

中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券
投资基金
2019 年半年度报告

2019 年 6 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 26 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20

§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	55
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	55
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	56
§8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
8.3 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.....	58
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	59
§9 开放式基金份额变动	60
§10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息	64
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	64

§12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	中科沃土沃瑞混合发起	
基金主代码	005855	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 1 月 14 日	
基金管理人	中科沃土基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	11,473,861.89 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C
下属分级基金的交易代码:	005855	005856
报告期末下属分级基金的份额总额	10,196,041.07 份	1,277,820.82 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过系统化的方法精选环境、财务可持续的上市公司，通过精选个股和风险控制，力争为投资者创造超越业绩比较基准的回报。
投资策略	通过对经济周期及资产价格发展变化的理解，在把握经济周期性波动的基础上，动态评估不同资产类在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置及资产的稳健增长。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数(全价)收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中科沃土基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曹萍	陆志俊
	联系电话	020-37128608	95559
	电子邮箱	caoping@richlandasm.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-018-3610	95559
传真		020-23388997	021-62701216
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-5668	中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		广东省广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 21 楼 01	中国(上海)长宁区仙霞路 18 号

	单元自编 06-08 号	
邮政编码	510620	200336
法定代表人	朱为绎	彭纯

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.richlandasm.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 21 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中科沃土基金管理有限公司	广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 2107

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月14日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月14日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	2,202.56	15,225.64
本期利润	410,515.24	72,586.88
加权平均基金份额本期利润	0.0420	0.0544
本期加权平均净值利润率	4.05%	5.26%
本期基金份额净值增长率	4.47%	4.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配利润	31,157.55	-811.62
期末可供分配基金份额利润	0.0031	-0.0006
期末基金资产净值	10,651,452.19	1,330,025.08
期末基金份额净值	1.0447	1.0409
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	4.47%	4.09%

- 注：1. 本基金合同生效日为 2019 年 1 月 14 日，截止 2019 年 6 月 30 日，本基金成立未满 1 年。
2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。
4. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中科沃土沃瑞混合发起 A

阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-------	------	------	--------	-----	-----

	长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	3.66%	0.98%	3.35%	0.69%	0.31%	0.29%
过去三个月	-1.78%	1.02%	-0.82%	0.91%	-0.96%	0.11%
自基金合同生效起至今	4.47%	0.87%	14.03%	0.94%	-9.56%	-0.07%

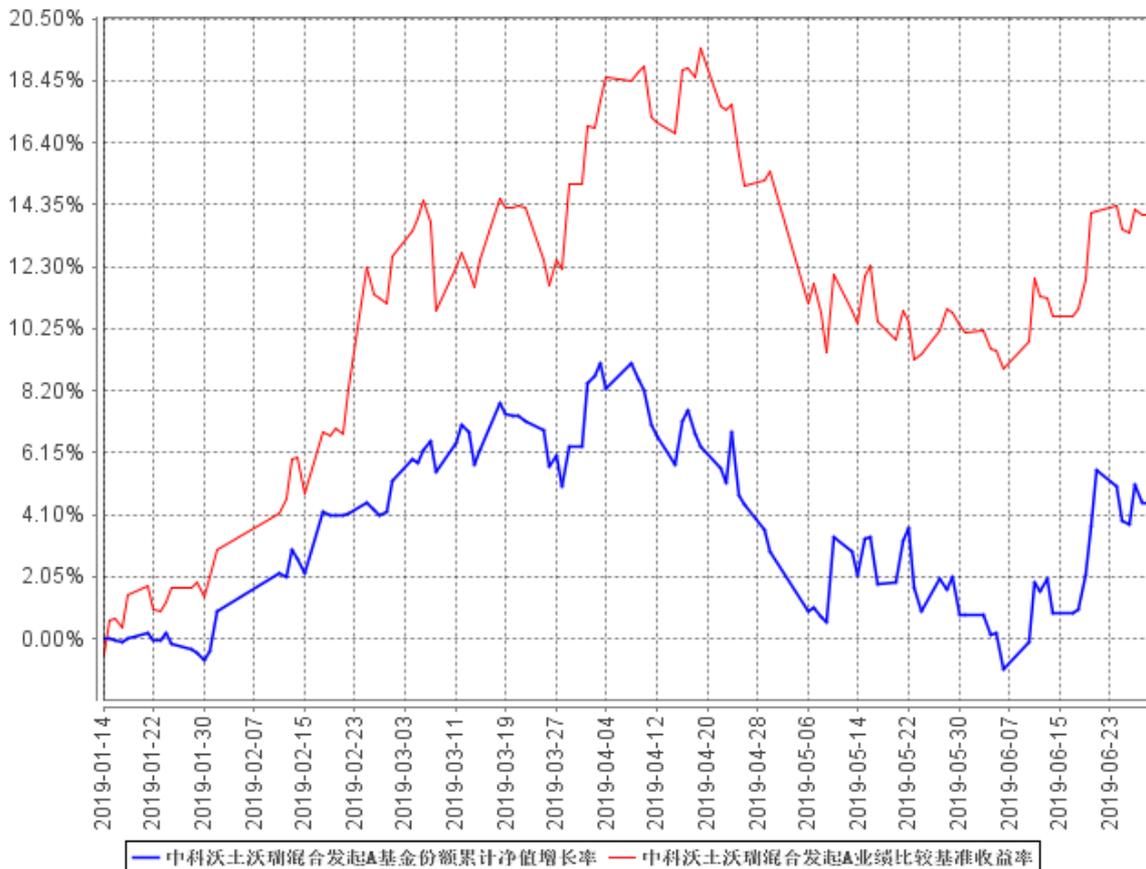
中科沃土沃瑞混合发起 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.59%	0.98%	3.35%	0.69%	0.24%	0.29%
过去三个月	-1.97%	1.02%	-0.82%	0.91%	-1.15%	0.11%
自基金合同生效起至今	4.09%	0.86%	14.03%	0.94%	-9.94%	-0.08%

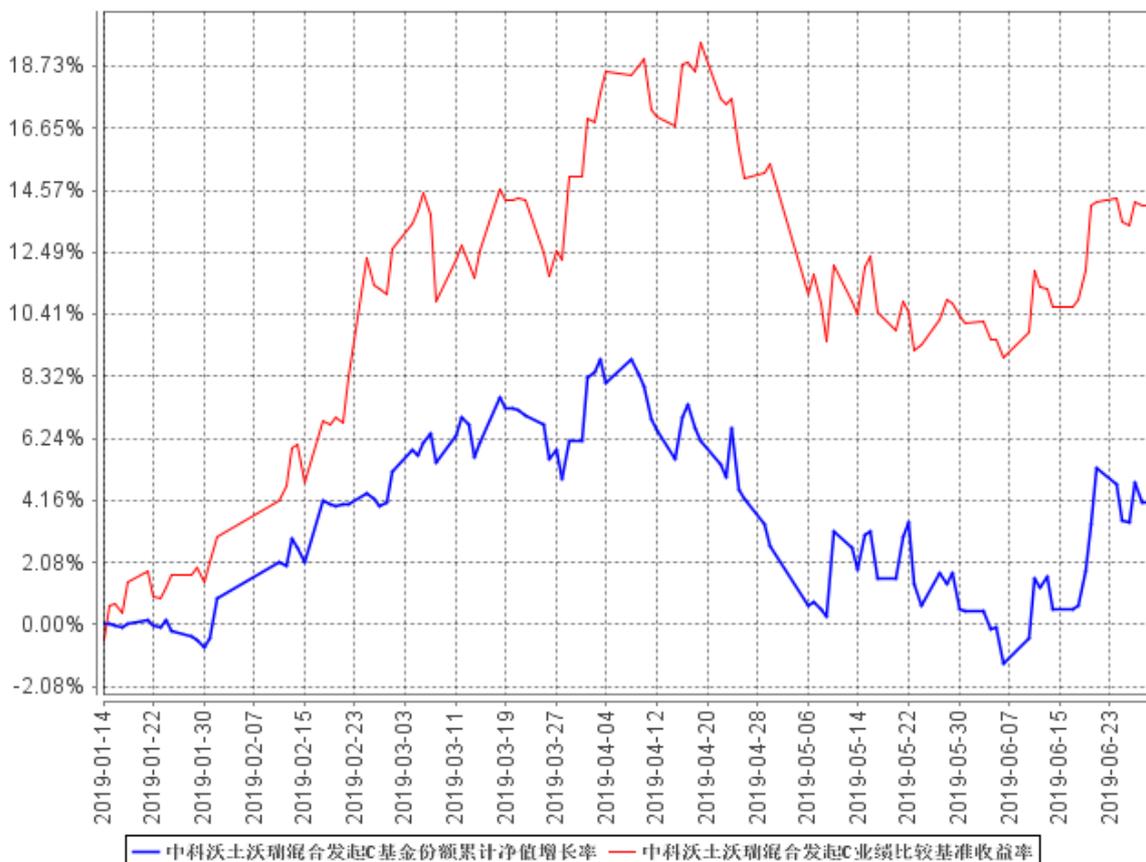
注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

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



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



注：本基金合同生效日为 2019 年 1 月 14 日，建仓期为基金合同生效后六个月。至本报告期期末本基金仍处于建仓期。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中科沃土基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2015]1937 号文批准，于 2015 年 9 月 6 日正式成立，注册资本 1.42 亿元，是国内第 101 家公募基金管理公司，也是一家拥有 PE 背景的公募基金管理公司。中科沃土带着中科招商、粤科金融等主要股东强大的精神基因和优秀的文化基因，始终贯彻“持有人利益至上”的首要经营准则，遵循诚信、规范、稳健的经营方针，崇尚价值投资理念和长期、平稳、盈利的投资风格，致力于为持有人提供专业、精品、创新的投资理财服务，创造成长价值，汇聚阳光财富。截至 2019 年 6 月 30 日，中科沃土旗下共管理 7 只开放式基金：中科沃土货币市场基金、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、中科沃土沃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、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。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		
杨凡	基金经理	2019 年 1 月 14 日	-	8 年	经济学硕士。曾任金鹰基金管理有限公司研究部研究员，广发证券股份有限公司自营部研究员，现任中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金和 中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
黄艺明	权益投资部副总经理、基金经理	2019 年 1 月 14 日	-	10 年	经济学硕士。曾任广东粤财信托有限公司研究员，金鹰基金管理有限公司基金经理助理、研究总监助理，七匹狼控股集团有限公司投资经理助理，广东

					富业盛德资产管理有限公司执行董事、投资总监，中科沃土基金管理有限公司专户投资部副总经理、投资经理，现任中科沃土基金管理有限公司权益投资部副总经理、中科沃土沃祥债券型发起式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基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

注：1. 此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，黄艺明、杨凡的“任职日期”为基金合同生效之日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

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在本报告期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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

回顾沃瑞基金二季度操作，尽管 4 月份政治局会议后，估计到货币政策边际收紧预期对权益市场的调整压力，做出了整体仓位控制应对，但对“五一”节后中美贸易冲突估计不足，进而产品净值历经约四个月运作，回到起点，回撤偏大，非常遗憾。

6 月份后，伴随国内逆周期调节政策逐步划落地，叠加 G20 中美确定恢复贸易谈判，市场风险投资偏好提升，我们适时调整仓位及结构，净值走势呈现良好态势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中科沃土沃瑞混合发起 A 基金份额净值为 1.0447 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.47%；截至本报告期末中科沃土沃瑞混合发起 C 基金份额净值为 1.0409 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.09%；同期业绩比较基准收益率为 14.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年三季度投资策略展望：

宏观经济趋势：预计后续货币政策稳中有松、财政政策进一步减税降费逐步见效，宏观经济及企业盈利有望逐步提升，但中美贸易谈判可能一波三折，不确定性仍存。

对于未来一段相对较长的投资周期中，权益市场方面，整体指数可能趋于震荡，但底部抬升。

其中受益促内需、改革及政策扶持的新经济、新基建会持续呈现结构性投资机会，这些行业可能主要集中在 5G+运用（智能驾驶、医疗、信息传播、能源互联网等）、人工智能、物联网、信息化等科技创新类行业。

当前沃瑞基金主要仓位构建基本完成，配置结构上主要围绕券商保险、计算机电子传媒（5G+运用）、地产及地产竣工后周期消费建材、部分自下而上中报预期高增长个股。

风险因素：中美贸易冲突加剧

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	959,484.81
结算备付金		498,588.60
存出保证金		43,735.88
交易性金融资产	6.4.7.2	10,638,864.00
其中：股票投资		10,638,864.00
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	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	300,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	416.89
应收股利		-
应收申购款		100.00
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		12,441,190.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		299,654.50
应付赎回款		-
应付管理人报酬		14,415.38
应付托管费		2,402.58
应付销售服务费		853.14
应付交易费用	6.4.7.7	128,068.67

应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	14,318.64
负债合计		459,712.91
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	11,473,861.89
未分配利润	6.4.7.10	507,615.38
所有者权益合计		11,981,477.27
负债和所有者权益总计		12,441,190.18

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，中科沃土沃瑞混合发起 A 基金份额净值 1.0447 元，基金份额总额 10196041.07 份；中科沃土沃瑞混合发起 C 基金份额净值 1.0409 元，基金份额总额 1277820.82 份。中科沃土沃瑞混合发起 份额总额合计为 11473861.89 份。

6.2 利润表

会计主体：中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		957,314.00
1.利息收入		60,205.00
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,711.48
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		47,493.52
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		431,186.25
其中：股票投资收益	6.4.7.12	413,131.30
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	18,054.95
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	465,673.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-

列)		
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	248.83
减：二、费用		474,211.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	78,879.57
2. 托管费	6.4.10.2.2	13,146.60
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,051.90
4. 交易费用	6.4.7.19	362,225.17
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	14,908.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		483,102.12
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		483,102.12

注：本基金的基金合同于 2019 年 1 月 14 日生效，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	10,478,812.69	-	10,478,812.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	483,102.12	483,102.12
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）	995,049.20	24,513.26	1,019,562.46
其中：1.基金申购款	1,465,056.71	57,578.34	1,522,635.05
2.基金赎回款	-470,007.51	-33,065.08	-503,072.59

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）	11,473,861.89	507,615.38	11,981,477.27

注：本基金的基金合同于 2019 年 1 月 14 日生效，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>程文卫</u>	<u>傅军</u>	<u>李茂</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中科沃土沃瑞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瑞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〔2017〕053 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《中科沃土沃瑞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。本基金募集资金经瑞华会计师事务所审验，并由其出具《验证报告》（瑞华）验字第[2019]48090001 号）。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2019 年 1 月 14 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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：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、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、股指期货、国债期货、权证、债券（包括但不限于国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、银行存款，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部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。

6.4.3 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止,本会计期间为 2019 年 1 月 14 日(基金合同生效日)起至 2019 年 12 月 31 日。

6.4.4.2 记账本位币

采用人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1. 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资(主要为权证投资和股指期货、国债期货)等,其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报,衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2. 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益；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。

满足下列条件之一的金融资产，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；
- (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。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。

1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(1) 股票投资

买入股票于交易日按股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

(2) 债券投资

买入债券于交易日按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于债券部分的成本。

买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行

期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3) 权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

(4) 股指期货

股指期货于相关合同签署日以公允价值进行初始计量，并以公允价值进行后续计量，公允价值变动计入当期损益。因股指期货交易每日无负债结算确认的相关金融资产和金融负债，与相关的股指期货暂收暂付款之间按抵销后的净额在资产负债表内列示。

2. 贷款及应收款项

买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始确认金额。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

3. 其他金融负债

卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始确认金额成本。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1. 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采

用最近交易市价确定公允价值。

2. 对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

3. 当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上或基金管理人估值委员会认为必要时，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

4. 对于交易所市场和银行间市场交易的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，采用第三方估值机构所提供的估值确定公允价值，另有规定的除外。

具体投资品种的估值方法如下：

(1) 股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

本基金对于长期停牌股票的期末估值参照中国证监会 2008 年 9 月 12 日发布的证监会公告[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》规定，若长期停牌股票的潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，经基金管理人估值委员会同意，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素(如指数收益法)，调整最近交易市价，确定公允价值。

由于上市公司送股、转增股、配股和公开增发新股等形成的流通暂时受限制的股票投资，按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

首次公开发行但未上市股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本计量。首次公开发行有明确锁定期的股票，于同一股票上市后按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

非公开发行有明确锁定期的股票，若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，以估值日证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价为公允价值；若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按中国证监会相关规定处理。

(2) 债券投资

银行间和交易所市场上市交易的债券(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，采用第三方估值机构(中央国债登记结算公司或中证指数有限公司)提供的估值净价确定公允价值。

交易所市场上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去收盘价中所含债券应收利息后的净价作为公允价值。

未上市或未挂牌转让的债券、以及在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券按成本估值。

(3) 权证投资

交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价为公允价值。

首次公开发行但尚未上市的权证在上市交易前，采用估值技术确定公允价值，如估值技术难以可靠计量，则以成本计量。

配售及认购分离交易可转换债券所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前，采用估值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量，则按成本计量。

因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值，基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后确定最能反映公允价值的价格。

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次的输入值确定公允价值计量层次。公允价值计量层次可分为：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是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。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项

中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例, 损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1. 利息收入

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

(2) 除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内, 按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额, 逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债, 根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后, 逐日确认债券利息收入。

(3) 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提, 若合同利率与实际利率差异较小, 则采用合同利率计算确定利息收入。

2. 投资收益

(1) 股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

(2) 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

(3) 衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

(4) 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

3. 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认, 并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

1、本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按计划合同约定的费率和计算方法逐日确认。

2、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入

交易费用。

3、卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

每一基金份额享有同等分配权；

2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金

份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

认的收益分配方式是现金分红；

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

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质不

利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

6.4.4.12 分部报告

据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
活期存款	959,484.81
定期存款	-
其中:存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-

合计:	959,484.81
-----	------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	10,173,190.08	10,638,864.00	465,673.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	10,173,190.08	10,638,864.00	465,673.92

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期内无投资衍生工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	300,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	300,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	172.79
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	224.40
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	19.70
合计	416.89

6.4.7.6 其他资产

注：本报告期末本基金无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	128,068.67
银行间市场应付交易费用	-
合计	128,068.67

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	14,318.64
合计	14,318.64

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中科沃土沃瑞混合发起 A

项目	本期 2019 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	8,992,376.24	8,992,376.24
本期申购	1,264,809.22	1,264,809.22
本期赎回(以“-”号填列)	-61,144.39	-61,144.39
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	10,196,041.07	10,196,041.07

金额单位：人民币元

中科沃土沃瑞混合发起 C		
项目	本期 2019 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,486,436.45	1,486,436.45
本期申购	200,247.49	200,247.49
本期赎回(以“-”号填列)	-408,863.12	-408,863.12
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,277,820.82	1,277,820.82

注：本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中科沃土沃瑞混合发起 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,202.56	408,312.68	410,515.24
本期基金份额交易产生的变动数	28,954.99	15,940.89	44,895.88
其中：基金申购款	31,603.61	16,714.87	48,318.48
基金赎回款	-2,648.62	-773.98	-3,422.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,157.55	424,253.57	455,411.12

单位：人民币元

中科沃土沃瑞混合发起 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	15,225.64	57,361.24	72,586.88
本期基金份额交易产生的变动数	-16,037.26	-4,345.36	-20,382.62
其中：基金申购款	8,197.14	1,062.72	9,259.86
基金赎回款	-24,234.40	-5,408.08	-29,642.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-811.62	53,015.88	52,204.26

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月14日(基金合同生效日)至2019年6月30日
活期存款利息收入	8,897.41
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,673.33
其他	140.74
合计	12,711.48

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月14日(基金合同生效日)至2019年6月30日
卖出股票成交总额	134,174,266.69
减：卖出股票成本总额	133,761,135.39
买卖股票差价收入	413,131.30

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月14日(基金合同生效日)至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	18,054.95
基金投资产生的股利收益	-
合计	18,054.95

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月14日(基金合同生效日)至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	465,673.92
——股票投资	465,673.92
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	465,673.92

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月14日(基金合同生效日)至2019年6月30日

基金赎回费收入	248.83
合计	248.83

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	362,225.17
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	362,225.17

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	14,318.64
信息披露费	-
银行汇划费	190.00
其他	400.00
合计	14,908.64

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
珠海横琴西拓投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	78,879.57
其中：支付销售机构的客户维护费	5,574.42

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：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	13,146.60

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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C	合计
中科沃土基金管理有限 公司	-	4,663.51	4,663.51
合计	-	4,663.51	4,663.51

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.80%的年费率计提。C 类基金份额的销售

服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人自动于次月首日起三个工作日内从基金财产中一次性支付至登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。销售服务费主要用于本基金 C 类基金份额持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场（含回购）的交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 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 2019年6月30日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
广东中科科创创业投资管理有限责任公司	1,000,410.96	8.72%
珠海横琴西拓投资合伙企业（有限合伙）	8,003,602.74	70.00%

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.10.5 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 2019年1月14日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	959,484.81	8,897.41

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

息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人通过严格的备选库制度、对交易对手（包括存款银行）、证券发行人的信用评级进行跟踪，和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

本基金本报告期末未持有债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，监察风控部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	959,484.81	-	-	-	959,484.81
结算备付金	498,588.60	-	-	-	498,588.60
存出保证金	43,735.88	-	-	-	43,735.88
交易性金融资产	-	-	-	10,638,864.00	10,638,864.00
买入返售金融资产	300,000.00	-	-	-	300,000.00
应收利息	-	-	-	416.89	416.89
应收申购款	-	-	-	100.00	100.00
资产总计	1,801,809.29	-	-	10,639,380.89	12,441,190.18
负债					
应付证券清算款	-	-	-	299,654.50	299,654.50
应付管理人报酬	-	-	-	14,415.38	14,415.38
应付托管费	-	-	-	2,402.58	2,402.58
应付销售服务费	-	-	-	853.14	853.14
应付交易费用	-	-	-	128,068.67	128,068.67
其他负债	-	-	-	14,318.64	14,318.64
负债总计	-	-	-	459,712.91	459,712.91
利率敏感度缺口	1,801,809.29	-	-	10,179,667.98	11,981,477.27
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
负债					

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：截至 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的股票价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	10,638,864.00	88.79
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	10,638,864.00	88.79

注：本基金合同于 2019 年 1 月 14 日生效。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	115,723.60	-
	业绩比较基准下降 5%	-115,723.60	-

注：本基金合同于 2019 年 1 月 14 日生效。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(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 6.4.4.5。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 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 10,638,864.00 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	10,638,864.00	85.51
	其中：股票	10,638,864.00	85.51
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	300,000.00	2.41
	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	1,458,073.41	11.72
8	其他各项资产	44,252.77	0.36
9	合计	12,441,190.18	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	3,550.00	0.03
C	制造业	3,686,142.00	30.77
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	3,246,221.00	27.09

J	金融业	2,674,961.00	22.33
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	494,340.00	4.13
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	533,650.00	4.45
S	综合	-	-
	合计	10,638,864.00	88.79

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601688	华泰证券	27,000	602,640.00	5.03
2	603737	三棵树	13,700	596,498.00	4.98
3	300413	芒果超媒	13,000	533,650.00	4.45
4	002677	浙江美大	40,000	526,400.00	4.39
5	002398	建研集团	77,000	494,340.00	4.13
6	002405	四维图新	30,000	483,000.00	4.03
7	600030	中信证券	20,000	476,200.00	3.97
8	300253	卫宁健康	33,300	472,194.00	3.94
9	600588	用友网络	17,000	456,960.00	3.81
10	300365	恒华科技	27,700	449,017.00	3.75
11	300451	创业慧康	30,000	448,500.00	3.74
12	002798	帝欧家居	23,300	426,623.00	3.56
13	002803	吉宏股份	20,000	408,200.00	3.41
14	000783	长江证券	47,000	367,070.00	3.06
15	300771	智莱科技	6,500	363,025.00	3.03
16	002123	梦网集团	25,000	353,500.00	2.95
17	601377	兴业证券	50,000	337,000.00	2.81

18	600837	海通证券	23,300	330,627.00	2.76
19	601211	国泰君安	17,700	324,795.00	2.71
20	300770	新媒股份	3,700	320,050.00	2.67
21	002777	久远银海	10,000	263,000.00	2.20
22	601336	新华保险	4,300	236,629.00	1.97
23	300735	光弘科技	13,300	227,164.00	1.90
24	002511	中顺洁柔	17,700	217,356.00	1.81
25	600745	闻泰科技	6,000	199,320.00	1.66
26	600702	舍得酒业	7,000	190,260.00	1.59
27	300657	弘信电子	8,300	189,240.00	1.58
28	002810	山东赫达	13,300	187,530.00	1.57
29	002475	立讯精密	5,000	123,950.00	1.03
30	002916	深南电路	300	30,576.00	0.26
31	600968	海油发展	1,000	3,550.00	0.03

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000933	神火股份	2,817,130.80	23.51
2	600497	驰宏锌锗	2,779,775.00	23.20
3	002398	建研集团	2,678,252.00	22.35
4	000831	五矿稀土	2,352,362.23	19.63
5	300166	东方国信	2,173,749.00	18.14
6	002195	二三四五	2,139,999.00	17.86
7	600392	盛和资源	2,083,408.14	17.39
8	000977	浪潮信息	2,018,396.00	16.85
9	600549	厦门钨业	1,973,544.50	16.47
10	300253	卫宁健康	1,923,505.00	16.05
11	002803	吉宏股份	1,893,171.00	15.80
12	002123	梦网集团	1,823,642.00	15.22
13	000960	锡业股份	1,782,230.70	14.87
14	000063	中兴通讯	1,567,443.00	13.08
15	002810	山东赫达	1,548,383.27	12.92

16	600588	用友网络	1,483,776.32	12.38
17	000060	中金岭南	1,472,172.00	12.29
18	600837	海通证券	1,356,229.00	11.32
19	002798	帝欧家居	1,348,687.38	11.26
20	300451	创业慧康	1,345,078.00	11.23
21	002930	宏川智慧	1,289,383.00	10.76
22	002677	浙江美大	1,258,397.14	10.50
23	000783	长江证券	1,225,787.07	10.23
24	603019	中科曙光	1,182,017.00	9.87
25	002182	云海金属	1,178,003.00	9.83
26	601601	中国太保	1,166,998.00	9.74
27	002497	雅化集团	1,143,842.00	9.55
28	601688	华泰证券	1,109,956.00	9.26
29	600030	中信证券	1,092,135.00	9.12
30	002466	天齐锂业	1,044,304.00	8.72
31	601186	中国铁建	1,039,069.00	8.67
32	300496	中科创达	1,024,320.00	8.55
33	300073	当升科技	1,011,629.00	8.44
34	002405	四维图新	1,009,370.00	8.42
35	600406	国电南瑞	1,008,784.00	8.42
36	600489	中金黄金	984,733.00	8.22
37	600259	广晟有色	983,887.92	8.21
38	300088	长信科技	978,495.00	8.17
39	000923	河北宣工	952,596.00	7.95
40	601933	永辉超市	936,912.00	7.82
41	300570	太辰光	933,304.00	7.79
42	000970	中科三环	924,136.00	7.71
43	000401	冀东水泥	912,672.00	7.62
44	300420	五洋停车	899,837.20	7.51
45	600528	中铁工业	893,074.00	7.45
46	002467	二六三	885,500.75	7.39
47	000672	上峰水泥	852,781.00	7.12
48	000938	紫光股份	829,917.00	6.93
49	600295	鄂尔多斯	817,749.00	6.83
50	002511	中顺洁柔	815,417.19	6.81
51	600031	三一重工	801,900.00	6.69

52	600532	宏达矿业	789,306.00	6.59
53	002036	联创电子	782,650.00	6.53
54	300770	新媒股份	757,866.00	6.33
55	600425	青松建化	755,663.00	6.31
56	603160	汇顶科技	709,917.00	5.93
57	603588	高能环境	701,428.00	5.85
58	601555	东吴证券	693,172.46	5.79
59	002407	多氟多	690,610.02	5.76
60	300735	光弘科技	680,239.00	5.68
61	002460	赣锋锂业	676,047.00	5.64
62	600884	杉杉股份	674,719.00	5.63
63	300638	广和通	671,060.00	5.60
64	300037	新宙邦	668,258.00	5.58
65	600720	祁连山	666,257.00	5.56
66	002237	恒邦股份	659,812.19	5.51
67	603505	金石资源	651,664.00	5.44
68	300578	会畅通讯	649,338.00	5.42
69	300531	优博讯	648,199.00	5.41
70	300365	恒华科技	645,084.00	5.38
71	002594	比亚迪	644,361.00	5.38
72	300586	美联新材	624,854.00	5.22
73	002020	京新药业	614,267.00	5.13
74	000807	云铝股份	610,886.00	5.10
75	600028	中国石化	594,820.00	4.96
76	300750	宁德时代	594,494.00	4.96
77	603187	海容冷链	593,761.00	4.96
78	300657	弘信电子	592,517.00	4.95
79	601636	旗滨集团	590,900.00	4.93
80	601766	中国中车	590,603.00	4.93
81	300170	汉得信息	577,379.00	4.82
82	002709	天赐材料	574,386.00	4.79
83	600711	盛屯矿业	572,780.00	4.78
84	600985	淮北矿业	567,615.00	4.74
85	603737	三棵树	564,685.00	4.71
86	000528	柳工	557,823.80	4.66
87	601111	中国国航	557,608.00	4.65

88	600997	开滦股份	553,986.00	4.62
89	600123	兰花科创	546,000.00	4.56
90	600536	中国软件	545,974.00	4.56
91	600643	爱建集团	544,523.00	4.54
92	300502	新易盛	541,612.00	4.52
93	300481	濮阳惠成	538,287.53	4.49
94	002384	东山精密	536,691.00	4.48
95	600740	山西焦化	535,583.00	4.47
96	601377	兴业证券	535,228.00	4.47
97	002698	博实股份	530,659.00	4.43
98	601969	海南矿业	527,867.00	4.41
99	300413	芒果超媒	526,782.00	4.40
100	002655	共达电声	526,301.00	4.39
101	300252	金信诺	521,818.00	4.36
102	600000	浦发银行	520,206.00	4.34
103	000983	西山煤电	519,175.00	4.33
104	600115	东方航空	518,410.00	4.33
105	601166	兴业银行	504,590.00	4.21
106	603713	密尔克卫	501,378.00	4.18
107	002777	久远银海	492,991.00	4.11
108	002155	湖南黄金	492,568.25	4.11
109	601225	陕西煤业	491,397.00	4.10
110	002600	领益智造	491,139.00	4.10
111	000425	徐工机械	486,820.00	4.06
112	002508	老板电器	483,198.00	4.03
113	600456	宝钛股份	466,064.00	3.89
114	000629	攀钢钒钛	461,530.00	3.85
115	002241	歌尔股份	457,536.00	3.82
116	300624	万兴科技	454,164.00	3.79
117	600029	南方航空	453,569.93	3.79
118	300383	光环新网	435,751.00	3.64
119	601992	金隅集团	434,140.00	3.62
120	600410	华胜天成	427,072.00	3.56
121	601699	潞安环能	417,119.00	3.48
122	600547	山东黄金	413,934.00	3.45
123	600111	北方稀土	413,267.00	3.45

124	603267	鸿远电子	410,607.69	3.43
125	000001	平安银行	410,420.60	3.43
126	603636	南威软件	406,472.11	3.39
127	600970	中材国际	401,324.00	3.35
128	300776	帝尔激光	397,084.00	3.31
129	002842	翔鹭钨业	391,588.00	3.27
130	002439	启明星辰	387,943.00	3.24
131	600756	浪潮软件	378,347.00	3.16
132	002051	中工国际	376,319.00	3.14
133	601800	中国交建	372,265.00	3.11
134	300200	高盟新材	363,431.00	3.03
135	601899	紫金矿业	362,640.00	3.03
136	002099	海翔药业	360,112.00	3.01
137	600153	建发股份	354,659.00	2.96
138	300438	鹏辉能源	349,905.00	2.92
139	300632	光莆股份	348,103.00	2.91
140	300771	智莱科技	345,310.00	2.88
141	002436	兴森科技	341,372.00	2.85
142	601390	中国中铁	340,990.00	2.85
143	000655	金岭矿业	338,189.00	2.82
144	300590	移为通信	337,928.00	2.82
145	000750	国海证券	332,627.00	2.78
146	002410	广联达	327,700.00	2.74
147	300098	高新兴	326,131.02	2.72
148	601211	国泰君安	323,812.90	2.70
149	603799	华友钴业	323,124.00	2.70
150	300409	道氏技术	320,110.00	2.67
151	600141	兴发集团	317,862.00	2.65
152	000630	铜陵有色	315,350.00	2.63
153	000789	万年青	295,789.00	2.47
154	300529	健帆生物	290,074.00	2.42
155	600745	闻泰科技	288,698.00	2.41
156	600801	华新水泥	286,219.00	2.39
157	002074	国轩高科	285,680.00	2.38
158	300474	景嘉微	283,788.00	2.37
159	601600	中国铝业	281,600.00	2.35

160	000066	中国长城	279,658.00	2.33
161	002675	东诚药业	277,805.00	2.32
162	002955	鸿合科技	277,795.00	2.32
163	600728	佳都科技	277,362.00	2.31
164	601857	中国石油	270,520.00	2.26
165	002371	北方华创	269,567.00	2.25
166	002373	千方科技	261,732.00	2.18
167	000878	云南铜业	261,714.00	2.18
168	002153	石基信息	258,957.00	2.16
169	002796	世嘉科技	258,397.00	2.16
170	601668	中国建筑	255,521.00	2.13
171	300755	华致酒行	255,257.00	2.13
172	600369	西南证券	255,160.00	2.13
173	002635	安洁科技	254,831.00	2.13
174	002554	惠博普	253,600.00	2.12
175	000547	航天发展	252,244.00	2.11
176	300146	汤臣倍健	252,100.00	2.10
177	600958	东方证券	244,483.00	2.04
178	300618	寒锐钴业	241,705.00	2.02
179	601003	柳钢股份	240,315.00	2.01

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 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。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000933	神火股份	2,800,271.00	23.37
2	600497	驰宏锌锗	2,740,102.00	22.87
3	000831	五矿稀土	2,570,065.00	21.45
4	002398	建研集团	2,220,637.96	18.53
5	300166	东方国信	2,189,997.43	18.28
6	002195	三四五	2,123,600.00	17.72

7	600392	盛和资源	2,101,221.77	17.54
8	000977	浪潮信息	2,073,899.00	17.31
9	600549	厦门钨业	1,984,962.60	16.57
10	000960	锡业股份	1,763,158.00	14.72
11	000063	中兴通讯	1,583,771.00	13.22
12	002803	吉宏股份	1,492,329.70	12.46
13	002123	梦网集团	1,475,213.00	12.31
14	000060	中金岭南	1,462,454.00	12.21
15	300253	卫宁健康	1,458,795.00	12.18
16	002810	山东赫达	1,327,011.00	11.08
17	002930	宏川智慧	1,262,102.00	10.53
18	002182	云海金属	1,209,002.00	10.09
19	603019	中科曙光	1,207,002.90	10.07
20	601601	中国太保	1,156,087.00	9.65
21	002497	雅化集团	1,117,877.00	9.33
22	601186	中国铁建	1,069,947.00	8.93
23	600406	国电南瑞	1,053,616.07	8.79
24	300496	中科创达	1,048,274.00	8.75
25	600837	海通证券	1,046,062.24	8.73
26	600588	用友网络	1,038,885.70	8.67
27	600259	广晟有色	1,025,326.00	8.56
28	002466	天齐锂业	1,017,038.24	8.49
29	600489	中金黄金	982,482.00	8.20
30	300570	太辰光	972,407.00	8.12
31	300073	当升科技	953,865.59	7.96
32	300088	长信科技	951,737.00	7.94
33	000923	河北宣工	946,545.00	7.90
34	601933	永辉超市	943,193.00	7.87
35	002467	二六三	931,766.00	7.78
36	000401	冀东水泥	928,750.96	7.75
37	000970	中科三环	924,418.00	7.72
38	600528	中铁工业	919,146.00	7.67
39	300420	五洋停车	906,823.10	7.57
40	300451	创业慧康	900,675.00	7.52
41	002798	帝欧家居	900,483.90	7.52
42	000672	上峰水泥	879,639.00	7.34
43	000783	长江证券	866,360.62	7.23
44	000938	紫光股份	816,390.56	6.81

45	600031	三一重工	815,413.00	6.81
46	600425	青松建化	812,085.00	6.78
47	600295	鄂尔多斯	810,670.00	6.77
48	002036	联创电子	774,202.00	6.46
49	600532	宏达矿业	753,031.00	6.28
50	002677	浙江美大	729,723.66	6.09
51	300638	广和通	706,799.00	5.90
52	601555	东吴证券	687,665.00	5.74
53	603588	高能环境	680,391.00	5.68
54	600884	杉杉股份	674,503.00	5.63
55	603160	汇顶科技	672,865.00	5.62
56	002237	恒邦股份	669,836.00	5.59
57	600030	中信证券	668,915.82	5.58
58	603505	金石资源	668,405.00	5.58
59	002460	赣锋锂业	667,100.26	5.57
60	600720	祁连山	658,716.00	5.50
61	300531	优博讯	654,487.00	5.46
62	300037	新宙邦	650,094.64	5.43
63	002407	多氟多	642,402.66	5.36
64	300578	会畅通讯	639,248.00	5.34
65	002020	京新药业	637,090.00	5.32
66	002594	比亚迪	627,789.00	5.24
67	300586	美联新材	627,313.00	5.24
68	300170	汉得信息	627,284.00	5.24
69	002511	中顺洁柔	625,776.81	5.22
70	002405	四维图新	622,968.00	5.20
71	000807	云铝股份	598,513.00	5.00
72	601766	中国中车	597,480.00	4.99
73	601636	旗滨集团	587,600.00	4.90
74	600028	中国石化	587,500.00	4.90
75	600536	中国软件	581,931.32	4.86
76	002709	天赐材料	576,481.00	4.81
77	601688	华泰证券	572,662.00	4.78
78	601111	中国国航	571,010.00	4.77
79	300750	宁德时代	570,454.00	4.76
80	603187	海容冷链	565,416.00	4.72
81	600985	淮北矿业	562,572.00	4.70
82	600711	盛屯矿业	557,517.00	4.65

83	000528	柳 工	555,981.00	4.64
84	002384	东山精密	551,643.00	4.60
85	002698	博实股份	546,290.00	4.56
86	600123	兰花科创	545,550.00	4.55
87	002655	共达电声	545,001.00	4.55
88	300252	金信诺	543,476.12	4.54
89	300502	新易盛	542,266.00	4.53
90	600997	开滦股份	540,657.00	4.51
91	300481	濮阳惠成	533,269.00	4.45
92	600643	爱建集团	528,563.00	4.41
93	600740	山西焦化	528,461.00	4.41
94	000983	西山煤电	522,208.00	4.36
95	601969	海南矿业	521,545.00	4.35
96	600115	东方航空	517,720.00	4.32
97	603713	密尔克卫	513,550.00	4.29
98	600000	浦发银行	508,130.00	4.24
99	002600	领益智造	502,329.00	4.19
100	601166	兴业银行	493,100.97	4.12
101	000425	徐工机械	485,425.00	4.05
102	601225	陕西煤业	485,185.00	4.05
103	600456	宝钛股份	484,092.00	4.04
104	002155	湖南黄金	483,860.00	4.04
105	002508	老板电器	482,796.00	4.03
106	300770	新媒股份	473,996.00	3.96
107	300383	光环新网	470,986.00	3.93
108	002241	歌尔股份	462,992.00	3.86
109	300735	光弘科技	455,116.00	3.80
110	600029	南方航空	453,634.00	3.79
111	000629	攀钢钒钛	449,090.00	3.75
112	300624	万兴科技	448,275.00	3.74
113	600970	中材国际	439,200.16	3.67
114	601992	金隅集团	429,960.00	3.59
115	600547	山东黄金	425,166.00	3.55
116	603267	鸿远电子	421,711.00	3.52
117	601699	潞安环能	418,556.00	3.49
118	600111	北方稀土	409,140.00	3.41
119	603636	南威软件	406,356.00	3.39
120	600410	华胜天成	405,611.00	3.39

121	600756	浪潮软件	403,086.00	3.36
122	000001	平安银行	402,919.00	3.36
123	300776	帝尔激光	401,482.00	3.35
124	002051	中工国际	392,016.00	3.27
125	002842	翔鹭钨业	389,986.60	3.25
126	002439	启明星辰	382,583.00	3.19
127	300632	光莆股份	377,507.00	3.15
128	601800	中国交建	374,289.00	3.12
129	300657	弘信电子	367,091.49	3.06
130	002099	海翔药业	362,483.00	3.03
131	601899	紫金矿业	358,800.00	2.99
132	300590	移为通信	358,151.00	2.99
133	600153	建发股份	357,791.29	2.99
134	601390	中国中铁	353,440.00	2.95
135	300200	高盟新材	351,622.00	2.93
136	002436	兴森科技	344,845.00	2.88
137	000750	国海证券	340,730.00	2.84
138	300438	鹏辉能源	338,147.00	2.82
139	300098	高新兴	333,851.10	2.79
140	000655	金岭矿业	331,210.00	2.76
141	300409	道氏技术	324,615.74	2.71
142	002410	广联达	324,207.00	2.71
143	603799	华友钴业	323,469.00	2.70
144	000630	铜陵有色	312,850.00	2.61
145	600141	兴发集团	309,875.00	2.59
146	600801	华新水泥	300,750.00	2.51
147	000789	万年青	300,651.00	2.51
148	600728	佳都科技	282,703.00	2.36
149	300529	健帆生物	282,615.00	2.36
150	300474	景嘉微	280,171.84	2.34
151	002955	鸿合科技	278,576.00	2.33
152	002074	国轩高科	276,806.00	2.31
153	000066	中国长城	276,661.00	2.31
154	002675	东诚药业	274,533.00	2.29
155	601600	中国铝业	274,200.00	2.29
156	002371	北方华创	273,285.00	2.28
157	601857	中国石油	268,800.00	2.24
158	002373	千方科技	266,429.00	2.22

159	000878	云南铜业	265,694.00	2.22
160	002796	世嘉科技	261,254.50	2.18
161	002153	石基信息	258,343.00	2.16
162	002554	惠博普	256,840.00	2.14
163	300146	汤臣倍健	256,584.00	2.14
164	600369	西南证券	255,500.00	2.13
165	601668	中国建筑	255,312.00	2.13
166	300755	华致酒行	253,350.00	2.11
167	000547	航天发展	251,870.00	2.10
168	002635	安洁科技	248,802.00	2.08
169	002777	久远银海	247,065.00	2.06
170	300618	寒锐钴业	241,756.00	2.02
171	600958	东方证券	241,035.00	2.01
172	601003	柳钢股份	239,700.00	2.00

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	143,934,325.47
卖出股票收入（成交）总额	134,174,266.69

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本报告期末本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本报告期末本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

注：本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本报告期末本基金未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本报告期末本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：（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。

7.10.1 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期本基金未投资股指期货

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期本基金未投资国债期货

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：（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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	43,735.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	416.89
5	应收申购款	100.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,252.77

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末本基金前十名股票中未存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中科沃土沃瑞混合发起 A	25	407,841.64	8,003,602.74	78.50%	2,192,438.33	21.50%
中科沃土沃瑞混合发起 C	19	67,253.73	1,000,410.96	78.29%	277,409.86	21.71%
合计	44	260,769.59	9,004,013.70	78.47%	2,469,848.19	21.53%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中科沃土沃瑞混合发起 A	982,610.17	9.6372%
	中科沃土沃瑞混合发起 C	75,577.28	5.9145%
	合计	1,058,187.45	9.2226%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持	中科沃土沃瑞混合发起 A	10~50

有本开放式基金	中科沃土沃瑞混合发起 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中科沃土沃瑞混合发起 A	50~100
	中科沃土沃瑞混合发起 C	0
	合计	50~100

8.4 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	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金管理人高级管理人员	128,756.88	1.12	128,756.88	1.12	3 年
基金经理等人员	804,089.32	7.01	804,089.32	7.01	3 年
基金管理人股东	9,004,013.70	78.47	9,004,013.70	78.47	3 年
其他	69,826.96	0.61	69,826.96	0.61	3 年
合计	10,006,686.86	87.21	10,006,686.86	87.21	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中科沃土沃瑞混 合发起 A	中科沃土沃瑞混 合发起 C
基金合同生效日（2019 年 1 月 14 日）基金份 额总额	8,992,376.24	1,486,436.45
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购 份额	1,264,809.22	200,247.49
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎 回份额	61,144.39	408,863.12
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变 动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,196,041.07	1,277,820.82

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2019 年 4 月 23 日发布公告，胡冬辉女士自 4 月 19 日起担任公司董事长，朱为绎先生自 4 月 19 日起不再担任公司董事长。本基金管理人于 5 月 30 日发布公告，李昱女士自 5 月 28 日起不再担任公司副总经理。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及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、基金托管人及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金
------	------	-----------

	交易单元数量	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	备注
中信建投	2	269,394,126.60	96.87%	197,008.68	96.87%	-
东兴证券	1	8,712,425.56	3.13%	6,371.40	3.13%	-

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。

10.7.2 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
中信建投	-	-	329,100,000.00	92.78%	-	-
东兴证券	-	-	25,600,000.00	7.22%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金基金	上海证券报及基金管理人网站	2019年1月15日

	合同生效公告		
2	中科沃土基金管理有限公司关于旗下基金开通转换业务的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019 年 3 月 26 日
3	中科沃土基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019 年 4 月 1 日
4	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	上海证券报及基金管理人网站	2019 年 4 月 19 日
5	中科沃土基金管理有限公司关于新增泰诚财富为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019 年 4 月 26 日
6	中科沃土基金管理有限公司关于新增汇成基金为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019 年 5 月 16 日
7	中科沃土基金管理有限公司关于新增唐鼎耀华为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019 年 5 月 24 日
8	中科沃土基金管理有限公司关于新增利得基金为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019 年 6 月 4 日
9	中科沃土基金管理有限公司关于新增阳光人寿为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019 年 6 月 6 日
10	中科沃土基金管理有限公司关于新增诺亚正行为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019 年 6 月 12 日
11	中科沃土基金管理有限公司关于新增前海财厚为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019 年 6 月 14 日
12	中科沃土基金管理有限公司关于旗下基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019 年 6 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190114-20190630	-	8,003,602.74	-	8,003,602.74	69.76%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p>							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的文件；
2. 《中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金合同》；
3. 《中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
5. 基金托管人业务资格批件、营业执照；
6. 关于申请募集注册中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金之法律意见书；
7. 中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中科沃土基金管理有限公司

2019年8月26日