

中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金

2022年第2季度报告

2022年06月30日

基金管理人:中科沃土基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2022年07月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年7月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年4月1日起至2022年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中科沃土转型升级混合
基金主代码	005281
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年01月25日
报告期末基金份额总额	8,690,826.74份
投资目标	在严格控制风险的前提下，把握中国经济转型升级过程中所蕴含的投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。
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。
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期收益和预期风险低于股票型基金，高于货币市场基金和债券型基金。
基金管理人	中科沃土基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022年04月01日 - 2022年06月30日）
1. 本期已实现收益	-240,390.44
2. 本期利润	55,758.79
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0060
4. 期末基金资产净值	9,006,972.73
5. 期末基金份额净值	1.0364

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、本报告所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.09%	0.54%	3.47%	0.72%	-2.38%	-0.18%
过去六个月	-6.77%	0.59%	-4.02%	0.73%	-2.75%	-0.14%
过去一年	-21.10%	1.52%	-5.77%	0.63%	-15.33%	0.89%
过去三年	28.00%	1.71%	12.64%	0.63%	15.36%	1.08%
自基金合同生效起至今	3.64%	1.61%	10.04%	0.66%	-6.40%	0.95%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孟禄程	研究部总经理助理（主持工作）、基金经理	2019-11-08	—	7 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，现任中科沃土基金管理有限公司研究部总经理助理（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基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022年二季度市场主要指数回调之后进行出现反弹实现上涨，上证指数上涨4.50%，深圳成指上涨6.42%，创业板指上涨5.68%，沪深300上涨6.21%。行业层面，二季度汽车、食品饮料、电力设备、美容护理、商贸零售涨幅居前，房地产、计算机、环保、传媒、银行、农业、医药等依然下跌。

本基金通过调整持仓结构和降低仓位较大幅度回避了一季度下跌，4月份大盘再次下跌低仓位再次实现正面贡献，但也导致在后续反弹过程中相对跑的慢一些，充分体现盈亏同源也警醒我们保持对市场的敬畏之心。行业配置上，二季度重点配置了稳健性行业医药（血制品、医疗器械）、仓储，同时也增加了回调至估值可接受的进攻性品种储能、CRO、OTC个股。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中科沃土转型升级混合基金份额净值为1.0364元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.09%，同期业绩比较基准收益率为3.47%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,465,714.00	36.07
	其中：股票	3,465,714.00	36.07
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	400,000.00	4.16
	其中：买断式回购的买入 返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合 计	5,725,193.25	59.59
8	其他资产	16,404.04	0.17
9	合计	9,607,311.29	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	12,215.00	0.14
C	制造业	2,482,175.00	27.56
D	电力、热力、燃气及水生 生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—

F	批发和零售业	139,040.00	1.54
G	交通运输、仓储和邮政业	296,550.00	3.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,720.00	0.24
J	金融业	-	-
K	房地产业	153,964.00	1.71
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	360,050.00	4.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,465,714.00	38.48

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300294	博雅生物	13,200	474,540.00	5.27
2	000403	派林生物	18,200	399,672.00	4.44
3	300633	开立医疗	13,000	390,390.00	4.33
4	002930	宏川智慧	15,000	296,550.00	3.29
5	688248	南网科技	10,000	231,200.00	2.57
6	300122	智飞生物	1,600	177,616.00	1.97
7	300685	艾德生物	4,860	155,520.00	1.73
8	600185	格力地产	24,400	153,964.00	1.71
9	301263	泰恩康	4,000	139,040.00	1.54

10	688315	诺禾致源	5,000	128,850.00	1.43
----	--------	------	-------	------------	------

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10,787.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,616.20
6	其他应收款	-

7	其他	—
8	合计	16,404.04

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	10,031,116.45
报告期期间基金总申购份额	456,767.41
减：报告期期间基金总赎回份额	1,797,057.12
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
报告期期末基金份额总额	8,690,826.74

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期初基金管理人未持有本基金份额，且报告期内基金管理人持有基金份额未发生变动。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
2. 《中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《中科沃土转型升级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. 基金托管人业务资格批件、营业执照；
6. 关于申请募集注册中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书；
7. 中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 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

2022年07月21日