

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 2019 年年度报告

2019 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：2020 年 4 月 29 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为基金财务出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2019 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	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	52
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	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
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	72
8.7 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	73

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	73
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	73
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
8.12 投资组合报告附注	73
§9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
份额单位：份	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
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	75
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	75
§10 开放式基金份额变动	76
§11 重大事件揭示	77
11.1 基金份额持有人大会决议	77
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	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
11.4 基金投资策略的改变	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
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	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
11.8 其他重大事件	80
§12 影响投资者决策的其他重要信息	85
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	85
§13 备查文件目录	86
13.1 备查文件目录	86
13.2 存放地点	86
13.3 查阅方式	86

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	中科沃土沃鑫成长混合发起
场内简称	—
基金主代码	003125
前端交易代码	—
后端交易代码	—
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	110,374,506.27 份
基金合同存续期	—
基金份额上市的证券交易所	—
上市日期	—

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	曹萍	郭明
	联系电话	020-37128608	010-66105799
	电子邮箱	caoping@richlandasm.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-018-3610	95588
传真		020-23388997	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-5668	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		广东省广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 21 楼 01 单元自编 06-08 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		510620	100140
法定代表人		程文卫	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中科沃土基金管理有限公司	广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 2107

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	13,741,431.00	-7,780,165.75	6,604,574.09
本期利润	19,611,375.84	-7,654,087.98	6,484,230.68
加权平均基金份额本期利润	0.2287	-0.2188	0.0581
本期加权平均净值利润率	25.45%	-24.03%	5.69%
本期基金份额净值增长率	21.26%	-21.67%	2.81%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	-3,618,938.99	-6,450,431.55	1,275,619.30
期末可供分配基金份额利润	-0.0328	-0.1942	0.0287
期末基金资产净值	107,848,705.14	26,764,158.70	45,651,247.91
期末基金份额净值	0.9771	0.8058	1.0287
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	-2.29%	-19.42%	2.87%

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

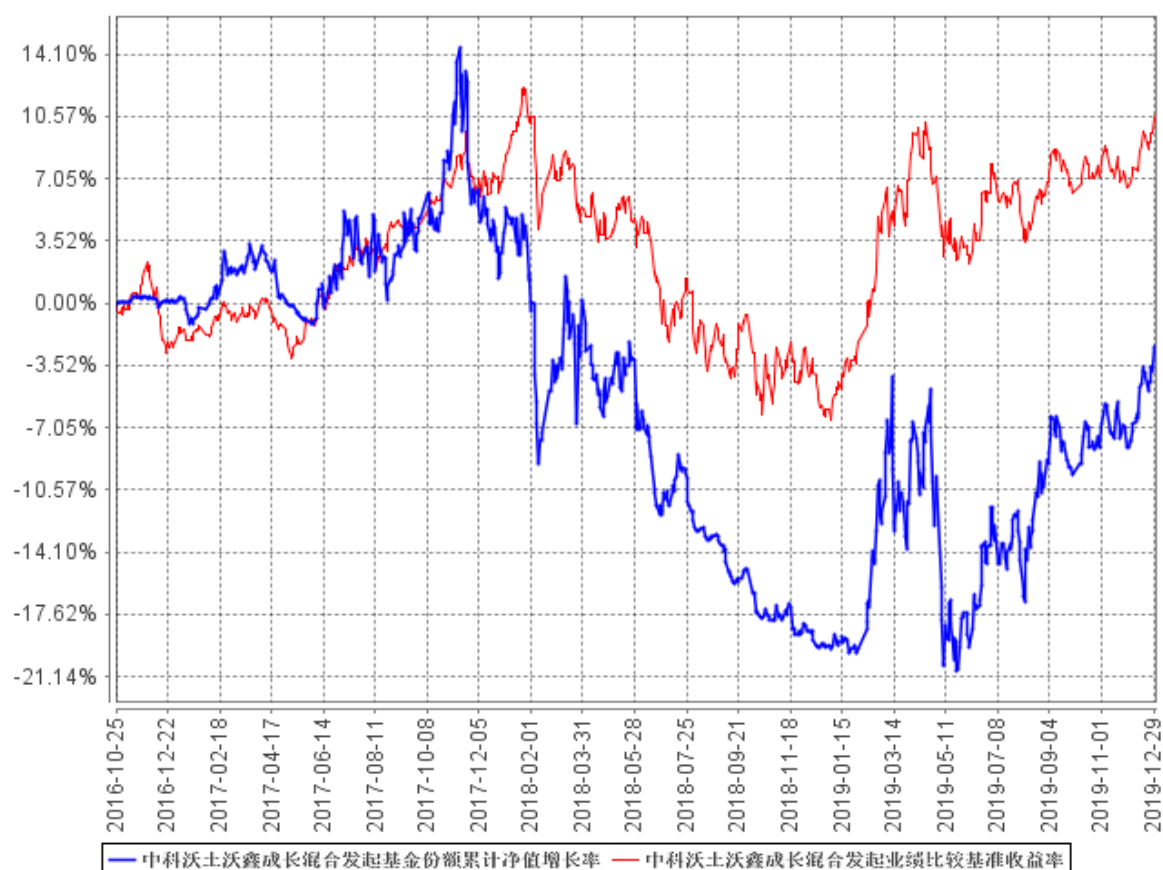
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	8.17%	0.64%	4.00%	0.37%	4.17%	0.27%
过去六个月	13.26%	0.87%	4.08%	0.43%	9.18%	0.44%
过去一年	21.26%	1.33%	18.69%	0.62%	2.57%	0.71%
过去三年	-2.35%	1.04%	13.16%	0.56%	-15.51%	0.48%

自基金合同 生效起至今	-2.29%	1.01%	10.75%	0.55%	-13.04%	0.46%
----------------	--------	-------	--------	-------	---------	-------

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。

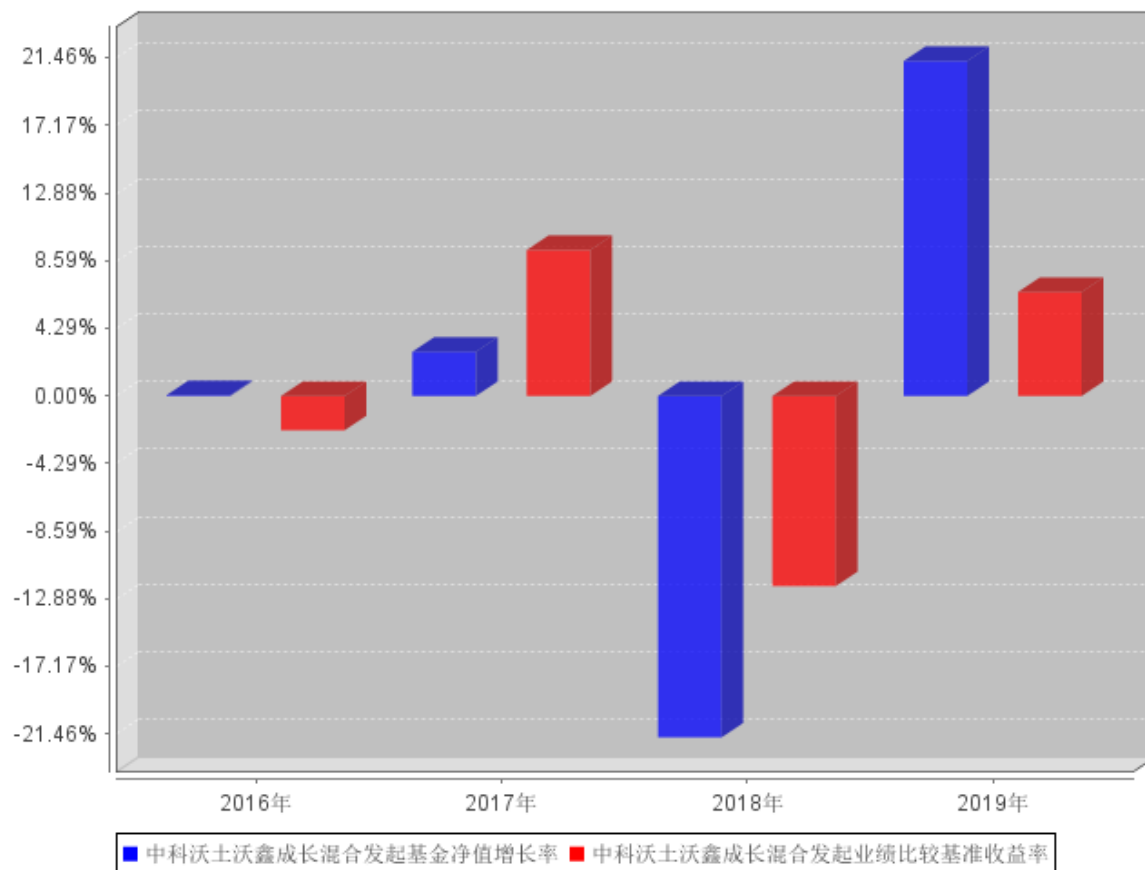
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中科沃土沃鑫成长混合发起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



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

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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中科沃土基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2015]1937 号文批准，于 2015 年 9 月 6 日正式成立，注册资本 1.42 亿元，是国内第 101 家公募基金管理公司，也是一家拥有 PE 背景的公募基金管理公司。中科沃土带着中科招商、粤科金融等主要股东强大的精神基因和优秀的文化基因，始终贯彻“持有人利益至上”的首要经营准则，遵循诚信、规范、稳健的经营方针，崇尚价值投资理念和长期、平稳、盈利的投资风格，致力于为持有人提供专业、精品、创新的投资理财服务，创造成长价值，汇聚阳光财富。截至 2019 年 12 月 31 日，中科沃土旗下共管理 8 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、中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金和中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
乐瑞祺	总经理助理、基金经理	2019 年 5 月 8 日	-	15 年	数量经济学硕士，曾任衡泰软件定量分析师、产品经理，博时基金基金经理助理，民生加银基金基金经理、投资部总监、投委会委员，方圆 360 资产管理有限公司执行总经理、投资经理，第一创业证券资产管理部投资总监，现任中科沃土基金管理有限公司总经理助理、中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金、中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金、中

					科沃土沃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鑫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。
徐伟	基金经理	2019 年 8 月 9 日	—	8 年	工学硕士，曾任宏源证券研究所分析师，中信建投证券研究发展部首席分析师，上海磐信投资有限公司金融市场部高级研究员，中科沃土基金管理有限公司研究部资深研究员，现任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经理。中国国籍，具有基金从业资格。
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	2019 年 5 月 8 日	23 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，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、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安债券型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，李昱的“任职日期”为基金合同生效之日，

乐瑞祺、徐伟的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

2. 乐瑞祺于 2020 年 1 月 7 日离任本基金的基金经理职务。

3. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《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》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的《中科沃土基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合。同时，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析，未发现存在违反公平交易原则的现象。

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。

报告期内，未出现涉及本基金的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。

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

在 2019 年，宏观环境整体处于财政政策，货币政策双宽松状态，政府一方面采取减税降费的财政刺激手段，另一方面在遵守房住不炒的前提下，采取 LPR 贷款定价的方式，定向的对实体经

济进行降息措施。股票市场的上涨绝大部分原因是对于 2018 年市场大幅下跌的一种估值修复。

在 2019 年，尤其是下半年的操作中，我们提高了组合中股票的仓位水平，组合更为均衡，估值更为合理，组合稳定性也得到了较大幅度的提高。我们中长期仍然相对看好权益市场的表现，在接下来的操作中，我们仍将侧重于精选优质公司，摒弃仓位大幅变动的操作，我们希望通过持有权益市场上的优质标的，为投资者创造价值。

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 0.9771 元；本报告期基金份额净值增长率为 21.26%，业绩比较基准收益率为 18.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年，中美贸易战仍有阶段性的缓和，贸易战对全球经济造成的不利影响开始变小，同时全球各主要经济体央行放松货币政策似乎成了一种潮流，在这样的背景下，中国经济面对的外部压力开始变小。2020 年以来，新冠肺炎疫情打乱了国家的政策节奏，目前国家货币政策和财政政策双发力对冲经济下行风险，同时由于新冠肺炎疫情的影响，2020 年的 CPI 数据将较之前预计或发生较大变化，至少，2020 年上半年，中国国内的 CPI 上行压力将会显著减轻。纵观 2020 年，虽然有新冠肺炎疫情的影响，导致国家的政策节奏发生变化，但是中国经济转型升级的决心依然不会发生变化，同时在整体中国长期经济增长率下行的趋势下，中国经济的利率趋势依然长期下行，而且，资本市场在未来中国转型升级中将担任更为重要的角色并将继续获得政策层面的大力扶持，在这种局面下，我们认为整体证券市场下跌空间有限，精选优质公司，分享公司的业绩增长仍然是我们组合的策略核心。2019 年科创板启动，2020 年颁布再融资新政，资本市场支持实体经济的融资功能得以完善，硬核科技类公司将从中受益，有望成为年内股票市场的热点。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规、监管要求的变化和业务发展的实际需要，围绕严守“三条底线”、防控内幕交易等进一步完善公司内部风险控制，强化制度的完善及对制度执行情况的监督检查，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，有效保证了旗下基金运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际，不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，适应公司产品与业务发展的需要，保持公司良好的内

控环境。

(2) 严守合规底线、开展合规风险管理工作是监察稽核工作的重中之重。围绕重点开展对全体员工的合规培训教育及考试，建立了基金经理、投资经理上岗前的合规谈话机制，促进公司合规文化建设；不断完善相关机制流程，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易和市场操纵等违法违规行为，完善利益冲突管理相关制度机制。

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

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

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

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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，本基金本年度未进行利润分配，符合合同规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日以上基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 2019 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

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	普华永道中天审字(2020)第 20933 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	中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了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“中科沃土沃鑫成长混合发起式基金”)的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了中科沃土沃鑫成长混合发起式基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 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鑫成长混合发起式基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	—
管理层和治理层对财务报表的责任	中科沃土沃鑫成长混合发起式基金的基金管理人中科沃土基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和

	维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 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鑫成长混合发起式基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中科沃土沃鑫成长混合发起式基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督中科沃土沃鑫成长混合发起式基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 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： (一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

	(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对中科沃土沃鑫成长混合发起式基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致中科沃土沃鑫成长混合发起式基金不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 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。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛竞	周祎
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2020 年 4 月 10 日	

§ 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：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	5,643,043.80	14,885,406.96
结算备付金		94,586.91	287,550.59
存出保证金		78,815.46	52,952.06
交易性金融资产	7.4.7.2	90,259,001.56	2,141,999.33
其中：股票投资		88,602,289.96	2,141,999.33
基金投资		-	-
债券投资		1,656,711.60	-
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	8,000,000.00	10,000,000.00
应收证券清算款		5,720,187.32	-
应收利息	7.4.7.5	42,709.49	12,937.37
应收股利		-	-
应收申购款		2,355.14	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		109,840,699.68	27,380,846.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 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		-	-
应付赎回款		1,464,980.34	-
应付管理人报酬		142,505.37	34,296.32
应付托管费		23,750.88	5,716.05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	180,687.47	301,675.24
应交税费		0.75	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	180,069.73	275,000.00
负债合计		1,991,994.54	616,687.61
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	110,374,506.27	33,214,590.25
未分配利润	7.4.7.10	-2,525,801.13	-6,450,431.55
所有者权益合计		107,848,705.14	26,764,158.70
负债和所有者权益总计		109,840,699.68	27,380,846.31

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9771 元，基金份额总额 110,374,506.27 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		22,310,573.55	-5,854,200.20
1. 利息收入		181,154.53	175,349.75
其中：存款利息收入	7.4.7.11	95,026.51	118,797.76
债券利息收入		27,685.81	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		58,442.21	56,551.99
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		15,909,849.14	-6,164,367.29
其中：股票投资收益	7.4.7.12	14,391,529.62	-6,304,861.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	237,182.82	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	-
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	1,281,136.70	140,493.90
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,869,944.84	126,077.77
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	349,625.04	8,739.57
减：二、费用		2,699,197.71	1,799,887.78

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,154,802.36	477,553.85
2. 托管费	7.4.10.2.2	192,467.00	79,592.36
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,321,311.22	1,026,315.38
5. 利息支出		3,072.66	-
其中：卖出回购金融资产支出		3,072.66	-
6. 税金及附加		2.02	-
7. 其他费用	7.4.7.20	27,542.45	216,426.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,611,375.84	-7,654,087.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,611,375.84	-7,654,087.98

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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	33,214,590.25	-6,450,431.55	26,764,158.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,611,375.84	19,611,375.84
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）	77,159,916.02	-15,686,745.42	61,473,170.60
其中：1. 基金申购款	210,464,491.62	-25,177,160.13	185,287,331.49
2. 基金赎回款	-133,304,575.60	9,490,414.71	-123,814,160.89
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）	110,374,506.27	-2,525,801.13	107,848,705.14

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	44,375,628.61	1,275,619.30	45,651,247.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,654,087.98	-7,654,087.98
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）	-11,161,038.36	-71,962.87	-11,233,001.23
其中：1. 基金申购款	1,779,008.77	-21,776.38	1,757,232.39
2. 基金赎回款	-12,940,047.13	-50,186.49	-12,990,233.62
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）	33,214,590.25	-6,450,431.55	26,764,158.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

程文卫	程文卫	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”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[2016]第 1561 号《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》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》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 213,695,669.67 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2016)验字第 61247680_G06 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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》于 2016 年 10 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 213,733,032.47 份基金份额，其中认购资金利息折合 37,362.80 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，基金托管人为中国工商银行(以下简称“中国工商银行”)。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 11,080,744.07 基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》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》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中债综合全价(总值)指数收益率×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 2020 年 4 月 10 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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中科沃土沃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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

—

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进

行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：

1. 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；
2. 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；
3. 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；
4. 每一基金份额享有同等分配权；
5. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	5,643,043.80	14,885,406.96
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：	5,643,043.80	14,885,406.96

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	82,843,095.57	88,602,289.96	5,759,194.39

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,654,038.28	1,656,711.60	2,673.32
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,654,038.28	1,656,711.60	2,673.32
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		84,497,133.85	90,259,001.56	5,761,867.71
项目		上年度末 2018 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,250,076.46	2,141,999.33	-108,077.13
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		2,250,076.46	2,141,999.33	-108,077.13

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：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 2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	8,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	8,000,000.00	-
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	10,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	10,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,137.75	3,330.82
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	46.86	142.34
应收债券利息	41,317.56	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-831.62	9,437.92
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	38.94	26.29
合计	42,709.49	12,937.37

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	180,687.47	301,675.24
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	180,687.47	301,675.24

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	69.73	-
预提费用	180,000.00	275,000.00

合计	180,069.73	275,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,214,590.25	33,214,590.25
本期申购	210,464,491.62	210,464,491.62
本期赎回（以“-”号填列）	-133,304,575.60	-133,304,575.60
- 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	110,374,506.27	110,374,506.27

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,708,307.72	-1,742,123.83	-6,450,431.55
本期利润	13,741,431.00	5,869,944.84	19,611,375.84
本期基金份额交易产生的变动数	-12,652,062.27	-3,034,683.15	-15,686,745.42
其中：基金申购款	-19,626,792.18	-5,550,367.95	-25,177,160.13
基金赎回款	6,974,729.91	2,515,684.80	9,490,414.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,618,938.99	1,093,137.86	-2,525,801.13

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	78,922.56	110,502.83
定期存款利息收入	6,045.00	-

其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	8,845.37	6,686.79
其他	1,213.58	1,608.14
合计	95,026.51	118,797.76

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018 年12月31日
卖出股票成交总额	462,442,216.84	393,011,661.68
减：卖出股票成本总额	448,050,687.22	399,316,522.87
买卖股票差价收入	14,391,529.62	-6,304,861.19

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额	39,478,841.38	-
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	38,463,314.59	-
减：应收利息总额	778,343.97	-
买卖债券差价收入	237,182.82	-

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：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 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,281,136.70	140,493.90
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	1,281,136.70	140,493.90

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	5,869,944.84	126,077.77
——股票投资	5,867,271.52	126,077.77
——债券投资	2,673.32	-
——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	5,869,944.84	126,077.77

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	349,625.04	8,723.20
基金转换费收入	-	16.37
合计	349,625.04	8,739.57

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

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

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,321,311.22	1,026,315.38
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,321,311.22	1,026,315.38

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	25,000.00	15,000.00
信息披露费	-	200,000.00
银行汇划费	2,542.45	1,426.19
其他	-	-
合计	27,542.45	216,426.19

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中科沃土基金管理有限公司	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

广东中科科创创业投资管理有限责任公司	基金管理人的股东、基金发起人
广东省粤科金融集团有限公司	基金管理人的股东、基金发起人
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、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
珠海横琴西拓投资合伙企业(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
中科招商投资管理集团股份有限公司	基金管理人股东的控股股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

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

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：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	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,154,802.36	477,553.85

其中：支付销售机构的客户维护费	249,642.49	206,568.37
-----------------	------------	------------

注：支付基金管理人中科沃土基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	192,467.00	79,592.36

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 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 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	4,975,124.38
期初持有的基金份额	4,975,124.38	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	4.51%	14.98%

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。

7.4.10.4.2 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 12 月 31 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例
广东中科科创创业投资管理有限责任公司	2,976,293.76	2.70%	2,976,293.76	8.96%
广东省粤科金融集团有限公司	1,000,000.00	0.91%	1,000,000.00	3.01%
广东中广投资管理有限公司	197,642.23	0.18%	197,642.23	0.60%

7.4.10.5 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 1 日至 2019 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	5,643,043.80	78,922.56	14,885,406.96	110,502.83

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，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688181	八亿时空	2019年12月27日	2020年1月6日	新股未上市	43.98	43.98	1,076	47,322.48	47,322.48	-
688081	兴图新科	2019年12月26日	2020年1月6日	新股未上市	28.21	28.21	1,472	41,525.12	41,525.12	-
002466	天齐锂业	2019年12月26日	2020年1月3日	配股未上市	8.75	30.18	468	4,095.00	14,124.24	-
002973	侨银环保	2019年12月27日	2020年1月6日	新股未上市	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
688066	航天宏图	2019年7月16日	2020年1月21日	科创板锁定	17.25	37.17	14,033	242,069.25	521,606.61	-
688089	嘉必优	2019年12月12日	2020年6月18日	科创板锁定	23.90	31.67	3,050	72,895.00	96,593.50	-
688218	江苏北人	2019年11月29日	2020年6月10日	科创板锁定	17.36	23.48	5,790	100,514.40	135,949.20	-
688310	迈得医疗	2019年11月22日	2020年6月2日	科创板锁定	24.79	27.12	3,276	81,212.04	88,845.12	-
688363	华熙生物	2019年10月28日	2020年5月5日	科创板锁定	47.79	72.00	6,370	304,422.30	458,640.00	-
688058	宝兰德	2019年10月25日	2020年4月30日	科创板锁定	79.30	90.65	1,450	114,985.00	131,442.50	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113029	明阳转债	2019年12月18日	2020年1月7日	新债未上市	100.00	100.00	480	48,000.00	48,000.00	-
128085	鸿达转债	2019年12月18日	2020年1月	新债未上市	100.00	100.00	300	30,000.00	30,000.00	-

		日	8 日							
128084	木森 转债	2019 年 12 月 18 日	2020 年 1 月 10 日	新债未 上市	100.00	100.00	230	23,000.00	23,000.00	-
128086	国轩 转债	2019 年 12 月 19 日	2020 年 1 月 10 日	新债未 上市	100.00	100.00	180	18,000.00	18,000.00	-
110065	淮矿 转债	2019 年 12 月 25 日	2020 年 1 月 13 日	新债未 上市	100.00	100.00	170	17,000.00	17,000.00	-
113030	东风 转债	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 20 日	新债未 上市	100.00	100.00	100	10,000.00	10,000.00	-

注：1. 基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2. 基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

4. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日

至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 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	期末估值单价	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
603799	华友钴业	2019 年 12 月 31 日	重要事项未公告	39.39	2020 年 1 月 2 日	40.43	1,449	37,372.23	57,076.11	-

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债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券款余额。

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、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，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

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

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中国工商银行，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。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.14% (2018 年 12 月 31 日：无)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无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

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	17,000.00	—

AAA 以下	129,000.00	—
未评级	1,510,711.60	—
合计	1,656,711.60	—

注：未评级部分为政策性金融债。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无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

注：本基金本报告期末及上年度末无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 2019 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 1.61%。

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,643,043.80	-	-	-	5,643,043.80
结算备付金	94,586.91	-	-	-	94,586.91
存出保证金	78,815.46	-	-	-	78,815.46
交易性金融资产	1,510,711.60	-	146,000.00	88,602,289.96	90,259,001.56
买入返售金融资产	8,000,000.00	-	-	-	8,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	5,720,187.32	5,720,187.32
应收利息	-	-	-	42,709.49	42,709.49
应收申购款	-	-	-	2,355.14	2,355.14
资产总计	15,327,157.77	-	146,000.00	94,367,541.91	109,840,699.68
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,464,980.34	1,464,980.34
应付管理人报酬	-	-	-	142,505.37	142,505.37
应付托管费	-	-	-	23,750.88	23,750.88
应付交易费用	-	-	-	180,687.47	180,687.47
应交税费	-	-	-	0.75	0.75
其他负债	-	-	-	180,069.73	180,069.73
负债总计	-	-	-	1,991,994.54	1,991,994.54
利率敏感度缺口	15,327,157.77	-	146,000.00	92,375,547.37	107,848,705.14
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2018 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	14,885,406.96	-	-	-	14,885,406.96
结算备付金	287,550.59	-	-	-	287,550.59
存出保证金	52,952.06	-	-	-	52,952.06
交易性金融资产	-	-	-	2,141,999.33	2,141,999.33
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
应收利息	-	-	-	12,937.37	12,937.37
资产总计	25,225,909.61	-	-	2,154,936.70	27,380,846.31
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	34,296.32	34,296.32
应付托管费	-	-	-	5,716.05	5,716.05
应付交易费用	-	-	-	301,675.24	301,675.24
其他负债	-	-	-	275,000.00	275,000.00
负债总计	-	-	-	616,687.61	616,687.61
利率敏感度缺口	25,225,909.61	-	-	1,538,249.09	26,764,158.70

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

注：于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.54%(2018 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金

管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	88,602,289.96	82.15	2,141,999.33	8.00
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	88,602,289.96	82.15	2,141,999.33	8.00

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	5,104,486.24	481,107.78
	2. 业绩比较基准下降 5%	-5,104,486.24	-481,107.78

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 87,002,587.04 元，属于第二层次的余额为 3,256,414.52 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 2,141,999.33 元，无第二或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	88,602,289.96	80.66
	其中：股票	88,602,289.96	80.66
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,656,711.60	1.51
	其中：债券	1,656,711.60	1.51
	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	8,000,000.00	7.28
	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	5,737,630.71	5.22
8	其他各项资产	5,844,067.41	5.32
9	合计	109,840,699.68	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	464,819.53	0.43
B	采矿业	2,774,132.53	2.57
C	制造业	30,120,304.03	27.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	643,732.19	0.60
E	建筑业	3,220,539.94	2.99
F	批发和零售业	337,488.33	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	1,569,691.54	1.46
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,988,522.28	1.84
J	金融业	40,225,236.52	37.30
K	房地产业	5,493,600.29	5.09

L	租赁和商务服务业	1,227,735.92	1.14
M	科学研究和技术服务业	153,564.04	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	38,969.24	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	189,672.41	0.18
R	文化、体育和娱乐业	154,281.17	0.14
S	综合	-	-
	合计	88,602,289.96	82.15

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本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	占基金资产净值比例（%）
1	601628	中国人寿	185,937	6,483,623.19	6.01
2	601318	中国平安	56,331	4,814,047.26	4.46
3	600036	招商银行	124,838	4,691,412.04	4.35
4	601166	兴业银行	186,697	3,696,600.60	3.43
5	600585	海螺水泥	66,181	3,626,718.80	3.36
6	600276	恒瑞医药	36,329	3,179,514.08	2.95
7	600030	中信证券	120,067	3,037,695.10	2.82
8	600048	保利地产	168,859	2,732,138.62	2.53
9	600519	贵州茅台	2,288	2,706,704.00	2.51
10	601601	中国太保	66,352	2,510,759.68	2.33
11	600887	伊利股份	72,059	2,229,505.46	2.07
12	600031	三一重工	117,956	2,011,149.80	1.86
13	601328	交通银行	321,234	1,808,547.42	1.68
14	600837	海通证券	110,862	1,713,926.52	1.59
15	601288	农业银行	447,034	1,649,555.46	1.53
16	600000	浦发银行	122,475	1,515,015.75	1.40
17	601668	中国建筑	224,825	1,263,516.50	1.17
18	601211	国泰君安	66,985	1,238,552.65	1.15
19	601186	中国铁建	121,260	1,229,576.40	1.14
20	600340	华夏幸福	40,102	1,150,927.40	1.07

21	601688	华泰证券	55,937	1,136,080.47	1.05
22	601888	中国国旅	11,597	1,031,553.15	0.96
23	600309	万华化学	18,303	1,028,079.51	0.95
24	000002	万科A	30,639	985,963.02	0.91
25	600104	上汽集团	41,290	984,766.50	0.91
26	601988	中国银行	246,680	910,249.20	0.84
27	000651	格力电器	13,299	872,148.42	0.81
28	601939	建设银行	117,716	851,086.68	0.79
29	600690	海尔智家	42,981	838,129.50	0.78
30	601818	光大银行	184,577	813,984.57	0.75
31	601766	中国中车	113,867	813,010.38	0.75
32	601012	隆基股份	30,629	760,518.07	0.71
33	600009	上海机场	9,135	719,381.25	0.67
34	600703	三安光电	37,569	689,766.84	0.64
35	000333	美的集团	11,311	658,865.75	0.61
36	600028	中国石化	127,943	653,788.73	0.61
37	000858	五粮液	4,466	594,022.66	0.55
38	601088	中国神华	31,794	580,240.50	0.54
39	600050	中国联通	88,573	521,694.97	0.48
40	688066	航天宏图	14,033	521,606.61	0.48
41	601336	新华保险	9,692	476,361.80	0.44
42	688363	华熙生物	6,370	458,640.00	0.43
43	601138	工业富联	25,076	458,138.52	0.42
44	601989	中国重工	87,226	457,064.24	0.42
45	601390	中国中铁	75,782	450,145.08	0.42
46	601857	中国石油	75,743	441,581.69	0.41
47	601236	红塔证券	25,000	419,250.00	0.39
48	600547	山东黄金	11,347	370,139.14	0.34
49	603993	洛阳钼业	82,400	359,264.00	0.33
50	601111	中国国航	34,243	331,814.67	0.31
51	600196	复星医药	11,826	314,571.60	0.29
52	300498	温氏股份	8,636	290,169.60	0.27
53	600900	长江电力	15,287	280,975.06	0.26
54	002415	海康威视	8,438	276,260.12	0.26
55	002475	立讯精密	7,047	257,215.50	0.24
56	300274	阳光电源	24,400	256,932.00	0.24
57	000725	京东方A	53,673	243,675.42	0.23
58	000001	平安银行	12,500	205,625.00	0.19
59	603288	海天味业	1,848	198,678.48	0.18

60	300059	东方财富	12,134	191,353.18	0.18
61	000063	中兴通讯	5,357	189,584.23	0.18
62	002714	牧原股份	1,967	174,649.93	0.16
63	000338	潍柴动力	10,807	171,615.16	0.16
64	688123	聚辰股份	2,316	166,010.88	0.15
65	002736	国信证券	12,547	157,464.85	0.15
66	601066	中信建投	5,166	157,046.40	0.15
67	603259	药明康德	1,667	153,564.04	0.14
68	000568	泸州老窖	1,754	152,036.72	0.14
69	002304	洋河股份	1,329	146,854.50	0.14
70	002027	分众传媒	22,798	142,715.48	0.13
71	688218	江苏北人	5,790	135,949.20	0.13
72	601899	紫金矿业	29,483	135,326.97	0.13
73	688058	宝兰德	1,450	131,442.50	0.12
74	000661	长春高新	288	128,736.00	0.12
75	601009	南京银行	13,757	120,648.89	0.11
76	600999	招商证券	6,442	117,824.18	0.11
77	002230	科大讯飞	3,367	116,094.16	0.11
78	600919	江苏银行	15,726	113,856.24	0.11
79	600570	恒生电子	1,457	113,252.61	0.11
80	300015	爱尔眼科	2,852	112,825.12	0.10
81	601006	大秦铁路	13,401	110,022.21	0.10
82	001979	招商蛇口	5,501	109,304.87	0.10
83	000100	TCL 集团	24,358	108,880.26	0.10
84	600015	华夏银行	14,004	107,410.68	0.10
85	000166	申万宏源	20,316	104,017.92	0.10
86	000538	云南白药	1,159	103,649.37	0.10
87	000876	新 希 望	5,011	99,969.45	0.09
88	002594	比亚迪	2,027	96,627.09	0.09
89	688089	嘉必优	3,050	96,593.50	0.09
90	601319	中国人保	12,347	93,713.73	0.09
91	600383	金地集团	6,408	92,916.00	0.09
92	600741	华域汽车	3,544	92,108.56	0.09
93	688310	迈得医疗	3,276	88,845.12	0.08
94	600406	国电南瑞	4,168	88,278.24	0.08
95	300142	沃森生物	2,718	88,171.92	0.08
96	600958	东方证券	7,992	85,993.92	0.08
97	600352	浙江龙盛	5,897	85,329.59	0.08
98	002024	苏宁易购	8,401	84,934.11	0.08

99	603986	兆易创新	413	84,619.57	0.08
100	002241	歌尔股份	4,224	84,142.08	0.08
101	300003	乐普医疗	2,494	82,501.52	0.08
102	601225	陕西煤业	9,150	82,258.50	0.08
103	000157	中联重科	12,267	81,943.56	0.08
104	002236	大华股份	4,067	80,851.96	0.07
105	601155	新城控股	2,067	80,034.24	0.07
106	601901	方正证券	9,224	79,972.08	0.07
107	600588	用友网络	2,785	79,094.00	0.07
108	002202	金风科技	6,579	78,619.05	0.07
109	002044	美年健康	5,161	76,847.29	0.07
110	600660	福耀玻璃	3,193	76,600.07	0.07
111	002008	大族激光	1,910	76,400.00	0.07
112	600436	片仔癀	691	75,920.17	0.07
113	601669	中国电建	17,298	75,073.32	0.07
114	601377	兴业证券	10,475	74,163.00	0.07
115	300136	信维通信	1,625	73,742.50	0.07
116	000069	华侨城 A	9,455	73,654.45	0.07
117	600886	国投电力	7,848	72,044.64	0.07
118	300124	汇川技术	2,256	69,123.84	0.06
119	002007	华兰生物	1,917	67,382.55	0.06
120	002001	新 和 成	2,895	67,337.70	0.06
121	601933	永辉超市	8,777	66,178.58	0.06
122	000895	双汇发展	2,205	64,011.15	0.06
123	002311	海大集团	1,778	64,008.00	0.06
124	601108	财通证券	5,635	63,900.90	0.06
125	002456	欧菲光	4,089	63,788.40	0.06
126	002460	赣锋锂业	1,798	62,624.34	0.06
127	002555	三七互娱	2,312	62,262.16	0.06
128	600795	国电电力	26,549	62,124.66	0.06
129	000783	长江证券	8,651	61,768.14	0.06
130	002466	天齐锂业	2,027	61,174.86	0.06
131	000425	徐工机械	10,815	59,158.05	0.05
132	600705	中航资本	12,146	58,908.10	0.05
133	600115	东方航空	10,056	58,425.36	0.05
134	600061	国投资本	3,843	58,183.02	0.05
135	601788	光大证券	4,408	57,744.80	0.05
136	600271	航天信息	2,491	57,716.47	0.05
137	600438	通威股份	4,388	57,614.44	0.05

138	600606	绿地控股	8,289	57,608.55	0.05
139	603799	华友钴业	1,449	57,076.11	0.05
140	600089	特变电工	8,393	55,813.45	0.05
141	600011	华能国际	9,976	55,666.08	0.05
142	600177	雅戈尔	7,901	55,069.97	0.05
143	002271	东方雨虹	2,088	54,935.28	0.05
144	600010	宝钢股份	41,452	54,716.64	0.05
145	002050	三花智控	3,131	54,260.23	0.05
146	601555	东吴证券	5,397	53,916.03	0.05
147	600111	北方稀土	4,940	53,549.60	0.05
148	601985	中国核电	10,623	53,115.00	0.05
149	601877	正泰电器	1,973	52,876.40	0.05
150	600176	中国巨石	4,827	52,614.30	0.05
151	601600	中国铝业	14,811	52,430.94	0.05
152	600809	山西汾酒	579	51,936.30	0.05
153	002410	广联达	1,527	51,887.46	0.05
154	300122	智飞生物	1,035	51,398.10	0.05
155	002624	完美世界	1,163	51,334.82	0.05
156	000768	中航飞机	3,119	51,089.22	0.05
157	600109	国金证券	5,454	50,722.20	0.05
158	300033	同花顺	461	50,299.71	0.05
159	002352	顺丰控股	1,340	49,834.60	0.05
160	300408	三环集团	2,231	49,706.68	0.05
161	000786	北新建材	1,913	48,685.85	0.05
162	000963	华东医药	1,991	48,540.58	0.05
163	300144	宋城演艺	1,566	48,405.06	0.04
164	600487	亨通光电	2,965	48,210.90	0.04
165	601607	上海医药	2,621	48,147.77	0.04
166	603019	中科曙光	1,384	47,858.72	0.04
167	688181	八亿时空	1,076	47,322.48	0.04
168	600100	同方股份	5,391	47,279.07	0.04
169	002422	科伦药业	1,992	46,792.08	0.04
170	600522	中天科技	5,637	46,787.10	0.04
171	000961	中南建设	4,362	46,019.10	0.04
172	002602	世纪华通	3,992	45,628.56	0.04
173	601618	中国中冶	16,187	45,323.60	0.04
174	000625	长安汽车	4,497	45,104.91	0.04
175	600332	白云山	1,265	45,046.65	0.04
176	601919	中远海控	8,499	44,789.73	0.04

177	600498	烽火通信	1,630	44,743.50	0.04
178	600516	方大炭素	3,678	44,724.48	0.04
179	600221	海航控股	25,848	44,717.04	0.04
180	600893	航发动力	2,022	43,836.96	0.04
181	600637	东方明珠	4,637	43,402.32	0.04
182	002065	东华软件	4,176	43,096.32	0.04
183	002179	中航光电	1,098	42,887.88	0.04
184	600926	杭州银行	4,682	42,887.12	0.04
185	601997	贵阳银行	4,450	42,542.00	0.04
186	000728	国元证券	4,585	42,502.95	0.04
187	600018	上港集团	7,344	42,374.88	0.04
188	600066	宇通客车	2,966	42,265.50	0.04
189	600068	葛洲坝	6,319	42,210.92	0.04
190	300017	网宿科技	4,428	42,198.84	0.04
191	000413	东旭光电	12,457	41,855.52	0.04
192	688081	兴图新科	1,472	41,525.12	0.04
193	600004	白云机场	2,376	41,461.20	0.04
194	601198	东兴证券	3,067	40,300.38	0.04
195	600362	江西铜业	2,368	40,090.24	0.04
196	002146	荣盛发展	4,062	39,929.46	0.04
197	601727	上海电气	7,951	39,595.98	0.04
198	600674	川投能源	3,981	39,212.85	0.04
199	002673	西部证券	3,964	38,847.20	0.04
200	000656	金科股份	5,025	38,592.00	0.04
201	600346	恒力石化	2,395	38,511.60	0.04
202	600583	海油工程	5,118	37,770.84	0.04
203	002508	老板电器	1,116	37,731.96	0.03
204	601838	成都银行	4,114	37,313.98	0.03
205	601021	春秋航空	844	37,043.16	0.03
206	600208	新湖中宝	9,780	36,968.40	0.03
207	000423	东阿阿胶	1,043	36,890.91	0.03
208	600023	浙能电力	9,206	36,455.76	0.03
209	600219	南山铝业	16,128	36,126.72	0.03
210	603160	汇顶科技	172	35,483.60	0.03
211	600170	上海建工	9,962	35,265.48	0.03
212	002493	荣盛石化	2,836	35,138.04	0.03
213	000703	恒逸石化	2,516	35,022.72	0.03
214	300024	机器人	2,484	34,776.00	0.03
215	600867	通化东宝	2,746	34,736.90	0.03

216	600085	同仁堂	1,210	34,097.80	0.03
217	601018	宁波港	8,905	33,839.00	0.03
218	000630	铜陵有色	14,370	33,482.10	0.03
219	603833	欧派家居	286	33,462.00	0.03
220	601881	中国银河	2,871	33,332.31	0.03
221	600489	中金黄金	3,902	33,088.96	0.03
222	601878	浙商证券	2,955	32,889.15	0.03
223	600369	西南证券	6,322	32,811.18	0.03
224	002081	金螳螂	3,684	32,492.88	0.03
225	300070	碧水源	4,262	32,391.20	0.03
226	600535	天士力	2,091	32,243.22	0.03
227	600398	海澜之家	4,133	31,741.44	0.03
228	002739	万达电影	1,747	31,708.05	0.03
229	000627	天茂集团	4,498	31,665.92	0.03
230	600482	中国动力	1,573	31,460.00	0.03
231	000596	古井贡酒	230	31,261.60	0.03
232	300296	利亚德	3,961	30,380.87	0.03
233	600038	中直股份	629	30,009.59	0.03
234	600760	中航沈飞	925	29,230.00	0.03
235	600118	中国卫星	1,336	28,550.32	0.03
236	300413	芒果超媒	813	28,422.48	0.03
237	000629	攀钢钒钛	9,724	28,394.08	0.03
238	601117	中国化学	4,404	28,361.76	0.03
239	601992	金隅集团	7,600	28,348.00	0.03
240	600153	建发股份	3,119	28,039.81	0.03
241	600663	陆家嘴	2,030	27,425.30	0.03
242	002153	石基信息	691	26,949.00	0.02
243	600027	华电国际	7,310	26,827.70	0.02
244	603156	养元饮品	922	26,765.66	0.02
245	002032	苏泊尔	345	26,489.10	0.02
246	603858	步长制药	1,275	26,290.50	0.02
247	601808	中海油服	1,352	25,958.40	0.02
248	300433	蓝思科技	1,838	25,401.16	0.02
249	002938	鹏鼎控股	565	25,368.50	0.02
250	000709	河钢股份	9,612	24,798.96	0.02
251	601238	广汽集团	2,100	24,549.00	0.02
252	601633	长城汽车	2,736	24,213.60	0.02
253	601216	君正集团	7,647	23,935.11	0.02
254	600977	中国电影	1,569	23,880.18	0.02

255	600415	小商品城	6,066	23,475.42	0.02
256	600297	广汇汽车	7,193	23,449.18	0.02
257	000402	金 融 街	2,724	22,118.88	0.02
258	300251	光线传媒	1,853	21,865.40	0.02
259	600816	安信信托	4,896	21,738.24	0.02
260	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.02
261	600188	兖州煤业	2,031	21,447.36	0.02
262	002601	龙鳞佰利	1,392	21,422.88	0.02
263	002773	康弘药业	576	21,294.72	0.02
264	002120	韵达股份	632	21,045.60	0.02
265	601898	中煤能源	4,073	20,446.46	0.02
266	600704	物产中大	3,861	20,270.25	0.02
267	002010	传化智联	2,896	20,214.08	0.02
268	000938	紫光股份	638	20,160.80	0.02
269	600688	上海石化	5,003	19,361.61	0.02
270	002310	东方园林	3,700	18,574.00	0.02
271	600566	济川药业	768	18,570.24	0.02
272	002294	信立泰	923	18,404.62	0.02
273	000898	鞍钢股份	5,447	18,247.45	0.02
274	600998	九州通	1,267	17,928.05	0.02
275	600372	中航电子	1,217	17,330.08	0.02
276	600025	华能水电	4,102	17,310.44	0.02
277	300072	三聚环保	2,605	16,463.60	0.02
278	601228	广州港	4,234	16,216.22	0.02
279	600339	中油工程	3,782	12,820.98	0.01
280	002925	盈趣科技	289	12,701.55	0.01
281	603109	神驰机电	466	12,335.02	0.01
282	600390	五矿资本	1,421	11,737.46	0.01
283	600233	圆通速递	877	11,094.05	0.01
284	000553	安道麦 A	1,058	10,580.00	0.01
285	002939	长城证券	752	10,422.72	0.01
286	603260	合盛硅业	345	10,167.15	0.01
287	601828	美凯龙	863	9,777.79	0.01
288	601162	天风证券	1,181	8,692.16	0.01
289	002945	华林证券	575	8,590.50	0.01
290	601577	长沙银行	880	7,981.60	0.01
291	600299	安迪苏	708	7,830.48	0.01
292	601298	青岛港	1,111	7,632.57	0.01
293	601212	白银有色	1,988	7,315.84	0.01

294	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.01
295	600733	北汽蓝谷	906	5,291.04	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	601318	中国平安	23,660,434.00	88.40
2	600519	贵州茅台	20,292,175.98	75.82
3	600036	招商银行	18,166,411.11	67.88
4	601628	中国人寿	15,323,095.14	57.25
5	601601	中国太保	11,964,626.00	44.70
6	601166	兴业银行	9,571,790.00	35.76
7	601288	农业银行	8,726,472.00	32.61
8	600276	恒瑞医药	8,150,309.00	30.45
9	600585	海螺水泥	7,385,021.84	27.59
10	600887	伊利股份	7,305,233.87	27.29
11	600030	中信证券	7,197,342.56	26.89
12	601328	交通银行	7,011,316.00	26.20
13	600000	浦发银行	6,838,995.00	25.55
14	000858	五粮液	6,354,964.99	23.74
15	300498	温氏股份	6,145,333.00	22.96
16	600309	万华化学	5,964,680.00	22.29
17	601688	华泰证券	5,917,353.00	22.11
18	601939	建设银行	5,823,122.00	21.76
19	002157	正邦科技	5,808,897.00	21.70
20	600048	保利地产	5,714,088.00	21.35
21	600009	上海机场	5,632,632.00	21.05
22	000568	泸州老窖	5,077,698.00	18.97
23	002124	天邦股份	4,987,450.50	18.63
24	601888	中国国旅	4,980,639.48	18.61
25	002714	牧原股份	4,870,371.50	18.20
26	000651	格力电器	4,808,485.00	17.97

27	600031	三一重工	4,742,411.00	17.72
28	601668	中国建筑	4,663,895.00	17.43
29	002792	通宇通讯	4,657,815.00	17.40
30	002567	唐人神	4,150,307.50	15.51
31	601766	中国中车	3,991,023.00	14.91
32	300136	信维通信	3,936,091.00	14.71
33	601211	国泰君安	3,784,453.00	14.14
34	600809	山西汾酒	3,702,882.00	13.84
35	600570	恒生电子	3,588,386.00	13.41
36	600340	华夏幸福	3,549,766.00	13.26
37	600104	上汽集团	3,548,759.00	13.26
38	002463	沪电股份	3,509,708.00	13.11
39	600837	海通证券	3,394,035.00	12.68
40	600801	华新水泥	3,389,375.00	12.66
41	601988	中国银行	3,361,748.00	12.56
42	300134	大富科技	3,309,773.00	12.37
43	300450	先导智能	3,279,052.60	12.25
44	002796	世嘉科技	3,257,319.00	12.17
45	002736	国信证券	3,234,319.00	12.08
46	601066	中信建投	3,157,042.43	11.80
47	601818	光大银行	3,045,725.00	11.38
48	600703	三安光电	2,872,849.00	10.73
49	002475	立讯精密	2,848,767.00	10.64
50	300122	智飞生物	2,721,812.76	10.17
51	601229	上海银行	2,707,280.88	10.12
52	002384	东山精密	2,698,661.86	10.08
53	600728	佳都科技	2,641,381.00	9.87
54	002100	天康生物	2,605,520.00	9.74
55	002230	科大讯飞	2,580,595.00	9.64
56	000002	万科A	2,563,315.20	9.58
57	000333	美的集团	2,562,069.00	9.57
58	600690	海尔智家	2,550,577.86	9.53
59	300166	东方国信	2,493,721.00	9.32
60	601998	中信银行	2,474,798.00	9.25
61	600016	民生银行	2,390,044.00	8.93
62	002241	歌尔股份	2,358,416.00	8.81

63	000001	平安银行	2,340,632.00	8.75
64	688111	金山办公	2,290,761.74	8.56
65	600028	中国石化	2,264,883.00	8.46
66	300322	硕贝德	2,231,745.00	8.34
67	603027	千禾味业	2,192,277.46	8.19
68	002458	益生股份	2,094,694.00	7.83
69	601989	中国重工	2,024,409.00	7.56
70	002841	视源股份	1,986,033.00	7.42
71	601012	隆基股份	1,980,074.00	7.40
72	600004	白云机场	1,955,016.00	7.30
73	600588	用友网络	1,929,649.40	7.21
74	002234	民和股份	1,912,676.00	7.15
75	603288	海天味业	1,912,411.00	7.15
76	601088	中国神华	1,869,191.00	6.98
77	600019	宝钢股份	1,859,372.00	6.95
78	002456	欧菲光	1,835,016.00	6.86
79	600845	宝信软件	1,784,281.50	6.67
80	603019	中科曙光	1,783,136.00	6.66
81	600050	中国联通	1,779,971.00	6.65
82	000876	新希望	1,765,496.00	6.60
83	300059	东方财富	1,742,328.00	6.51
84	002925	盈趣科技	1,731,929.00	6.47
85	300394	天孚通信	1,693,567.80	6.33
86	300373	扬杰科技	1,634,950.00	6.11
87	300457	赢合科技	1,603,885.00	5.99
88	601186	中国铁建	1,564,594.59	5.85
89	600486	扬农化工	1,535,651.72	5.74
90	300623	捷捷微电	1,518,164.60	5.67
91	600580	卧龙电驱	1,515,740.00	5.66
92	600498	烽火通信	1,510,965.00	5.65
93	601390	中国中铁	1,467,295.00	5.48
94	601901	方正证券	1,458,955.00	5.45
95	300323	华灿光电	1,442,937.23	5.39
96	600491	龙元建设	1,439,554.00	5.38
97	600547	山东黄金	1,395,248.00	5.21
98	601336	新华保险	1,384,754.00	5.17

99	002185	华天科技	1,354,700.00	5.06
100	300348	长亮科技	1,352,875.00	5.05
101	002191	劲嘉股份	1,319,650.00	4.93
102	600029	南方航空	1,310,656.00	4.90
103	002304	洋河股份	1,272,882.00	4.76
104	300550	和仁科技	1,269,599.00	4.74
105	002371	北方华创	1,250,487.00	4.67
106	600855	航天长峰	1,220,087.00	4.56
107	300408	三环集团	1,211,565.00	4.53
108	600999	招商证券	1,205,402.00	4.50
109	601857	中国石油	1,188,776.00	4.44
110	002142	宁波银行	1,188,500.00	4.44
111	002366	台海核电	1,162,104.00	4.34
112	000603	盛达资源	1,159,228.19	4.33
113	600325	华发股份	1,144,061.00	4.27
114	000596	古井贡酒	1,140,623.00	4.26
115	000975	银泰黄金	1,126,109.00	4.21
116	601169	北京银行	1,122,895.00	4.20
117	600456	宝钛股份	1,121,795.96	4.19
118	300607	拓斯达	1,100,186.00	4.11
119	300001	特锐德	1,043,141.00	3.90
120	603305	旭升股份	1,040,379.00	3.89
121	000426	兴业矿业	1,036,383.00	3.87
122	601006	大秦铁路	1,027,703.00	3.84
123	002202	金风科技	1,020,633.00	3.81
124	002916	深南电路	1,004,400.00	3.75
125	000100	TCL 集团	1,002,800.00	3.75
126	000860	顺鑫农业	986,892.00	3.69
127	600884	杉杉股份	974,822.00	3.64
128	300566	激智科技	969,787.75	3.62
129	002385	大北农	940,827.00	3.52
130	601138	工业富联	938,139.00	3.51
131	002439	启明星辰	927,374.00	3.46
132	300274	阳光电源	927,291.00	3.46
133	002050	三花智控	917,963.00	3.43
134	002281	光迅科技	916,573.27	3.42

135	000425	徐工机械	912,053.00	3.41
136	000601	韶能股份	904,572.00	3.38
137	300142	沃森生物	882,285.00	3.30
138	000063	中兴通讯	880,674.00	3.29
139	603369	今世缘	877,547.00	3.28
140	002407	多氟多	868,233.00	3.24
141	603517	绝味食品	863,872.00	3.23
142	002698	博实股份	854,716.00	3.19
143	300735	光弘科技	850,410.00	3.18
144	002508	老板电器	839,220.00	3.14
145	300601	康泰生物	834,766.03	3.12
146	300570	太辰光	820,869.00	3.07
147	603363	傲农生物	819,000.00	3.06
148	002557	洽洽食品	816,267.00	3.05
149	300604	长川科技	808,515.00	3.02
150	600584	长电科技	803,000.00	3.00
151	603659	璞泰来	801,474.00	2.99
152	600549	厦门钨业	789,880.00	2.95
153	300672	国科微	789,584.00	2.95
154	002851	麦格米特	778,668.80	2.91
155	300098	高新兴	770,785.00	2.88
156	603690	至纯科技	752,062.00	2.81
157	000725	京东方 A	744,196.00	2.78
158	600406	国电南瑞	744,011.00	2.78
159	000550	江铃汽车	739,808.00	2.76
160	000503	国新健康	727,108.00	2.72
161	002709	天赐材料	714,679.00	2.67
162	600196	复星医药	705,970.00	2.64
163	603866	桃李面包	703,915.00	2.63
164	600093	易见股份	702,469.00	2.62
165	002373	千方科技	702,098.00	2.62
166	300253	卫宁健康	698,281.00	2.61
167	002930	宏川智慧	693,750.00	2.59
168	300433	蓝思科技	691,224.00	2.58
169	002614	奥佳华	684,663.00	2.56
170	002156	通富微电	677,961.00	2.53

171	002466	天齐锂业	673,088.00	2.51
172	601111	中国国航	654,826.00	2.45
173	600259	广晟有色	632,544.00	2.36
174	603180	金牌厨柜	628,865.00	2.35
175	002747	埃斯顿	627,027.00	2.34
176	300226	上海钢联	623,604.00	2.33
177	300531	优博讯	618,033.00	2.31
178	603666	亿嘉和	613,359.00	2.29
179	300170	汉得信息	609,824.00	2.28
180	300659	中孚信息	609,292.00	2.28
181	603993	洛阳钼业	608,872.00	2.27
182	688363	华熙生物	608,844.60	2.27
183	002415	海康威视	606,128.00	2.26
184	000895	双汇发展	596,411.00	2.23
185	600489	中金黄金	594,424.00	2.22
186	603160	汇顶科技	594,070.00	2.22
187	603579	荣泰健康	591,138.00	2.21
188	002398	垒知集团	586,255.55	2.19
189	300316	晶盛机电	586,090.00	2.19
190	600900	长江电力	582,136.00	2.18
191	300456	耐威科技	580,671.00	2.17
192	600705	中航资本	574,867.00	2.15
193	002547	春兴精工	567,167.00	2.12
194	601800	中国交建	559,462.00	2.09
195	300454	深信服	556,664.00	2.08
196	601881	中国银河	553,374.00	2.07

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	600519	贵州茅台	19,632,937.09	73.36
2	601318	中国平安	19,106,194.56	71.39
3	600036	招商银行	13,651,714.66	51.01
4	601628	中国人寿	9,546,279.55	35.67
5	601601	中国太保	9,434,815.93	35.25
6	601288	农业银行	7,173,274.72	26.80
7	002157	正邦科技	6,470,225.31	24.17
8	600276	恒瑞医药	6,426,327.66	24.01
9	000858	五 粮 液	6,266,603.51	23.41
10	601166	兴业银行	6,127,593.24	22.89
11	300498	温氏股份	6,042,101.52	22.58
12	000568	泸州老窖	5,483,036.78	20.49
13	600000	浦发银行	5,349,272.08	19.99
14	002124	天邦股份	5,339,833.73	19.95
15	601328	交通银行	5,240,687.08	19.58
16	600309	万华化学	5,073,837.24	18.96
17	600009	上海机场	4,999,889.85	18.68
18	601939	建设银行	4,952,750.68	18.51
19	600887	伊利股份	4,930,977.58	18.42
20	002714	牧原股份	4,868,579.85	18.19
21	600585	海螺水泥	4,741,119.40	17.71
22	002792	通宇通讯	4,735,716.13	17.69
23	600030	中信证券	4,676,725.64	17.47
24	601688	华泰证券	4,573,284.57	17.09
25	601888	中国国旅	4,379,283.77	16.36
26	000651	格力电器	4,218,067.24	15.76
27	600809	山西汾酒	4,195,079.53	15.67
28	002567	唐人神	4,001,973.25	14.95
29	300136	信维通信	3,942,837.58	14.73
30	002463	沪电股份	3,712,157.78	13.87
31	600801	华新水泥	3,535,424.77	13.21
32	688111	金山办公	3,475,799.65	12.99
33	600570	恒生电子	3,432,016.60	12.82
34	601066	中信建投	3,423,319.74	12.79
35	600048	保利地产	3,340,400.63	12.48
36	601668	中国建筑	3,309,676.74	12.37
37	601766	中国中车	3,128,805.73	11.69
38	300134	大富科技	3,126,702.24	11.68

39	600031	三一重工	3,126,600.61	11.68
40	002796	世嘉科技	3,109,730.98	11.62
41	002736	国信证券	3,043,192.01	11.37
42	300450	先导智能	3,022,149.73	11.29
43	300122	智飞生物	2,832,858.96	10.58
44	002475	立讯精密	2,754,111.95	10.29
45	002384	东山精密	2,723,824.47	10.18
46	600728	佳都科技	2,723,318.25	10.18
47	601229	上海银行	2,639,286.13	9.86
48	601211	国泰君安	2,632,107.52	9.83
49	002100	天康生物	2,584,139.58	9.66
50	300166	东方国信	2,553,897.18	9.54
51	600104	上汽集团	2,528,980.09	9.45
52	002230	科大讯飞	2,503,222.65	9.35
53	601998	中信银行	2,496,656.00	9.33
54	601988	中国银行	2,449,852.43	9.15
55	600016	民生银行	2,412,270.00	9.01
56	002241	歌尔股份	2,403,726.39	8.98
57	600340	华夏幸福	2,400,848.40	8.97
58	600703	三安光电	2,355,803.12	8.80
59	601818	光大银行	2,245,921.51	8.39
60	603027	千禾味业	2,239,935.36	8.37
61	300322	硕贝德	2,223,087.34	8.31
62	000001	平安银行	2,037,778.00	7.61
63	000333	美的集团	1,987,385.04	7.43
64	002841	视源股份	1,980,544.47	7.40
65	600588	用友网络	1,973,120.07	7.37
66	600004	白云机场	1,970,336.92	7.36
67	000876	新希望	1,921,615.88	7.18
68	603288	海天味业	1,889,736.42	7.06
69	603019	中科曙光	1,849,918.47	6.91
70	600690	海尔智家	1,849,909.93	6.91
71	002456	欧菲光	1,829,899.70	6.84
72	600837	海通证券	1,809,919.00	6.76
73	002458	益生股份	1,791,150.72	6.69
74	688099	晶晨股份	1,774,937.72	6.63
75	002925	盈趣科技	1,751,325.38	6.54
76	600019	宝钢股份	1,744,550.76	6.52

77	600845	宝信软件	1,735,785.50	6.49
78	300373	扬杰科技	1,688,691.98	6.31
79	000002	万科A	1,687,387.02	6.30
80	300394	天孚通信	1,673,932.16	6.25
81	600580	卧龙电驱	1,663,789.00	6.22
82	002234	民和股份	1,644,266.24	6.14
83	601989	中国重工	1,603,929.39	5.99
84	300623	捷捷微电	1,602,755.53	5.99
85	600028	中国石化	1,589,787.59	5.94
86	300457	赢合科技	1,537,008.18	5.74
87	300323	华灿光电	1,535,335.79	5.74
88	300348	长亮科技	1,521,830.38	5.69
89	300059	东方财富	1,500,849.97	5.61
90	600498	烽火通信	1,475,417.22	5.51
91	600491	龙元建设	1,467,702.00	5.48
92	600486	扬农化工	1,408,475.00	5.26
93	002371	北方华创	1,349,219.15	5.04
94	002185	华天科技	1,333,973.87	4.98
95	601901	方正证券	1,331,370.81	4.97
96	600029	南方航空	1,320,635.96	4.93
97	002191	劲嘉股份	1,319,360.01	4.93
98	600855	航天长峰	1,274,905.27	4.76
99	600050	中国联通	1,241,736.93	4.64
100	601088	中国神华	1,223,953.33	4.57
101	002142	宁波银行	1,222,650.00	4.57
102	300408	三环集团	1,205,208.25	4.50
103	600325	华发股份	1,195,925.68	4.47
104	002366	台海核电	1,191,002.28	4.45
105	601012	隆基股份	1,160,024.60	4.33
106	300607	拓斯达	1,156,025.80	4.32
107	000603	盛达资源	1,153,891.17	4.31
108	600456	宝钛股份	1,153,018.77	4.31
109	300550	和仁科技	1,146,922.50	4.29
110	002304	洋河股份	1,135,997.85	4.24
111	601169	北京银行	1,132,168.00	4.23
112	603305	旭升股份	1,095,837.02	4.09
113	000975	银泰黄金	1,067,766.65	3.99
114	000596	古井贡酒	1,050,081.63	3.92

115	000063	中兴通讯	1,040,500.68	3.89
116	600999	招商证券	1,035,774.70	3.87
117	600547	山东黄金	1,013,446.46	3.79
118	000860	顺鑫农业	1,010,066.49	3.77
119	002281	光迅科技	1,004,529.36	3.75
120	002698	博实股份	996,136.16	3.72
121	000426	兴业矿业	995,470.56	3.72
122	601390	中国中铁	981,872.18	3.67
123	600884	杉杉股份	972,553.75	3.63
124	300566	激智科技	966,145.79	3.61
125	300001	特锐德	947,542.17	3.54
126	000601	韶能股份	920,579.56	3.44
127	000100	TCL 集团	914,981.14	3.42
128	603363	傲农生物	909,503.00	3.40
129	000425	徐工机械	908,778.01	3.40
130	600093	易见股份	900,000.00	3.36
131	603369	今世缘	894,920.52	3.34
132	300601	康泰生物	884,267.00	3.30
133	000503	国新健康	871,500.00	3.26
134	603517	绝味食品	868,929.07	3.25
135	002916	深南电路	865,282.00	3.23
136	002050	三花智控	860,550.46	3.22
137	601006	大秦铁路	852,749.64	3.19
138	601336	新华保险	850,302.77	3.18
139	002202	金风科技	850,015.94	3.18
140	000550	江铃汽车	846,362.09	3.16
141	603659	璞泰来	844,106.64	3.15
142	002385	大北农	830,207.00	3.10
143	002439	启明星辰	828,188.33	3.09
144	688188	柏楚电子	824,174.14	3.08
145	002851	麦格米特	822,830.50	3.07
146	300570	太辰光	812,802.94	3.04
147	600549	厦门钨业	797,443.31	2.98
148	300098	高新兴	792,290.80	2.96
149	002557	洽洽食品	783,910.85	2.93
150	300604	长川科技	759,422.45	2.84
151	002508	老板电器	748,117.77	2.80
152	002407	多氟多	736,511.00	2.75

153	002373	千方科技	723,501.26	2.70
154	600584	长电科技	720,072.63	2.69
155	688321	微芯生物	718,693.60	2.69
156	300142	沃森生物	715,328.14	2.67
157	002614	奥佳华	711,911.00	2.66
158	600259	广晟有色	708,547.80	2.65
159	002398	垒知集团	704,405.15	2.63
160	603866	桃李面包	703,048.72	2.63
161	601857	中国石油	694,770.81	2.60
162	002930	宏川智慧	690,627.65	2.58
163	002747	埃斯顿	685,421.02	2.56
164	600406	国电南瑞	681,978.10	2.55
165	603666	亿嘉和	675,717.08	2.52
166	603690	至纯科技	672,306.78	2.51
167	300735	光弘科技	672,000.00	2.51
168	300672	国科微	663,512.42	2.48
169	300433	蓝思科技	646,778.46	2.42
170	300274	阳光电源	639,140.00	2.39
171	300531	优博讯	637,752.32	2.38
172	002466	天齐锂业	635,993.45	2.38
173	002709	天赐材料	635,722.65	2.38
174	002156	通富微电	631,570.70	2.36
175	603180	金牌厨柜	624,053.00	2.33
176	300253	卫宁健康	622,109.52	2.32
177	688388	嘉元科技	620,906.08	2.32
178	300226	上海钢联	604,338.00	2.26
179	300456	耐威科技	600,797.82	2.24
180	300316	晶盛机电	598,208.60	2.24
181	600352	浙江龙盛	588,791.10	2.20
182	000725	京东方 A	587,143.25	2.19
183	000895	双汇发展	573,077.58	2.14
184	688196	卓越新能	559,873.97	2.09
185	603160	汇顶科技	557,284.69	2.08
186	603579	荣泰健康	556,763.25	2.08
187	601138	工业富联	552,972.99	2.07
188	600353	旭光股份	548,983.24	2.05
189	600489	中金黄金	547,811.93	2.05
190	002547	春兴精工	541,600.00	2.02

191	300399	京天利	538,838.95	2.01
192	601881	中国银河	537,362.08	2.01
193	300170	汉得信息	536,743.86	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	528,643,706.33
卖出股票收入（成交）总额	462,442,216.84

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,510,711.60	1.40
	其中：政策性金融债	1,510,711.60	1.40
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）	146,000.00	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,656,711.60	1.54

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	108602	国开 1704	15,020	1,510,711.60	1.40
2	113029	明阳转债	480	48,000.00	0.04
3	128085	鸿达转债	300	30,000.00	0.03
4	128084	木森转债	230	23,000.00	0.02
5	128086	国轩转债	180	18,000.00	0.02

8.7 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

注：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

注：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

注：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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 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	78,815.46
2	应收证券清算款	5,720,187.32
3	应收股利	-
4	应收利息	42,709.49
5	应收申购款	2,355.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,844,067.41

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本报告期末本基金前十名股票中未存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
774	142,602.72	81,392,895.26	73.74%	28,981,611.01	26.26%

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	114,336.47	0.1000%

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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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	4.51	4,975,124.38	4.51	—
基金管理人高级 管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	4,173,935.99	3.78	4,173,935.99	3.78	—
其他	63,595.91	0.06	1,634,982.83	1.48	—
合计	9,212,656.28	8.35	11,080,744.07	10.04	—

注：本基金发起份额承诺的持有期限已满 3 年，截止至本报告期末，发起资金持有份额为 9,212,656.28 份。

§ 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	33,214,590.25
本报告期期间基金总申购份额	210,464,491.62
减:本报告期期间基金总赎回份额	133,304,575.60
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	110,374,506.27

§ 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 2019 年 4 月 23 日发布公告，自 2019 年 4 月 19 日起，朱为绎先生不再担任公司董事长，公司董事长由胡冬辉女士担任；于 2019 年 5 月 30 日发布公告，自 2019 年 5 月 18 日起，李昱女士不再担任公司副总经理；于 2019 年 9 月 21 日发布公告，自 2019 年 9 月 19 日起，陶安虎先生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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内为基金进行审计的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，审计费用 30,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、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。

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	
国金证券	2	2269,141,183.15	27.39%	196,822.74	26.86%	—
国盛证券	2	182,376,650.33	18.56%	133,371.80	18.20%	—
华泰证券	2	174,381,329.83	17.74%	127,525.75	17.40%	—
兴业证券	2	114,836,580.80	11.68%	83,979.49	11.46%	—
银河证券	2	70,931,325.16	7.22%	66,058.83	9.01%	—
国信证券	2	54,033,190.56	5.50%	39,514.40	5.39%	—
太平洋证券	1	37,144,644.18	3.78%	27,163.85	3.71%	—
长江证券	1	36,589,777.38	3.72%	26,758.16	3.65%	—
国融证券	2	32,244,439.55	3.28%	23,580.65	3.22%	—
广发证券	2	11,118,991.65	1.13%	8,131.39	1.11%	—
万联证券	2	—	—	—	—	—
国泰君安	1	—	—	—	—	—
东莞证券	2	—	—	—	—	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
天风证券	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
国金证券	3,918,094.70	5.15%	98,500,000.00	40.52%	-	-
国盛证券	2,226,961.40	2.93%	19,000,000.00	7.82%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	18,658,108.60	24.52%	125,600,000.00	51.67%	-	-
银河证券	1,512.73	0.00%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	1,569,054.06	2.06%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	49,707,161.00	65.33%	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

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	中科沃土基金管理有限公司关于旗下基金 2018 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	中国证券报、证券时报、证券日报、上证报及基金管理人网站	2019 年 1 月 2 日
2	中科沃土基金管理有限公司关于基金经理助理离任的公告	中国证券报、证券时报及基金管理人网站	2019 年 2 月 1 日
3	中科沃土基金管理有限公司关于在广州农商行开通旗下部分基金转换业务的公告	中国证券报、证券时报及基金管理人网站	2019 年 3 月 8 日
4	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	中国证券报、证券时报、证券日报、上证报及基金管理人网站	2019 年 3 月 26 日
5	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	中国证券报、证券时报、证券日报、上证报及基金管理人网站	2019 年 4 月 1 日
6	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	中国证券报、证券时报、证券日报、上证报及基金管理人网站	2019 年 4 月 19 日
7	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	中国证券报、证券时报、证券日报、上证报及基金管理人网站	2019 年 4 月 26 日
8	关于中科沃土沃鑫成长精选灵活	中国证券报及基金	2019 年 5 月 8 日

	配置混合型发起式证券投资基金 的基金经理变更公告	管理人网站	
9	关于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 的基金经理变更公告.	中国证券报及基金 管理人网站	2019 年 5 月 8 日
10	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	中国证券报、上证报 及基金管理人网站	2019 年 5 月 16 日
11	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	中国证券报、证券时 报、证券日报、上证 报及基金管理人网 站	2019 年 5 月 24 日
12	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	中国证券报、证券时 报、证券日报、上证 报及基金管理人网 站	2019 年 6 月 4 日
13	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	中国证券报、证券时 报、证券日报、上证 报及基金管理人网 站	2019 年 6 月 6 日
14	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	中国证券报、证券时 报、证券日报、上证 报及基金管理人网 站	2019 年 6 月 12 日
15	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	中国证券报、证券时 报、证券日报、上证 报及基金管理人网 站	2019 年 6 月 14 日
16	中科沃土基金管理有限公司关于	中国证券报、证券时	2019 年 6 月 26 日

	旗下基金参与科创板投资及相关 风险揭示的公告	报、证券日报、上证 报及基金管理人网 站	
17	中科沃土基金管理有限公司关于 旗下基金 2019 年 6 月 30 日基金 资产净值和基金份额净值公告	中国证券报、证券时 报、证券日报、上证 报及基金管理人网 站	2019 年 7 月 1 日
18	中科沃土基金管理有限公司关于 新增东方财富证券为旗下部分基 金销售机构的公告	中国证券报、证券时 报、证券日报、上证 报及基金管理人网 站	2019 年 7 月 16 日
19	中科沃土基金管理有限公司关于 旗下部分基金参加天天基金费率 优惠活动的公告	中国证券报、证券时 报、证券日报、上证 报及基金管理人网 站	2019 年 7 月 18 日
20	中科沃土基金管理有限公司关于 旗下部分基金参加西藏东方财富 证券股份有限公司费率优惠活动 的公告	中国证券报、证券时 报、证券日报、上证 报及基金管理人网 站	2019 年 7 月 19 日
21	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 售机构并参加相关费率优惠活动 的公告	中国证券报、证券时 报、证券日报、上证 报及基金管理人网 站	2019 年 7 月 19 日
22	关于中科沃土沃鑫成长精选灵活 配置混合型发起证券投资基金的 基金经理变更公告	中国证券报及基金 管理人网站	2019 年 8 月 9 日
23	关于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 暂停大额申购业务的公告	中国证券报及基金 管理人网站	2019 年 8 月 12 日

24	中科沃土基金管理有限公司关于 新增济安财富证券为旗下部分基 金销售机构的公告	中国证券报、证券时 报、证券日报、上证 报及基金管理人网 站	2019 年 8 月 16 日
25	关于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 恢复直销柜台大额申购业务的公 告	中国证券报及基金 管理人网站	2019 年 9 月 26 日
26	中科沃土基金管理有限公司旗下 基金更换会计师事务所的公告	中国证券报、证券时 报、证券日报、上证 报及基金管理人网 站	2019 年 9 月 27 日
27	中科沃土基金管理有限公司关于 新增长城证券为旗下部分基金销 售机构的公告	中国证券报、证券时 报、证券日报、上证 报及基金管理人网 站	2019 年 10 月 11 日
28	中科沃土基金管理有限公司关于 旗下部分基金实施赎回费率优惠 活动的公告	中国证券报及基金 管理人网站	2019 年 10 月 24 日
29	中科沃土基金管理有限公司关于 旗下部分基金实施赎回费率优惠 活动的公告	中国证券报及基金 管理人网站	2019 年 12 月 2 日
30	中科沃土基金管理有限公司关于 新增中证金牛为旗下部分基金销 售机构的公告	中国证券报、证券时 报、证券日报、上证 报及基金管理人网 站	2019 年 12 月 3 日
31	中科沃土基金管理有限公司 关 于新增联储证券为旗下部分基金 销售机构的公告	中国证券报、证券时 报、证券日报、上证 报及基金管理人网	2019 年 12 月 9 日

		站	
32	关于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恢复大额申购业务的公告.	中国证券报及基金管理人网站	2019 年 12 月 12 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20191025-20191231	-	56,810,724.64	14,787,495.70	42,023,228.94	38.07%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
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。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鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的文件；
- 2、《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》；
- 3、《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鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金之法律意见书；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中科沃土基金管理有限公司

2020 年 4 月 29 日