,909.19  |
| 2.基金赎回款                                  | -717,062,185.55                    | -181,589,277.88 | -898,651,463.43 |
| (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        | 347,149,605.61 | 83,308,338.98 | 430,457,944.59 |

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      | 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 |

7.4 报表附注

7.4.1 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，由中科沃土基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中科沃土沃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中科沃土基金管理有限公司，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%。

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2025年3月27日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、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。

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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1)金融资产

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

特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

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

##### 以摊余成本计量：

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

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

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

### (2)金融负债

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

### (3)衍生金融工具

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本 and 努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有

不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

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

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

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

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

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策



- 1、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，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；
- 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20%，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、同一类别的每一基金份额享有同等分配权；6、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，本基金确定以下交易性金融资产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，根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通

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

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券及可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号

《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券及可交换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

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

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

按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| 活期存款   | 1,075,333.48       | 29,383,576.83       |
| 等于：本金  | 1,075,311.39       | 29,381,728.10       |
| 加：应计利息 | 22.09              | 1,848.73            |
| 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           | 1,075,333.48 | 29,383,576.83 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2024年12月31日  |              |                |                |
|---------------|-------|---------------------|--------------|----------------|----------------|
|               |       | 成本                  | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 8,746.46            | -            | 25,701.11      | 16,954.65      |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                   | -            | -              | -              |
| 债券            | 交易所市场 | -                   | -            | -              | -              |
|               | 银行间市场 | 132,344,660.00      | 2,129,311.44 | 135,800,311.44 | 1,326,340.00   |
|               | 合计    | 132,344,660.00      | 2,129,311.44 | 135,800,311.44 | 1,326,340.00   |
| 资产支持证券        |       | -                   | -            | -              | -              |
| 基金            |       | -                   | -            | -              | -              |
| 其他            |       | -                   | -            | -              | -              |
| 合计            |       | 132,353,406.46      | 2,129,311.44 | 135,826,012.55 | 1,343,294.65   |
| 项目            |       | 上年度末<br>2023年12月31日 |              |                |                |
|               |       | 成本                  | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 164,804,640.06      | -            | 132,182,589.61 | -32,622,050.45 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                   | -            | -              | -              |

|        |       |                |              |                |                |
|--------|-------|----------------|--------------|----------------|----------------|
| 债券     | 交易所市场 | -              | -            | -              | -              |
|        | 银行间市场 | 251,374,494.29 | 5,671,922.13 | 257,860,922.13 | 814,505.71     |
|        | 合计    | 251,374,494.29 | 5,671,922.13 | 257,860,922.13 | 814,505.71     |
| 资产支持证券 |       | -              | -            | -              | -              |
| 基金     |       | -              | -            | -              | -              |
| 其他     |       | -              | -            | -              | -              |
| 合计     |       | 416,179,134.35 | 5,671,922.13 | 390,043,511.74 | -31,807,544.74 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2024年12月31日  |           |
|-------|---------------------|-----------|
|       | 账面余额                | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                   | -         |
| 银行间市场 | 38,005,076.72       | -         |
| 合计    | 38,005,076.72       | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2023年12月31日 |           |
|       | 账面余额                | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                   | -         |
| 银行间市场 | 10,093,355.60       | -         |
| 合计    | 10,093,355.60       | -         |

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 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

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 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | -                  | 4.16                |
| 应付证券出借违约金   | -                  | -                   |
| 应付交易费用      | 4,850.16           | 44,462.36           |
| 其中：交易所市场    | 33.81              | 39,175.55           |
| 银行间市场       | 4,816.35           | 5,286.81            |
| 应付利息        | -                  | -                   |
| 预提费用-审计费    | 50,000.00          | 75,000.00           |
| 预提费用-信息披露费  | 120,000.00         | 120,000.00          |
| 预提费用-账户维护费  | 9,300.00           | 9,000.00            |
| 合计          | 184,150.16         | 248,466.52          |

7.4.7.8 实收基金

7.4.7.8.1 中科沃土沃嘉混合A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(中科沃土沃嘉混合A) | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 |                 |
|-------------------|-------------------------------|-----------------|
|                   | 基金份额（份）                       | 账面金额            |
| 上年度末              | 207,070,396.00                | 207,070,396.00  |
| 本期申购              | 152,252.84                    | 152,252.84      |
| 本期赎回（以“-”号填列）     | -131,817,108.56               | -131,817,108.56 |
| 本期末               | 75,405,540.28                 | 75,405,540.28   |

7.4.7.8.2 中科沃土沃嘉混合C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(中科沃土沃嘉混合C) | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 |                |
|-------------------|-------------------------------|----------------|
|                   | 基金份额（份）                       | 账面金额           |
| 上年度末              | 140,079,209.61                | 140,079,209.61 |
| 本期申购              | 304,054.55                    | 304,054.55     |
| 本期赎回（以“-”号填列）     | -78,323,997.83                | -78,323,997.83 |
| 本期末               | 62,059,266.33                 | 62,059,266.33  |

注:红利再投及转入份额计入本期申购，转出份额计入本期赎回。

7.4.7.9 未分配利润

7.4.7.9.1 中科沃土沃嘉混合A

单位：人民币元

| 项目<br>(中科沃土沃嘉混合A) | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|-------------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末              | 61,489,836.20  | -9,053,923.01 | 52,435,913.19  |
| 本期期初              | 61,489,836.20  | -9,053,923.01 | 52,435,913.19  |
| 本期利润              | -15,000,250.24 | 16,498,665.69 | 1,498,415.45   |
| 本期基金份额交易产生的变动数    | -33,369,750.79 | 1,026,163.01  | -32,343,587.78 |
| 其中：基金申购款          | 36,388.23      | 3,385.93      | 39,774.16      |
| 基金赎回款             | -33,406,139.02 | 1,022,777.08  | -32,383,361.94 |
| 本期已分配利润           | -              | -             | -              |
| 本期末               | 13,119,835.17  | 8,470,905.69  | 21,590,740.86  |

7.4.7.9.2 中科沃土沃嘉混合C

单位：人民币元

| 项目<br>(中科沃土沃嘉混合C) | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|-------------------|----------------|---------------|---------------|
| 上年度末              | 36,763,197.11  | -5,890,771.32 | 30,872,425.79 |
| 本期期初              | 36,763,197.11  | -5,890,771.32 | 30,872,425.79 |
| 本期利润              | -13,960,696.90 | 16,652,173.70 | 2,691,476.80  |

|                |                |               |                |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -14,104,762.09 | -3,946,262.80 | -18,051,024.89 |
| 其中：基金申购款       | 52,924.88      | 18,219.64     | 71,144.52      |
| 基金赎回款          | -14,157,686.97 | -3,964,482.44 | -18,122,169.41 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 8,697,738.12   | 6,815,139.58  | 15,512,877.70  |

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |
|-----------|-------------------------------|------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 14,309.35                     | 75,663.40                          |
| 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 | 34,261.44                     | 65,649.26                          |
| 其他        | 925.64                        | 537.89                             |
| 合计        | 49,496.43                     | 141,850.55                         |

7.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |
|------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 182,145,545.06                | 129,684,190.47                     |
| 减：卖出股票成本总额 | 213,741,583.62                | 135,729,509.73                     |
| 减：交易费用     | 277,431.16                    | 290,801.42                         |
| 买卖股票差价收入   | -31,873,469.72                | -6,336,120.68                      |

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元



| 项目                                   | 本期<br>2024年01月01日至2024年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年<br>12月31日 |
|--------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                         | 4,107,837.84                      | 18,823,883.46                          |
| 债券投资收益——买卖债券<br>（债转股及债券到期兑付）<br>差价收入 | 440,461.40                        | 1,227,593.08                           |
| 债券投资收益——赎回差价<br>收入                   | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益——申购差价<br>收入                   | -                                 | -                                      |
| 合计                                   | 4,548,299.24                      | 20,051,476.54                          |

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                             | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12月<br>31日 |
|--------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 卖出债券（债转股<br>及债券到期兑付）<br>成交总额   | 369,536,364.06                    | 1,847,736,673.14                       |
| 减：卖出债券（债<br>转股及债券到期兑<br>付）成本总额 | 361,538,736.62                    | 1,810,690,768.29                       |
| 减：应计利息总额                       | 7,550,341.04                      | 35,794,084.27                          |
| 减：交易费用                         | 6,825.00                          | 24,227.50                              |
| 买卖债券差价收入                       | 440,461.40                        | 1,227,593.08                           |

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12月<br>31日 |
|----------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 股指期货投资收益 | -                                 | 49,103.81                              |

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2024年01月01日至2024<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023<br>年12月31日 |
|---------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 24,250.08                         | 3,460,589.77                           |
| 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            | 24,250.08                         | 3,460,589.77                           |

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                     | 本期<br>2024年01月01日至2024年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12<br>月31日 |
|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 1.交易性金融资产                | 33,150,839.39                     | 276,284.66                             |
| ——股票投资                   | 32,639,005.10                     | -222,348.07                            |
| ——债券投资                   | 511,834.29                        | 498,632.73                             |
| ——资产支持证券投资               | -                                 | -                                      |
| ——基金投资                   | -                                 | -                                      |
| ——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<br>价值变动产生的预估增 | -                                 | -                                      |

|    |               |            |
|----|---------------|------------|
| 值税 |               |            |
| 合计 | 33,150,839.39 | 276,284.66 |

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |
|---------|-------------------------------|------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 19,644.77                     | 27,302.31                          |
| 合计      | 19,644.77                     | 27,302.31                          |

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。

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |
|---------|-------------------------------|------------------------------------|
| 审计费用    | 50,000.00                     | 75,000.00                          |
| 信息披露费   | 120,000.00                    | 120,000.00                         |
| 证券出借违约金 | -                             | -                                  |
| 账户维护费   | 37,500.00                     | 35,400.00                          |
| 其他      | 20,000.00                     | 21,200.00                          |
| 合计      | 227,500.00                    | 251,600.00                         |

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

截至本财务报表批准报出日，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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 浙商银行股份有限公司("浙商银行")     | 基金托管人、基金销售机构        |
| 广东中科科创创业投资管理有限责任公司     | 基金管理人的股东            |
| 广东省粤科金融集团有限公司          | 基金管理人的股东            |
| 广东普瑞投资发展合伙企业(有限合伙)     | 基金管理人的股东            |
| 广东中广投资管理有限公司           | 基金管理人的股东            |
| 珠海横琴沃海投资合伙企业(有限合伙)     | 基金管理人的股东            |
| 珠海横琴沃土投资有限公司           | 基金管理人的股东            |
| 珠海横琴沃智投资合伙企业(有限合伙)     | 基金管理人的股东            |
| 珠海横琴沃富投资合伙企业(有限合伙)     | 基金管理人的股东            |
| 广州西拓投资合伙企业(有限合伙)       | 基金管理人的股东            |
| 珠海横琴沃信投资合伙企业(有限合伙)     | 基金管理人的股东            |
| 珠海横琴沃泽投资合伙企业(有限合伙)     | 基金管理人的股东            |

注：1.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2.本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

##### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

##### 7.4.10.1.5 基金交易

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基金交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期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<br>2024年01月01日至20<br>24年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至20<br>23年12月31日 |
|------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 1,838,033.37                      | 5,152,810.84                           |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 6,246.54                          | 17,304.19                              |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 1,831,786.83                      | 5,135,506.65                           |

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024年01月01日至2024<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023<br>年12月31日 |
|----------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 344,631.25                        | 966,152.07                             |

注:支付基金托管人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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

|                      |                               |
|----------------------|-------------------------------|
| 获得销售<br>服务费的<br>各关联方 | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 |
|                      | 当期发生的基金应支付的销售服务费              |

| 名称             | 中科沃土沃嘉混合A               | 中科沃土沃嘉混合C  | 合计         |
|----------------|-------------------------|------------|------------|
| 中科沃土基金         | 0.00                    | 208,167.21 | 208,167.21 |
| 浙商银行           | 0.00                    | 0.00       | 0.00       |
| 合计             | 0.00                    | 208,167.21 | 208,167.21 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                 |            |            |
|                | 2023年01月01日至2023年12月31日 |            |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费        |            |            |
|                | 中科沃土沃嘉混合A               | 中科沃土沃嘉混合C  | 合计         |
| 中科沃土基金         | 0.00                    | 477,964.87 | 477,964.87 |
| 浙商银行           | 0.00                    | 0.00       | 0.00       |
| 合计             | 0.00                    | 477,964.87 | 477,964.87 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中科沃土基金，再由中科沃土基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日C类基金份额的基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内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适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内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适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

#### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 |           | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023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    |
| 浙商银行  | 1,075,333.48                  | 14,309.35 | 29,383,576.83                      | 75,663.40 |

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。

#### 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--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2024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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告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市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资部门负责人和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 20,256,871.23      | 61,566,231.70       |
| 合计     | 20,256,871.23      | 61,566,231.70       |



注: 1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。  
2、以上未评级的债券为政策性金融债和短期融资券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | -                  | 41,099,486.34       |
| AAA以下  | -                  | 20,583,685.25       |
| 未评级    | 115,543,440.21     | 134,611,518.84      |
| 合计     | 115,543,440.21     | 196,294,690.43      |

注: 1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。  
2、以上未评级的债券为国债、政策性金融债和中期票据。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，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同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。

#### 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见报告“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。于本年度末，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。

#### 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024年1<br>2月31日 | 1年以内          | 1-5年          | 5年以上          | 不计息       | 合计             |
|------------------------|---------------|---------------|---------------|-----------|----------------|
| 资产                     |               |               |               |           |                |
| 货币资金                   | 1,075,333.48  | -             | -             | -         | 1,075,333.48   |
| 结算备付金                  | 2,282.25      | -             | -             | -         | 2,282.25       |
| 存出保证金                  | 94.42         | -             | -             | -         | 94.42          |
| 交易性金融资产                | 20,256,871.23 | 83,904,835.24 | 31,638,604.97 | 25,701.11 | 135,826,012.55 |
| 买入返售金融资产               | 38,005,076.72 | -             | -             | -         | 38,005,076.72  |
| 应收申购款                  | -             | -             | -             | 89.94     | 89.94          |
| 资产总计                   | 59,339,658.10 | 83,904,835.24 | 31,638,604.97 | 25,791.05 | 174,908,889.36 |

|                     |                |               |               |                |                |
|---------------------|----------------|---------------|---------------|----------------|----------------|
| 负债                  |                |               |               |                |                |
| 应付赎回款               | -              | -             | -             | 2,999.49       | 2,999.49       |
| 应付管理人报酬             | -              | -             | -             | 118,059.25     | 118,059.25     |
| 应付托管费               | -              | -             | -             | 22,136.12      | 22,136.12      |
| 应付销售服务费             | -              | -             | -             | 13,119.17      | 13,119.17      |
| 其他负债                | -              | -             | -             | 184,150.16     | 184,150.16     |
| 负债总计                | -              | -             | -             | 340,464.19     | 340,464.19     |
| 利率敏感度缺口             | 59,339,658.10  | 83,904,835.24 | 31,638,604.97 | -314,673.14    | 174,568,425.17 |
| 上年度末<br>2023年12月31日 | 1年以内           | 1-5年          | 5年以上          | 不计息            | 合计             |
| 资产                  |                |               |               |                |                |
| 货币资金                | 29,383,576.83  | -             | -             | -              | 29,383,576.83  |
| 结算备付金               | 1,476,968.05   | -             | -             | -              | 1,476,968.05   |
| 存出保证金               | 24,425.25      | -             | -             | -              | 24,425.25      |
| 交易性金融资产             | 175,014,955.96 | 82,845,966.17 | -             | 132,182,589.61 | 390,043,511.74 |
| 买入返售金融资产            | 10,093,355.60  | -             | -             | -              | 10,093,355.60  |
| 应收清算款               | -              | -             | -             | 151,089.71     | 151,089.71     |

|         |                |               |   |                |                |
|---------|----------------|---------------|---|----------------|----------------|
| 应收申购款   | -              | -             | - | 63.62          | 63.62          |
| 资产总计    | 215,993,281.69 | 82,845,966.17 | - | 132,333,742.94 | 431,172,990.80 |
| 负债      |                |               |   |                |                |
| 应付赎回款   | -              | -             | - | 67,295.09      | 67,295.09      |
| 应付管理人报酬 | -              | -             | - | 289,980.99     | 289,980.99     |
| 应付托管费   | -              | -             | - | 54,371.43      | 54,371.43      |
| 应付销售服务费 | -              | -             | - | 28,863.32      | 28,863.32      |
| 应交税费    | -              | -             | - | 26,068.86      | 26,068.86      |
| 其他负债    | -              | -             | - | 248,466.52     | 248,466.52     |
| 负债总计    | -              | -             | - | 715,046.21     | 715,046.21     |
| 利率敏感度缺口 | 215,993,281.69 | 82,845,966.17 | - | 131,618,696.73 | 430,457,944.59 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                     |
|----|--------------------|---------------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额<br>(单位：人民币元) |                     |
|    |                    | 本期末<br>2024年12月31日              | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|    | 1.利率上升25个基点        | -1,189,068.85                   | -502,271.06         |
|    | 2.利率下降25个基点        | 1,211,277.02                    | 505,291.79          |

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用"自上而下"的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的0%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2024年12月31日 |                          | 上年度末<br>2023年12月31日 |                          |
|--------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|              | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 25,701.11          | 0.01                     | 132,182,589.61      | 30.71                    |
| 交易性金融资产—基金投资 | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 交易性金融资       | -                  | -                        | -                   | -                        |

|                    |           |      |                |       |
|--------------------|-----------|------|----------------|-------|
| 产一债券投资             |           |      |                |       |
| 交易性金融资产<br>— 贵金属投资 | -         | -    | -              | -     |
| 衍生金融资产<br>— 权证投资   | -         | -    | -              | -     |
| 其他                 | -         | -    | -              | -     |
| 合计                 | 25,701.11 | 0.01 | 132,182,589.61 | 30.71 |

7.4.13.4.3.2 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<br>2024年12月31日          | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|    | 沪深300指数上升5%           | 2,284.15                    | 3,413,984.35        |
|    | 沪深300指数下降5%           | -2,284.15                   | -3,413,984.35       |

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | 25,701.11          | 130,346,887.90      |
| 第二层次          | 135,800,311.44     | 257,860,922.13      |

|      |                |                |
|------|----------------|----------------|
| 第三层次 | -              | 1,835,701.71   |
| 合计   | 135,826,012.55 | 390,043,511.74 |

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

| 项目                                   | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 |              |              |
|--------------------------------------|-------------------------------|--------------|--------------|
|                                      | 交易性金融资产                       |              | 合计           |
|                                      | 债券投资                          | 股票投资         |              |
| 期初余额                                 | -                             | 1,835,701.71 | 1,835,701.71 |
| 当期购买                                 | -                             | -            | -            |
| 当期出售/结算                              | -                             | -            | -            |
| 转入第三层次                               | -                             | 93,611.28    | 93,611.28    |
| 转出第三层次                               | -                             | 1,644,902.08 | 1,644,902.08 |
| 当期利得或损失总额                            | -                             | -284,410.91  | -284,410.91  |
| 其中：计入损益的利得或损失                        | -                             | -284,410.91  | -284,410.91  |
| 计入其他综合收益的利得或损失                       | -                             | -            | -            |
| 期末余额                                 | -                             | -            | -            |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允 | -                             | -            | -            |



|                                            |                         |              |              |
|--------------------------------------------|-------------------------|--------------|--------------|
| 价值变动损益                                     |                         |              |              |
| 项目                                         | 上年度可比期间                 |              |              |
|                                            | 2023年01月01日至2023年12月31日 |              |              |
|                                            | 交易性金融资产                 |              | 合计           |
|                                            | 债券投资                    | 股票投资         |              |
| 期初余额                                       | -                       | 1,767,039.32 | 1,767,039.32 |
| 当期购买                                       | -                       | -            | -            |
| 当期出售/结算                                    | -                       | -            | -            |
| 转入第三层次                                     | -                       | 2,964,763.45 | 2,964,763.45 |
| 转出第三层次                                     | -                       | 3,165,220.96 | 3,165,220.96 |
| 当期利得或损失总额                                  | -                       | 269,119.90   | 269,119.90   |
| 其中：计入损益的利得或损失                              | -                       | 269,119.90   | 269,119.90   |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | -                       | -            | -            |
| 期末余额                                       | -                       | 1,835,701.71 | 1,835,701.71 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | -                       | -53,237.45   | -53,237.45   |

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

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

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末公允价值 | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 |          |            |
|----|---------|---------|---------|----------|------------|
|    |         |         | 名称      | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| -  | -       | -       | -       | -        | -          |
| 项目 | 上年度末    | 采用的估值   | 不可观察输入值 |          |            |

|                     | 公允价值         | 技术         | 名称    | 范围/加权平均值      | 与公允价值之间的关系 |
|---------------------|--------------|------------|-------|---------------|------------|
| 证券交易所上市但尚在限售期内的股票投资 | 1,835,701.71 | 平均价格亚式期权模型 | 预期波动率 | 0.1462-2.1775 | 负相关        |

7.4.14.3 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)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 25,701.11      | 0.01         |
|    | 其中：股票             | 25,701.11      | 0.01         |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 135,800,311.44 | 77.64        |
|    | 其中：债券             | 135,800,311.44 | 77.64        |
|    | 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          | 38,005,076.72  | 21.73        |
|    | 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      | 1,077,615.73   | 0.62         |

|   |        |                |        |
|---|--------|----------------|--------|
| 8 | 其他各项资产 | 184.36         | 0.00   |
| 9 | 合计     | 174,908,889.36 | 100.00 |

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）   | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|-----------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -         | -            |
| B  | 采矿业              | -         | -            |
| C  | 制造业              | 6,682.11  | 0.00         |
| 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  | 19,019.00 | 0.01         |
| J  | 金融业              | -         | -            |
| 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               | 25,701.11 | 0.01         |

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元)   | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-------|-----------|--------------|
| 1  | 688691 | 灿芯股份 | 247   | 19,019.00 | 0.01         |
| 2  | 301539 | 宏鑫科技 | 361   | 6,682.11  | 0.00         |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 300750 | 宁德时代 | 2,151,820.00 | 0.50           |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 1,324,012.00 | 0.31           |
| 3  | 601668 | 中国建筑 | 1,007,423.00 | 0.23           |
| 4  | 603259 | 药明康德 | 910,563.00   | 0.21           |
| 5  | 600919 | 江苏银行 | 852,000.00   | 0.20           |
| 6  | 600941 | 中国移动 | 834,054.00   | 0.19           |
| 7  | 000338 | 潍柴动力 | 744,722.00   | 0.17           |
| 8  | 002142 | 宁波银行 | 744,505.00   | 0.17           |
| 9  | 601288 | 农业银行 | 713,325.00   | 0.17           |
| 10 | 000166 | 申万宏源 | 711,863.00   | 0.17           |
| 11 | 002594 | 比亚迪  | 639,200.00   | 0.15           |
| 12 | 000002 | 万科A  | 616,660.00   | 0.14           |
| 13 | 002028 | 思源电气 | 544,440.00   | 0.13           |
| 14 | 002371 | 北方华创 | 539,859.00   | 0.13           |
| 15 | 600048 | 保利发展 | 529,316.00   | 0.12           |
| 16 | 600585 | 海螺水泥 | 497,376.00   | 0.12           |
| 17 | 002466 | 天齐锂业 | 478,654.00   | 0.11           |
| 18 | 601225 | 陕西煤业 | 462,216.00   | 0.11           |
| 19 | 601728 | 中国电信 | 443,015.00   | 0.10           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 20 | 600900 | 长江电力 | 437,595.00 | 0.10 |
|----|--------|------|------------|------|

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|--------------|----------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台  | 9,172,553.00 | 2.13           |
| 2  | 300750 | 宁德时代  | 4,425,850.00 | 1.03           |
| 3  | 601318 | 中国平安  | 3,470,476.06 | 0.81           |
| 4  | 600036 | 招商银行  | 3,191,964.00 | 0.74           |
| 5  | 000333 | 美的集团  | 2,695,888.30 | 0.63           |
| 6  | 601899 | 紫金矿业  | 2,579,876.00 | 0.60           |
| 7  | 002142 | 宁波银行  | 2,528,337.30 | 0.59           |
| 8  | 002475 | 立讯精密  | 2,425,687.00 | 0.56           |
| 9  | 000858 | 五 粮 液 | 2,356,552.00 | 0.55           |
| 10 | 600900 | 长江电力  | 2,262,455.00 | 0.53           |
| 11 | 300760 | 迈瑞医疗  | 2,246,399.00 | 0.52           |
| 12 | 601166 | 兴业银行  | 1,937,747.00 | 0.45           |
| 13 | 601398 | 工商银行  | 1,765,570.00 | 0.41           |
| 14 | 002230 | 科大讯飞  | 1,743,448.00 | 0.41           |
| 15 | 300498 | 温氏股份  | 1,660,220.00 | 0.39           |
| 16 | 000725 | 京东方 A | 1,591,797.00 | 0.37           |
| 17 | 000338 | 潍柴动力  | 1,493,738.00 | 0.35           |
| 18 | 000651 | 格力电器  | 1,336,214.00 | 0.31           |
| 19 | 000001 | 平安银行  | 1,333,471.00 | 0.31           |
| 20 | 600030 | 中信证券  | 1,330,309.50 | 0.31           |

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 | 48,945,690.02  |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 182,145,545.06 |

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      | 31,638,604.97  | 18.12        |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 104,161,706.47 | 59.67        |
|    | 其中：政策性金融债 | 104,161,706.47 | 59.67        |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债(可交换债) | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 135,800,311.44 | 77.79        |

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  | 240203 | 24国开03   | 400,000 | 42,129,289.62 | 24.13        |
| 2  | 240011 | 24付息国债11 | 300,000 | 31,638,604.97 | 18.12        |
| 3  | 210203 | 21国开03   | 200,000 | 21,003,698.63 | 12.03        |
| 4  | 230202 | 23国开02   | 200,000 | 20,771,846.99 | 11.90        |
| 5  | 240411 | 24农发11   | 200,000 | 20,256,871.23 | 11.60        |

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额     |
|----|-------|--------|
| 1  | 存出保证金 | 94.42  |
| 2  | 应收清算款 | -      |
| 3  | 应收股利  | -      |
| 4  | 应收利息  | -      |
| 5  | 应收申购款 | 89.94  |
| 6  | 其他应收款 | -      |
| 7  | 待摊费用  | -      |
| 8  | 其他    | -      |
| 9  | 合计    | 184.36 |

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未存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别      | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额  | 持有人结构        |        |                |        |
|-----------|----------|------------|--------------|--------|----------------|--------|
|           |          |            | 机构投资者        |        | 个人投资者          |        |
|           |          |            | 持有份额         | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例 |
| 中科沃土沃嘉混合A | 257      | 293,406.77 | 1,481,213.92 | 1.96%  | 73,924,326.36  | 98.04% |
| 中科沃土沃嘉混合C | 378      | 164,177.95 | 654,056.99   | 1.05%  | 61,405,209.34  | 98.95% |
| 合计        | 635      | 216,480.01 | 2,135,270.91 | 1.55%  | 135,329,535.70 | 98.45% |

### 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 | 中科沃土沃嘉混合A | 29.25     | 0.00%    |
|                  | 中科沃土沃嘉混合C | 0.00      | 0.00%    |
|                  | 合计        | 29.25     | 0.00%    |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本报告期末本公司高级管理人员、基金投资和研究未持有本开放式基金。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份



|                            | 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06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               | 207,070,396.00 | 140,079,209.61 |
| 本报告期基金总申购份额                | 152,252.84     | 304,054.55     |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 131,817,108.56 | 78,323,997.83  |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 75,405,540.28  | 62,059,266.33  |

## §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

本报告期内基金管理人重大人事变动情况如下：2024年6月28日，公司聘任于建伟为公司总经理，同时解聘智会杰的公司总经理职务，聘任、解聘及备案日期均为2024年6月28日。2024年7月26日，公司聘任袁柳生为公司副总经理，聘任及备案日期均为2024年7月26日。

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

本报告期内本基金投资策略无重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内将为本基金提供审计服务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）更换为容诚会计师事务所（特殊普通合伙）。目前容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务的连续年限为1年，本报告年度的审计费用为50,000.00元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，公司财务指标存在不符合《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》相关规定的情形，中国证券监督管理委员会广东监管局要求公司限期内改善财务情况。公司在期限内已采取相关措施解决财务指标，满足监管要求。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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 |    |
| 华创证券 | 1      | 120,009,811.62 | 52.14%       | 89,515.91 | 52.17%     | -  |
| 长江证券 | 2      | 109,236,671.69 | 47.46%       | 81,404.66 | 47.44%     | -  |
| 华西证券 | 2      | 910,540.76     | 0.40%        | 679.17    | 0.40%      | -  |

#### 1、交易席位选择标准：

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

#### 2、交易席位选择流程：

- (1)对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

(2)协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 债券回购交易        |                | 权证交易 |              | 基金交易 |              |
|------|------|--------------|---------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额          | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 华创证券 | -    | -            | 36,146,000.00 | 79.13%         | -    | -            | -    | -            |
| 长江证券 | -    | -            | 9,531,000.00  | 20.87%         | -    | -            | -    | -            |
| 华西证券 | -    | -            | -             | -              | -    | -            | -    | -            |

11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                              | 法定披露方式       | 法定披露日期     |
|----|-----------------------------------|--------------|------------|
| 1  | 中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告       | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-01-03 |
| 2  | 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 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-01-05 |
| 3  | 中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告       | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-01-05 |
| 4  | 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        | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-01-05 |
| 5  | 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 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-01-05 |
| 6  | 中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金2023年第四季度报告    | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-01-19 |
| 7  | 中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金2023年年度        | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-03-29 |

|    |                                            |              |            |
|----|--------------------------------------------|--------------|------------|
|    | 报告                                         |              |            |
| 8  | 中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金2024年第一季度报告             | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-04-22 |
| 9  | 中科沃土基金管理有限公司关于关闭网上交易平台、微信交易平台（仅限富友支付渠道）的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-05-13 |
| 10 | 中科沃土基金管理有限公司关于新增蚂蚁基金为旗下部分基金销售机构的公告         | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-05-20 |
| 11 | 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                 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-06-05 |
| 12 | 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          | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-06-05 |
| 13 | 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          | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-06-05 |
| 14 | 中科沃土基金管理有限公司关于新增基煜基金为旗下部分基金销售机构的公告         | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-06-24 |
| 15 | 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                 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-06-29 |
| 16 | 中科沃土基金管理有限公司关于变更法定代表人的公告                   | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-07-11 |
| 17 | 中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金2024年第二季度报告             | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-07-18 |
| 18 | 中科沃土基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售                   | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-07-18 |

|    |                                    |              |            |
|----|------------------------------------|--------------|------------|
|    | 有限公司办理相关销售业务的公告                    |              |            |
| 19 | 中科沃土基金管理有限公司关于变更北京分公司地址的公告         | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-07-27 |
| 20 | 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         | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-07-27 |
| 21 | 中科沃土基金管理有限公司关于董事变更的公告              | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-08-15 |
| 22 | 中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金2024年中期报告       | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-08-28 |
| 23 | 中科沃土基金管理有限公司北京分公司负责人变更公告           | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-08-30 |
| 24 | 中科沃土基金管理有限公司关于新增汇付基金为旗下部分基金销售机构的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-09-10 |
| 25 | 中科沃土基金管理有限公司上海分公司负责人变更公告           | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-09-12 |
| 26 | 中科沃土基金管理有限公司关于新增国信嘉利基金为旗下基金销售机构的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-09-13 |
| 27 | 中科沃土基金管理有限公司关于董事变更的公告              | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-09-25 |
| 28 | 中科沃土基金管理有限公司关于新增云湾基金为旗下部分基金销售机构的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-10-15 |
| 29 | 中科沃土基金管理有限公司关于新增民商基金为旗下基金销售机构的公告   | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-10-16 |
| 30 | 中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金2024年第三         | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-10-24 |

|    |                                       |              |            |
|----|---------------------------------------|--------------|------------|
|    | 季度报告                                  |              |            |
| 31 | 中科沃土基金管理有限公司关于新增贵文基金为旗下基金销售机构的公告      | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-10-31 |
| 32 | 中科沃土基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理相关销售业务的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-11-22 |
| 33 | 中科沃土基金管理有限公司基金改聘会计师事务所公告              | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-12-06 |

§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              | 20240101 - 2024 0122   | 90,524,251.60 | 0.00 | 90,524,251.60 | 0.00          | 0.00%  |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 2              | 20240101 - 2024 1231   | 79,129,960.98 | 0.00 | 48,024,100.00 | 31,105,860.98 | 22.63% |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 3              | 20240101 - 2024 1231   | 76,098,097.74 | 0.00 | 2,392,980.33  | 73,705,117.41 | 53.62% |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 4              | 20240101 - 2024 1231   | 78,127,164.09 | 0.00 | 47,609,500.68 | 30,517,663.41 | 22.20% |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                |                        |               |      |               |               |        |
| 报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。 |                |                        |               |      |               |               |        |

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予中科沃土沃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。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中科沃土基金管理有限公司  
二〇二五年三月三十一日