# 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
# 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：中科沃土基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 30 日

# §1 重要提示

## 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 26 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。天健会计师事务所（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 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 中科沃土沃鑫成长混合发起 |
| 基金主代码 | 003125 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 10 月 25 日 |
| 基金管理人 | 中科沃土基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 44,375,628.61 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金秉承成长投资的理念，在严格控制风险并保持基金投资组合良好的流动性的前提下，通过积极挖掘成长性行业和企业所蕴含的投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |

| | |
|---|---|
| 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。基于成长投资的理念，投资于优选行业中的绩优股票；对于债券投资，采用期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、可转换债券投资策略等；适当参与股指期货、权证、国债期货等金融衍生品的投资，进行分散投资，力求实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×50%+中债综合全价（总值）指数收益率×50%。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金，预期收益和预期风险低于股票型基金，高于货币市场基金和债券型基金。 |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 中科沃土基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 杨敏 | 郭明 |
| | 联系电话 | 020-23388979 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | yangmin@richlandasm.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-018-3610 | 95588 |
| 传真 | | 020-23388997 | 010-66105798 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.richlandasm.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 21 楼 |

# §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 | 2017 年 | 2016 年 10 月 25 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 6,604,574.09 | 239,394.67 |
| 本期利润 | 6,484,230.68 | 125,583.18 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0581 | 0.0006 |
| 本期加权平均净值利润率 | 5.69% | 0.06% |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.81% | 0.06% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017 年末 | 2016 年末 |
| 期末可供分配利润 | 1,275,619.30 | 125,583.18 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0287 | 0.0006 |
| 期末基金资产净值 | 45,651,247.91 | 213,858,615.65 |
| 期末基金份额净值 | 1.0287 | 1.0006 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2017 年末 | 2016 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 2.87% | 0.06% |

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。

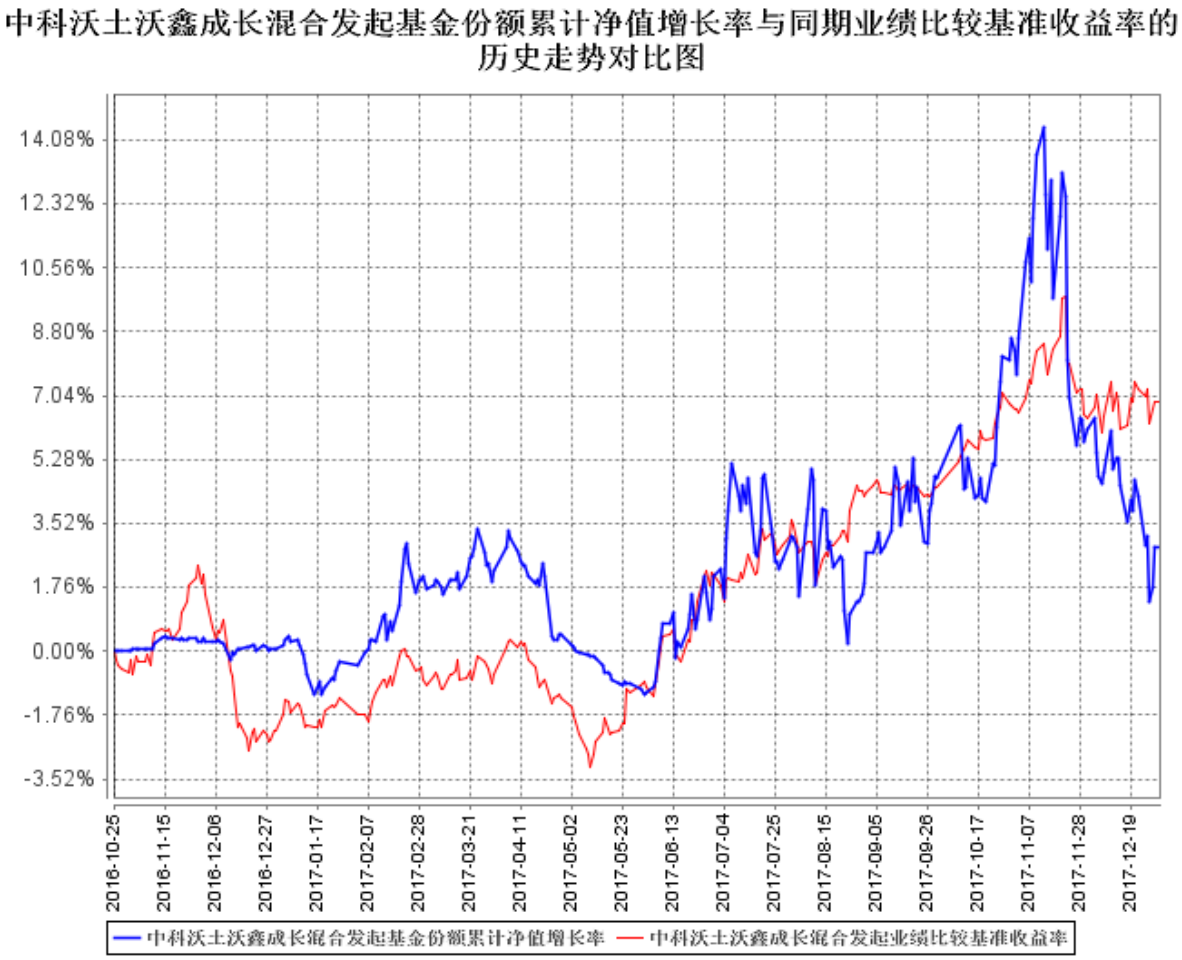
## 3.2 基金净值表现

### 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

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -1.82% | 1.12% | 1.96% | 0.40% | -3.78% | 0.72% |
| 过去六个月 | 0.77% | 1.02% | 4.31% | 0.35% | -3.54% | 0.67% |
| 过去一年 | 2.81% | 0.78% | 9.20% | 0.32% | -6.39% | 0.46% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.87% | 0.71% | 6.88% | 0.33% | -4.01% | 0.38% |

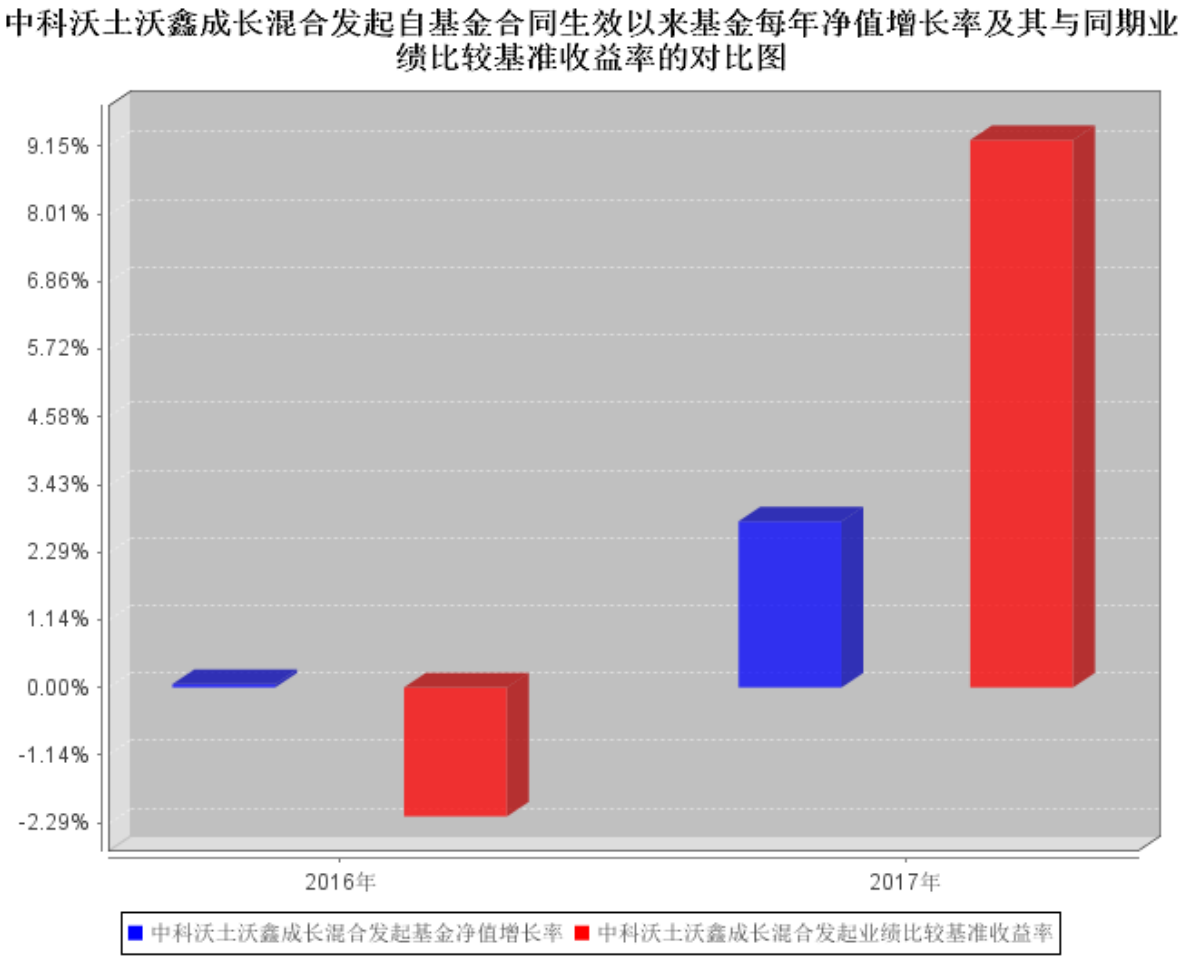
注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

### 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




注：1、本基金合同于 2016 年 10 月 25 日生效，按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较




注：基金合同生效当年（2016 年）按实际存续期计算，未按自然年度进行折算。

## 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2016 年 10 月 25 日）至本期报告期末未进行利润分配。

# §4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中科沃土基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2015]1937 号文批准，于 2015 年 9 月 6 日正式成立，注册资本 1 亿元，是国内第 101 家公募基金管理公司，也是一家拥有 PE 背景的公募基金管理公司。中科沃土带着中科招商、粤科金融等主要股东强大的精神基因和优秀的文化基因，始终贯彻“持有人利益至上”的首要经营准则，遵循诚信、规范、稳健的经营方针，崇尚价值投资理念和长期、平稳、盈利的投资风格，致力于为持有人提供专业、精品、创新的投资理财服务，创造成长价值，汇聚阳光财富。截至 2017 年 12 月 31 日，中科沃土旗下共管理 4 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、中科沃土沃祥债券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。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 李昱 | 副总经理兼任权益投资部总经理、基金经理 | 2016 年 10 月 25 日 | - | 21 年 | 管理学硕士。曾任广发证券股份有限公司环市东营业部业务经理、投资理财部投资经理、资产管理部投资经理，新华基金管理有限公司专户管理部副总监、专户管理部负责人、基金管理部基金经理、基金管理部副总监，现任中科沃土基金管理有限公司副总经理兼任权益投资部总经理、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金和中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。 |

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中科沃土基金管理有限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和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

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

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、 3 日内、 5 日内），对我司旗下所有投资组合 2017 年度的同向交易价差情况进行了分析，根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，市场总体走势震荡向上。一季度因为对周期类个股的市场机会进行了一定的把握，周期类个股给基金净值带来较大的正贡献。二季度因为监管趋紧及流动性的原因，市场处于震荡格局，因为很好地控制了风险，净值回撤不大。三季度在政策的引导下，市场走出震荡向上的小幅上涨行情，因为较好地抓住了新能源车行业的变化，本基金在三季度有所收益。四季度因为较好地抓住了大消费、保险以及政策大力扶持的半导体行业投资机会，本基金在前期有较好收益，后期由于市场对流动性的担心，以及以绝对收益为导向资金的获利兑现，导致整体市场有一定回调。受市场回调影响，净值有一定的回撤。但判断上述导致市场回调因素为短期性扰动。看好新一年的“春季躁动”行情。因此，在 2017 年底市场下跌过程中，持续提升股票仓位，为 2018 年业绩奠定坚实的基础。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0287 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.81%，业绩比较基准收益率为 9.20%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年全球经济延续复苏格局。美国税改落地将增加企业盈利，拉动消费和通胀，带动经济增长。欧元区及英国经济自身仍复苏良好。日本经济温和复苏。新兴国家中，资源、材料出口型

国家将在这轮世界贸易的复苏中获得更多的好处。

2017 年国内经济总体平稳增长。GDP 不变价同比增速 6.9%，实体经济的韧性好于预期。经济结构亮点在新经济和新旧动能的转换。轻资本的新经济正在加速替代重资本的旧经济。新经济的投入加速产生回报，旧经济的利润结构性改善，这种混搭的效果造就了微观经济的较强韧性。

展望 2018 年中国宏观经济可能受去产能、降杠杆和去泡沫供给侧改革进程加快的影响，基建投资和房产投资增速可能略微下降，消费大体走势平稳，净出口收益于海外经济复苏，综合考虑预计 2018 年宏观经济平稳增长。在此背景下，预计市场震荡上行，重点把握结构性机会。中长期看好大金融、消费和高端制造。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

# §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，本基金托管人在对中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务.

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

本报告期内，中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的管理人——中科沃土基金管理有限公司在中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何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。本报告期内，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未进行利润分配。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中科沃土基金管理有限公司编制和披露的中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2017 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# §6 审计报告

天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计了 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

# §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日： 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 2,875,312.63 | 111,244,206.20 |
| 结算备付金 | | 264,455.94 | 4,024,978.68 |
| 存出保证金 | | 250,447.05 | 7,304.05 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 36,473,256.80 | 28,896,731.28 |
| 其中：股票投资 | | 36,473,256.80 | 28,896,731.28 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | 5,000,000.00 | 69,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 1,899,216.06 | 897,797.71 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 9,483.59 | 614,059.69 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,590.96 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 46,773,763.03 | 214,685,077.61 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **本期末<br>2017 年 12 月 31 日** | **上年度末<br>2016 年 12 月 31 日** |
| **负 债：** | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 376,958.46 |
| 应付赎回款 | | 22,587.38 | - |
| 应付管理人报酬 | | 59,753.10 | 271,905.83 |
| 应付托管费 | | 9,958.86 | 45,317.62 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 690,173.33 | 52,880.05 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 340,042.45 | 79,400.00 |
| 负债合计 | | 1,122,515.12 | 826,461.96 |
| **所有者权益：** | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 44,375,628.61 | 213,733,032.47 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 1,275,619.30 | 125,583.18 |
| 所有者权益合计 | | 45,651,247.91 | 213,858,615.65 |
| 负债和所有者权益总计 | | 46,773,763.03 | 214,685,077.61 |

报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0287 元，基金份额总额 44,375,628.61 份。

## 7.2 利润表

会计主体：中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期： 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 10 月 25 日(基金合同生效日)至<br>2016 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **一、收入** | | 11,606,719.75 | 972,996.98 |
| 1.利息收入 | | 1,523,270.85 | 1,123,865.54 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 385,802.85 | 799,159.26 |
| 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 | | 1,137,468.00 | 324,706.28 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 9,876,655.41 | -37,057.07 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 9,495,699.65 | -37,057.07 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | 380,955.76 | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | -120,343.41 | -113,811.49 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18 | 327,136.90 | - |
| **减：二、费用** | | 5,122,489.07 | 847,413.80 |
| 1．管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 1,736,679.78 | 587,843.77 |
| 2．托管费 | 7.4.10.2.2 | 289,446.58 | 97,973.91 |
| 3．销售服务费 | 7.4.10.2.3 | - | - |
| 4．交易费用 | 7.4.7.19 | 2,750,951.72 | 80,928.12 |
| 5．利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6．其他费用 | 7.4.7.20 | 345,410.99 | 80,668.00 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 6,484,230.68 | 125,583.18 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 6,484,230.68 | 125,583.18 |

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 213,733,032.47 | 125,583.18 | 213,858,615.65 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 6,484,230.68 | 6,484,230.68 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -169,357,403.86 | -5,334,194.56 | -174,691,598.42 |
| 其中：1.基金申购款 | 3,359,688.17 | 118,522.74 | 3,478,210.91 |
| 2.基金赎回款 | -172,717,092.03 | -5,452,717.30 | -178,169,809.33 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-” | - | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 号填列） | | | |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 44,375,628.61 | 1,275,619.30 | 45,651,247.91 |
| **项目** | **上年度可比期间<br>2016 年 10 月 25 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日** | | |
| | **实收基金** | **未分配利润** | **所有者权益合计** |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | - | - | - |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 125,583.18 | 125,583.18 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 213,733,032.47 | - | 213,733,032.47 |
| 其中：1.基金申购款 | 213,733,032.47 | - | 213,733,032.47 |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 213,733,032.47 | 125,583.18 | 213,858,615.65 |

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：

| | | |
|---|---|---|
| 杨绍基 | 傅军 | 李茂 |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2016〕1561 号），由基金发起人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》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称

“基金合同”)发起募集。本基金募集资金经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审验，并由其出具《验证报告》(安永华明(2016)验字第 61247680_G06 号)。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2016 年 10 月 25 日正式生效。本基金的基金管理人为中科沃土基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为：包括国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等)、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

### 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颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计政策变更。

#### 7.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计估计变更。

#### 7.4.4.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

### 7.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税〔2008〕1 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〔2012〕85 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〔2015〕101 号)、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36 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〕46 号)、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》(财税〔2016〕70 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〔2016〕140 号)及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(一) 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收企业所得税。

(三) 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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。对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入，由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。

### 7.4.6 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 | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构，基金发起人 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构 |
| 广东中科招商创业投资管理有限责任公司 | 基金管理人的股东、基金发起人 |
| 广东省粤科金融集团有限公司 | 基金管理人的股东、基金发起人 |
| 广东中广投资管理有限公司 | 基金管理人的股东、基金发起人 |
| 珠海横琴沃海投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 珠海横琴沃土创业投资有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 珠海横琴沃智投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 珠海横琴沃富投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 珠海横琴沃泽投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 中科招商投资管理集团股份有限公司 | 基金管理人控股股东的控股股东 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.7.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 7.4.7.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

##### 7.4.7.1.3 债券回购交易

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

##### 7.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 7.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.7.2 关联方报酬

##### 7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 10 月 25 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,736,679.78 | 587,843.77 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 997,670.49 | 323,605.65 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.5 %÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

### 7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 10 月 25 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 289,446.58 | 97,973.91 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

### 7.4.7.3 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。

### 7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

### 7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 10 月 25 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 基金合同生效日（ 2016 年 10 月 25 日 ）持有的基金份额 | | 4,975,124.38 |
| 期初持有的基金份额 | 4,975,124.38 | - |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 4,975,124.38 | 4,975,124.38 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 11.21% | 2.33% |

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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日 | | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 广东中科招商创业投资管理有限责任公司 | 2,976,293.76 | 6.71% | 2,976,293.76 | 1.39% |
| 广东省粤科金融集团有限公司 | 1,000,000.00 | 2.25% | 1,000,000.00 | 0.47% |
| 广东中广投资管理有限公司 | 197,642.23 | 0.45% | 197,642.23 | 0.09% |

### 7.4.7.5 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>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间<br>2016 年 10 月 25 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 2,875,312.63 | 116,424.16 | 4,244,206.20 | 29,985.50 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

### 7.4.7.6 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内未在承销期内参与关联方承销的证券。

## 7.4.8 期末（ 2017 年 12 月 31 日 ）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

### 7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|

| | | | | 单价 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 300383 | 光环新网 | 2017 年 11 月 7 日 | 重大事项 | 13.19 | 2018 年 3 月 19 日 | 14.51 | 53,978 | 800,601.70 | 711,969.82 | - |
| 300523 | 辰安科技 | 2017 年 10 月 19 日 | 重大事项 | 43.21 | 2018 年 2 月 6 日 | 42.57 | 39,980 | 1,923,022.20 | 1,727,535.80 | - |

### 7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金未从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

#### 7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金未从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

### 7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注 7.4.4.5。

(ii)各层级金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 34,033,751.18 元，属于第二层级余额为 2439505.62 元。无属于第三层级的余额。

(2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 28,896,731.28 元，无属于第二层级和第三层级的余额。)

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

# §8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 36,473,256.80 | 77.98 |
| | 其中：股票 | 36,473,256.80 | 77.98 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 5,000,000.00 | 10.69 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 3,139,768.57 | 6.71 |
| 7 | 其他各项资产 | 2,160,737.66 | 4.62 |
| 8 | 合计 | 46,773,763.03 | 100.00 |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 1,321,500.00 | 2.89 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 26,243,719.44 | 57.49 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 1,225,600.00 | 2.68 |
| F | 批发和零售业 | 156,267.35 | 0.34 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,230,000.00 | 2.69 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,439,505.62 | 5.34 |
| J | 金融业 | 3,687,400.00 | 8.08 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 169,264.39 | 0.37 |
| 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 | 36,473,256.80 | 79.90 |

### 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前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 30,000 | 2,099,400.00 | 4.60 |
| 2 | 000063 | 中兴通讯 | 50,000 | 1,818,000.00 | 3.98 |
| 3 | 600809 | 山西汾酒 | 31,727 | 1,808,121.73 | 3.96 |
| 4 | 601233 | 桐昆股份 | 80,000 | 1,799,200.00 | 3.94 |
| 5 | 300523 | 辰安科技 | 39,980 | 1,727,535.80 | 3.78 |
| 6 | 601988 | 中国银行 | 400,000 | 1,588,000.00 | 3.48 |
| 7 | 000725 | 京东方 A | 263,573 | 1,526,087.67 | 3.34 |
| 8 | 000568 | 泸州老窖 | 21,539 | 1,421,574.00 | 3.11 |
| 9 | 000039 | 中集集团 | 60,000 | 1,371,000.00 | 3.00 |
| 10 | 002714 | 牧原股份 | 25,000 | 1,321,500.00 | 2.89 |

## 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 | 002460 | 赣锋锂业 | 26,678,878.51 | 12.48 |
| 2 | 601336 | 新华保险 | 26,164,123.92 | 12.23 |
| 3 | 002466 | 天齐锂业 | 21,344,469.29 | 9.98 |
| 4 | 603799 | 华友钴业 | 21,196,537.00 | 9.91 |
| 5 | 300014 | 亿纬锂能 | 21,074,921.92 | 9.85 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 6 | 601318 | 中国平安 | 18,257,450.00 | 8.54 |
| 7 | 300450 | 先导智能 | 18,061,035.68 | 8.45 |
| 8 | 000651 | 格力电器 | 14,865,445.08 | 6.95 |
| 9 | 600068 | 葛洲坝 | 13,998,360.00 | 6.55 |
| 10 | 000063 | 中兴通讯 | 13,185,730.95 | 6.17 |
| 11 | 300568 | 星源材质 | 12,916,532.52 | 6.04 |
| 12 | 002812 | 创新股份 | 12,352,851.00 | 5.78 |
| 13 | 600110 | 诺德股份 | 11,421,424.00 | 5.34 |
| 14 | 000933 | 神火股份 | 10,373,252.00 | 4.85 |
| 15 | 603993 | 洛阳钼业 | 10,274,257.00 | 4.80 |
| 16 | 600259 | 广晟有色 | 10,143,487.00 | 4.74 |
| 17 | 002583 | 海能达 | 9,982,888.23 | 4.67 |
| 18 | 600089 | 特变电工 | 9,641,180.20 | 4.51 |
| 19 | 002714 | 牧原股份 | 9,154,581.84 | 4.28 |
| 20 | 002195 | 二三四五 | 8,887,801.96 | 4.16 |
| 21 | 603368 | 柳州医药 | 8,858,146.00 | 4.14 |
| 22 | 601668 | 中国建筑 | 8,490,771.24 | 3.97 |
| 23 | 002497 | 雅化集团 | 8,406,155.00 | 3.93 |
| 24 | 600519 | 贵州茅台 | 8,177,747.89 | 3.82 |
| 25 | 300457 | 赢合科技 | 8,173,695.00 | 3.82 |
| 26 | 600809 | 山西汾酒 | 7,931,427.00 | 3.71 |
| 27 | 002294 | 信立泰 | 7,825,343.40 | 3.66 |
| 28 | 603313 | 梦百合 | 7,706,752.75 | 3.60 |
| 29 | 600104 | 上汽集团 | 7,386,567.00 | 3.45 |
| 30 | 000568 | 泸州老窖 | 7,353,760.00 | 3.44 |
| 31 | 601988 | 中国银行 | 7,352,000.00 | 3.44 |
| 32 | 000951 | 中国重汽 | 7,259,956.00 | 3.39 |
| 33 | 601939 | 建设银行 | 7,111,700.00 | 3.33 |
| 34 | 600392 | 盛和资源 | 7,110,141.00 | 3.32 |
| 35 | 600028 | 中国石化 | 7,057,200.00 | 3.30 |
| 36 | 002833 | 弘亚数控 | 6,960,943.00 | 3.25 |
| 37 | 601628 | 中国人寿 | 6,948,094.00 | 3.25 |
| 38 | 002792 | 通宇通讯 | 6,766,758.00 | 3.16 |
| 39 | 002711 | 欧浦智网 | 6,698,638.60 | 3.13 |
| 40 | 600111 | 北方稀土 | 6,585,316.00 | 3.08 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 41 | 600428 | 中远海特 | 6,554,847.00 | 3.07 |
| 42 | 600549 | 厦门钨业 | 6,553,447.75 | 3.06 |
| 43 | 000615 | 京汉股份 | 6,503,529.09 | 3.04 |
| 44 | 000921 | 海信科龙 | 6,212,855.97 | 2.91 |
| 45 | 002439 | 启明星辰 | 6,186,634.00 | 2.89 |
| 46 | 600309 | 万华化学 | 5,667,995.00 | 2.65 |
| 47 | 002507 | 涪陵榨菜 | 5,646,031.20 | 2.64 |
| 48 | 002236 | 大华股份 | 5,620,760.00 | 2.63 |
| 49 | 002850 | 科达利 | 5,432,153.00 | 2.54 |
| 50 | 601388 | 怡球资源 | 5,364,700.00 | 2.51 |
| 51 | 300418 | 昆仑万维 | 5,291,069.78 | 2.47 |
| 52 | 600547 | 山东黄金 | 5,177,410.00 | 2.42 |
| 53 | 000065 | 北方国际 | 5,108,418.00 | 2.39 |
| 54 | 000725 | 京东方 A | 5,107,700.00 | 2.39 |
| 55 | 300156 | 神雾环保 | 5,054,153.84 | 2.36 |
| 56 | 603899 | 晨光文具 | 4,964,896.73 | 2.32 |
| 57 | 002371 | 北方华创 | 4,951,472.00 | 2.32 |
| 58 | 601636 | 旗滨集团 | 4,923,000.00 | 2.30 |
| 59 | 300476 | 胜宏科技 | 4,908,166.16 | 2.30 |
| 60 | 600176 | 中国巨石 | 4,868,377.60 | 2.28 |
| 61 | 603986 | 兆易创新 | 4,741,014.00 | 2.22 |
| 62 | 002555 | 三七互娱 | 4,730,912.00 | 2.21 |
| 63 | 600366 | 宁波韵升 | 4,678,542.00 | 2.19 |
| 64 | 600362 | 江西铜业 | 4,664,545.00 | 2.18 |
| 65 | 300612 | 宣亚国际 | 4,648,010.00 | 2.17 |
| 66 | 300073 | 当升科技 | 4,411,099.00 | 2.06 |
| 67 | 600884 | 杉杉股份 | 4,356,293.49 | 2.04 |
| 68 | 002019 | 亿帆医药 | 4,326,577.00 | 2.02 |

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

### 8.4.2 累计卖出金额超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 | 002460 | 赣锋锂业 | 28,064,608.14 | 13.12 |
| 2 | 601336 | 新华保险 | 25,790,839.39 | 12.06 |
| 3 | 603799 | 华友钴业 | 23,422,807.33 | 10.95 |
| 4 | 002466 | 天齐锂业 | 22,364,911.18 | 10.46 |
| 5 | 300014 | 亿纬锂能 | 21,583,382.48 | 10.09 |
| 6 | 300450 | 先导智能 | 18,957,955.81 | 8.86 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 16,795,667.27 | 7.85 |
| 8 | 000651 | 格力电器 | 15,824,095.26 | 7.40 |
| 9 | 600068 | 葛洲坝 | 13,635,472.61 | 6.38 |
| 10 | 000063 | 中兴通讯 | 12,834,565.51 | 6.00 |
| 11 | 300568 | 星源材质 | 12,781,395.51 | 5.98 |
| 12 | 002812 | 创新股份 | 11,944,881.92 | 5.59 |
| 13 | 600110 | 诺德股份 | 11,559,056.93 | 5.40 |
| 14 | 603993 | 洛阳钼业 | 10,844,085.89 | 5.07 |
| 15 | 000933 | 神火股份 | 10,352,138.34 | 4.84 |
| 16 | 600259 | 广晟有色 | 10,043,400.13 | 4.70 |
| 17 | 002583 | 海能达 | 9,625,844.40 | 4.50 |
| 18 | 600089 | 特变电工 | 9,484,185.07 | 4.44 |
| 19 | 603368 | 柳州医药 | 8,725,694.77 | 4.08 |
| 20 | 300457 | 赢合科技 | 8,548,500.99 | 4.00 |
| 21 | 600519 | 贵州茅台 | 8,507,305.67 | 3.98 |
| 22 | 002497 | 雅化集团 | 8,305,077.45 | 3.88 |
| 23 | 600809 | 山西汾酒 | 8,225,407.64 | 3.85 |
| 24 | 002714 | 牧原股份 | 8,103,767.57 | 3.79 |
| 25 | 601668 | 中国建筑 | 8,078,684.28 | 3.78 |
| 26 | 002195 | 二三四五 | 8,068,402.13 | 3.77 |
| 27 | 600028 | 中国石化 | 7,964,129.75 | 3.72 |
| 28 | 600392 | 盛和资源 | 7,874,583.46 | 3.68 |
| 29 | 600104 | 上汽集团 | 7,635,242.50 | 3.57 |
| 30 | 603313 | 梦百合 | 7,508,352.29 | 3.51 |
| 31 | 002711 | 欧浦智网 | 7,408,735.97 | 3.46 |
| 32 | 002833 | 弘亚数控 | 7,347,179.05 | 3.44 |
| 33 | 000951 | 中国重汽 | 7,264,343.63 | 3.40 |
| 34 | 002294 | 信立泰 | 7,235,145.75 | 3.38 |
| 35 | 601939 | 建设银行 | 7,217,975.50 | 3.38 |
| 36 | 601628 | 中国人寿 | 6,813,151.42 | 3.19 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 37 | 002792 | 通宇通讯 | 6,785,917.63 | 3.17 |
| 38 | 600549 | 厦门钨业 | 6,733,483.64 | 3.15 |
| 39 | 600111 | 北方稀土 | 6,686,191.97 | 3.13 |
| 40 | 600428 | 中远海特 | 6,492,832.57 | 3.04 |
| 41 | 000615 | 京汉股份 | 6,382,450.89 | 2.98 |
| 42 | 000568 | 泸州老窖 | 6,334,410.03 | 2.96 |
| 43 | 002439 | 启明星辰 | 6,209,060.56 | 2.90 |
| 44 | 600309 | 万华化学 | 6,105,818.83 | 2.86 |
| 45 | 000921 | 海信科龙 | 6,004,551.62 | 2.81 |
| 46 | 603986 | 兆易创新 | 5,921,761.82 | 2.77 |
| 47 | 002236 | 大华股份 | 5,913,254.81 | 2.77 |
| 48 | 300285 | 国瓷材料 | 5,830,057.83 | 2.73 |
| 49 | 601988 | 中国银行 | 5,724,000.00 | 2.68 |
| 50 | 002507 | 涪陵榨菜 | 5,629,008.20 | 2.63 |
| 51 | 000065 | 北方国际 | 5,499,205.21 | 2.57 |
| 52 | 600362 | 江西铜业 | 5,370,557.00 | 2.51 |
| 53 | 002850 | 科达利 | 5,360,996.11 | 2.51 |
| 54 | 300156 | 神雾环保 | 5,326,831.38 | 2.49 |
| 55 | 601388 | 怡球资源 | 5,275,653.02 | 2.47 |
| 56 | 600567 | 山鹰纸业 | 5,259,373.28 | 2.46 |
| 57 | 300418 | 昆仑万维 | 5,132,227.77 | 2.40 |
| 58 | 600547 | 山东黄金 | 5,063,155.00 | 2.37 |
| 59 | 002555 | 三七互娱 | 4,851,953.23 | 2.27 |
| 60 | 603899 | 晨光文具 | 4,781,210.67 | 2.24 |
| 61 | 600176 | 中国巨石 | 4,769,865.21 | 2.23 |
| 62 | 300476 | 胜宏科技 | 4,767,056.96 | 2.23 |
| 63 | 002019 | 亿帆医药 | 4,646,367.86 | 2.17 |
| 64 | 002614 | 奥佳华 | 4,643,874.93 | 2.17 |
| 65 | 000725 | 京东方Ａ | 4,592,677.68 | 2.15 |
| 66 | 600884 | 杉杉股份 | 4,461,035.98 | 2.09 |
| 67 | 601600 | 中国铝业 | 4,458,600.86 | 2.08 |
| 68 | 300073 | 当升科技 | 4,397,454.57 | 2.06 |
| 69 | 600366 | 宁波韵升 | 4,375,831.97 | 2.05 |
| 70 | 601989 | 中国重工 | 4,290,035.00 | 2.01 |

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,015,416,259.21 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,017,215,089.93 |

## 8.5 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。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.7 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。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

（1）本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金本报告期内未进行股指期货交易

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期本基金未投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

（1）本基金本报告期末未持有国债期货。

（2）本基金本报告期内未进行国债期货交易。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

## 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

**本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。**

### 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 | 250,447.05 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,899,216.06 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 9,483.59 |
| 5 | 应收申购款 | 1,590.96 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,160,737.66 |

### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300523 | 辰安科技 | 1,727,535.80 | 3.78 | 重大事项 |

# §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

| 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 |
| 1,062 | 41,784.96 | 9,149,060.37 | 20.62% | 35,226,568.24 | 79.38% |

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 2,811,782.93 | 6.3400% |

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 50~100 |

注：本基金的基金经理同时为基金管理人高级管理人员。

## 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例（%） | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例（%） | 发起份额承诺持有期限 |
|---|---|---|---|---|---|
| 基金管理人固有资金 | 4,975,124.38 | 11.21 | 4,975,124.38 | 11.21 | 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | 1,931,683.70 | 4.35 | 1,931,683.70 | 4.35 | 3 年 |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | 4,173,935.99 | 9.41 | 4,173,935.99 | 9.41 | 3 年 |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 11,080,744.07 | 24.97 | 11,080,744.07 | 24.97 | 3 年 |

注：本基金的基金经理同时为基金管理人高级管理人员。

# §10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（ 2016 年 10 月 25 日 ）基金份额总额 | 213,733,032.47 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 213,733,032.47 |
| 本报告期基金总申购份额 | 3,359,688.17 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 172,717,092.03 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 44,375,628.61 |

# §11 重大事件揭示

## 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2017 年 3 月 31 日发布公告，袁鹏先生不再担任中科沃土基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内聘请天健会计师事务所（特殊普通合伙）。本年度支付给天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 30,000.00 元，该审计机构已提供审计服务年限为 2 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员因公司固有资金持有高流动性资产比例不符合《基金管理公司固有资金运用管理暂行规定》，收到广东证监局责令改正的要求，本基金管理人及其高级管理人员已按监管要求在规定时间完成整改，并向广东证监局提交了整改完成报告。

除上述情况外，本报告期内管理人、托管人及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|---|---|---|---|---|

| | 数量 | 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 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 国泰君安 | 1 | 630,241,572.01 | 31.01% | 460,896.96 | 29.67% | - |
| 天风证券 | 2 | 391,196,095.60 | 19.25% | 286,081.07 | 18.42% | - |
| 国信证券 | 2 | 349,578,347.57 | 17.20% | 255,650.21 | 16.46% | - |
| 银河证券 | 2 | 334,916,787.31 | 16.48% | 311,909.14 | 20.08% | - |
| 国金证券 | 2 | 182,152,756.06 | 8.96% | 133,208.61 | 8.58% | - |
| 兴业证券 | 2 | 144,502,151.15 | 7.11% | 105,676.38 | 6.80% | - |
| 万联证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东莞证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、交易席位选择标准：

(1)财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；

(2)经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(3)具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；

(4)具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

(5)能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；

(6)能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程：

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

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | 债券回购交易 | 权证交易 |
|---|---|---|---|

| | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | 3,841,100,000.00 | 48.88% | - | - |
| 国信证券 | - | - | 3,070,900,000.00 | 39.08% | - | - |
| 银河证券 | - | - | 11,000,000.00 | 0.14% | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | 935,500,000.00 | 11.90% | - | - |
| 万联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 东莞证券 | - | - | - | - | - | - |

**中科沃土基金管理有限公司**

**2018 年 3 月 30 日**