中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:中科沃土基金管理有限公司
基金托管人:浙商银行股份有限公司
送出日期:2018年8月28日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做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2018年1月1日至2018年6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中科沃土沃嘉混合	
基金主代码	004763	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年12月6日	
基金管理人	中科沃土基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	64,764,668.96份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中科沃土沃嘉混合A	中科沃土沃嘉混合C
下属分级基金的交易代码:	004763	004764
报告期末下属分级基金的份额总额	28,758,511.59份	36,006,157.37份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活运用资产配置策略及多种股票市场、债券市场投资策略,充分挖掘潜在的投资机会,追求基金资产长期稳定增值。	
投资策略	通过对经济周期及资产价格发展变化的理解,在把握经济周期性波动的基础上,动态评估不同资产类在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征,追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置及资产的稳健增值。基于稳健投资的理念,投资于优选行业中的绩优股票;对于债券投资,采用期限结构策略、信用策略、可转换债券投资策略等;适当参与股指期货、权证、国债期货等金融衍生品的投资,进行分散投资,力求实现基金资产的长期稳定增值。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数(全价)收益率×50% 。	
风险收益特征	本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。	
	中科沃土沃嘉混合A	中科沃土沃嘉混合C

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中科沃土基金管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨敏	朱巍
	联系电话	020-23388979	0571-87659806
	电子邮箱	yangmin@richlandasm.com.cn	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		400-018-3610	95527
传真		020-23388997	0571-88268688

2.4信息披露方式

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

§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	中科沃土沃嘉混合A	中科沃土沃嘉混合C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-1,124,606.73	-1,992,365.86
本期利润	-3,016,867.33	-5,654,307.35
加权平均基金份额本期利润	-0.1018	-0.0912
本期基金份额净值增长率	-10.29%	-10.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.1014	-0.1027
期末基金资产净值	25,843,450.91	32,306,879.96
期末基金份额净值	0.8986	0.8973

注:1. 本基金合同生效日为2017年12月6日,截止2018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

中科沃土沃嘉混合A

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	-3.67%	0.92%	-3.66%	0.64%	-0.01%	0.28%
过去三个月	-4.90%	0.71%	-4.47%	0.54%	-0.43%	0.17%
过去六个月	-10.29%	0.70%	-5.37%	0.56%	-4.92%	0.14%
自基金合同生效起至今	-10.14%	0.66%	-5.51%	0.55%	-4.63%	0.11%

中科沃土沃嘉混合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	-3.67%	0.92%	-3.66%	0.64%	-0.01%	0.28%
过去三个月	-4.94%	0.71%	-4.47%	0.54%	-0.47%	0.17%
过去六个月	-10.40%	0.71%	-5.37%	0.56%	-5.03%	0.15%
自基金合同生效起至今	-10.27%	0.66%	-5.51%	0.55%	-4.76%	0.11%

注:业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

注:1、本基金合同于2017年12月6日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定,本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中科沃土基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2015]1937号文批准,于2015年9月6日正式成立,注册资本1亿元,是国内第101家公募基金管理公司,也是一家拥有PE背景的公募基金管理公司。中科沃土带着中科招商、粤科金融等主要股东强大的精神基因和优秀的文化基因,始终贯彻"持有人利益至上"的首要经营准则,遵循诚信、规范、稳健的经营方针,崇尚价值投资理念和长期、平稳、盈利的投资风格,致力于为持有人提供专业、精品、创新的投资理财服务,创造成长价值,汇聚阳光财富。截至2018年6月30日,中科沃土旗下共管理5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。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		
夏锟	基金经理助理	2017年12月15日	-	3年	管理学硕士。曾任广州从兴电子开发有限公司运维中心数据分析工程师、广东华美国际投资集团有限公司丰收业务部行业研究员、投资经理助理、投资经理,现任中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。
杨凡	基金经理	2017年12月6日	-	6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和中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理。中国国籍,具有基金从业资格。
李日曼	基金经理	2018年5月18日	-	14年	经济学硕士。曾任广州市华美丰收资产管理有限公司业务部投资经理,广东华美国际投资集团有限公司投资部投资经理,现任中科沃土沃嘉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。

注:1.此处的"离任日期"为公告确定的解聘日期,杨凡的"任职日期"为基金合同生效之日,李日曼、夏锟的"任职日期"为公告确定的聘任日期。

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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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,通过投资交易系统中的公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

2018年上半年,美联储继续加息,全球货币金融条件持续收紧。同时中美贸易争端加剧,给经济增长和全球金融市场稳定构成风险。由于预期的不确定性提高,市场风险偏好快速下降,导致A股市场出现较大幅度的调整。本基金虽然采取了防守策略,保持了较低仓位,淡化风格,自下而上挖掘估值合理的优秀公司,但受整体市场影响,产品净值仍然出现了较大的回撤。

展望下半年,目前A股市场估值已经到了历史上比较极端的情况,短期市场或许仍会受到内外各种因素的影响继续震荡,但经过调整后很多优秀标的已经具备明显的中长线投资价值。我们认为个股分化的行情将会继续演绎,因此将继续坚持自下而上的选股模式,严格按照业绩增长确定性高、估值有优势或分红率较高等核心指标精选个股。

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嘉混合A基金份额净值为0.8986元,本报告期基金份额净值增长率为-10.29%;截至本报告期末中科沃土沃嘉混合C基金份额净值为0.8973元,本报告期基金份额净值增长率为-10.40%;同期业绩比较基准收益率为-5.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年中国经济面临与 2011 年类似的问题。一方面,在 2016-2017 年托底政策消退之后,信用派生开始放缓,经济面临下行压力;另一方面,信用风险的暴露也大幅增加,成为市场的核心矛盾之一。但与 2011 年所不同的是,虽然同样面临经济的"坎儿",但十九大对未来提供了更加清晰的远景,在旧动能减速的同时,新的动能也正在孕育。

展望三季度,预期监管边际放缓,流动性压力所有缓解,目前市场估值水平已经低于上证综指2638点时,不易过于悲观。配置方向以有望持续获得国家层面支持的大创新以及调整后的消费板块为主。

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,本基金本报告期未进行利润分配,符合合同规定。

4.8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

本报告期内,本基金托管人在对中科沃土沃嘉灵活配置混合型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,中科沃土沃嘉灵活配置混合型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嘉灵活配置混合型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,本基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对中科沃土基金管理有限公司编制和披露的中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金2018年半年报告中财务指标、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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日: 2018年6月30日

单位:人民币元

姓名	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款		3,883,805.12	460.59
结算备付金		11,148,841.63	149,999,800.00
存出保证金		96,763.52	-
交易性金融资产		43,574,440.04	-
其中:股票投资		43,574,440.04	-
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		-	-
买入返售金融资产		-	55,572,000.00
应收证券清算款		1,241,016.56	27,555.08
应收利息		4,294.43	76,894.90
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		59,949,161.30	205,676,710.57
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,474,622.23	27,928.15
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		47,996.38	112,484.46
应付托管费		8,999.31	21,090.83
应付销售服务费		7,604.12	23,643.21
应付交易费用		95,718.59	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		163,889.80	8,000.00
负债合计		1,798,830.43	193,146.65
所有者权益:			
实收基金		64,764,668.96	205,162,272.11
未分配利润		-6,614,338.09	321,291.81
所有者权益合计		58,150,330.87	205,483,563.92
负债和所有者权益总计		59,949,161.30	205,676,710.57

注: 报告截止日2018年6月30日,A类基金份额净值0.8986元,C类基金份额净值0.8973元;基金份额总额64,764,668.96份,下属分级基金的份额总额分别为:A类基金份额总额28,758,511.59份,C类基金份额总额36,006,157.37份。

6.2 利润表

会计主体:中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

姓名	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入		-7,800,339.23
1.利息收入		634,187.63
其中:存款利息收入		108,057.12
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		526,130.51
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-2,892,842.50
其中:股票投资收益		-3,274,670.43
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		381,827.93
3. 公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-5,554,202.09
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		12,517.73
减:二、费用		870,835.45
1. 管理人报酬		348,484.02
2. 托管费		65,340.76
3. 销售服务费		59,058.38
4. 交易费用		237,862.49
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		160,089.80
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-8,671,174.68
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-8,671,174.68

注:本基金的基金合同于2017年12月6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:中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	205,162,272.11	321,291.81	205,483,563.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-8,671,174.68	-8,671,174.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以"-"号填列)	-140,397,603.15	1,735,544.78	-138,662,058.37
其中:1.基金申购款	1,983,269.33	-43,788.97	1,939,480.36
2.基金赎回款	-142,380,872.48	1,779,333.75	-140,601,538.73
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)	64,764,668.96	-6,614,338.09	58,150,330.87

注:本基金的基金合同于2017年12月6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:

杨绍基	傅军	李茂
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金"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嘉灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可〔2017〕625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《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")发起募集。本基金募集资金经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审验,并由其出具《验证报告》(安永华明(2017)验字第61247680_G05号)。经向中国证监会备案,本基金基金合同于2017年12月6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,基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围为:包括国内依法发行上市交易的股票(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)、权证、股指期货、国债期货、债券(包括但不限于国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日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

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。

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的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的初始投资成本,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的初始投资成本,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

本基金收益分配应遵循下列原则:

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

2、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

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

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

5、同一类别的每一基金份额享有同等分配权;

6、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

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

6.4.4.12 分部报告

根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 关联方关系

6.4.7.1 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

本报告期内未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。

6.4.7.2 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
浙商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

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。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	348,484.02
其中:支付销售机构的客户维护费	83,062.95

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.80 %÷ 当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人于次月首日起5个工作日内向基金托管人发送基金管理费划款指令,经基金托管人复核后从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	65,340.76

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值0.15 %的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.15 %÷ 当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人于次月首日起5个工作日内向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等 ,支付日顺延。

6.4.8.2.3 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 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃嘉混合A	中科沃土沃嘉混合C	合计
中科沃土基金管理有限公司	-	4,616.22	4,616.22
浙商银行股份有限公司	-	830.23	830.23
合计	-	5,446.45	5,446.45

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0.20%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×0.20%÷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C类基金份额前一日的基金资产净值

C类基金份额销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人于次月首日起5个工作日内向基金托管人发送基金销售服务费划款指令, 基金托管人复核后从基金财产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场(含回购)的交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2 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

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
浙商银行股份有限公司	3,883,805.12	43,711.43

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

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末2018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。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金未持有暂时停牌流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金未从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

6.4.10 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2018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43,574,440.04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	43,574,440.04	72.69
	其中:股票	43,574,440.04	72.69
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	-	-
	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	15,032,646.75	25.08
8	其他各项资产	1,342,074.51	2.24
9	合计	59,949,161.30	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	2,925,186.00	5.03
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,873,510.20	29.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,616,000.00	4.50
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,390,000.00	4.11
G	交通运输、仓储和邮政业	6,130,000.00	10.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	12,639,743.84	21.74
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	43,574,440.04	74.93

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	90,648	5,310,159.84	9.13
2	601333	广深铁路	950,000	4,037,500.00	6.94
3	300258	精锻科技	231,000	3,176,250.00	5.46
4	002206	海 利 得	600,000	2,994,000.00	5.15
5	000998	隆平高科	155,100	2,925,186.00	5.03
6	002007	华兰生物	90,000	2,894,400.00	4.98
7	000001	平安银行	300,000	2,727,000.00	4.69
8	600674	川投能源	300,000	2,616,000.00	4.50
9	601288	农业银行	698,600	2,403,184.00	4.13
10	601607	上海医药	100,000	2,390,000.00	4.11

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

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	002206	海 利 得	9,205,671.00	4.48
2	000001	平安银行	8,361,196.20	4.07
3	601318	中国平安	7,262,952.00	3.53
4	601607	上海医药	5,946,534.23	2.89
5	601288	农业银行	5,929,118.00	2.89
6	601668	中国建筑	5,568,214.00	2.71
7	601333	广深铁路	4,994,838.00	2.43
8	300258	精锻科技	4,801,869.98	2.34
9	601899	紫金矿业	4,796,906.00	2.33
10	600036	招商银行	4,783,222.00	2.33
11	601992	金隅集团	4,590,728.00	2.23
12	600674	川投能源	4,545,234.00	2.21
13	000998	隆平高科	4,208,694.30	2.05
14	600270	外运发展	3,996,979.00	1.95
15	000402	金 融 街	3,801,596.00	1.85
16	002007	华兰生物	3,786,970.00	1.84
17	601336	新华保险	3,691,756.00	1.80
18	600236	桂冠电力	3,648,473.00	1.78
19	001979	招商蛇口	3,208,244.63	1.56
20	600362	江西铜业	3,196,898.00	1.56

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	002206	海 利 得	6,482,463.31	3.15
2	601668	中国建筑	5,691,124.45	2.77
3	600270	外运发展	4,402,019.00	2.14
4	601899	紫金矿业	4,083,706.00	1.99
5	600036	招商银行	3,888,575.00	1.89
6	600236	桂冠电力	3,862,766.40	1.88
7	000001	平安银行	3,793,924.21	1.85
8	601607	上海医药	3,745,623.50	1.82
9	601992	金隅集团	3,702,726.00	1.80
10	600362	江西铜业	3,548,920.00	1.73
11	001979	招商蛇口	3,412,038.00	1.66
12	000402	金 融 街	2,932,902.00	1.43
13	600886	国投电力	2,860,214.00	1.39
14	601336	新华保险	2,812,170.50	1.37
15	600547	山东黄金	2,652,017.00	1.29
16	601288	农业银行	2,514,960.00	1.22
17	600056	中国医药	2,495,613.00	1.21
18	300258	精锻科技	1,528,513.00	0.74
19	600674	川投能源	1,441,990.00	0.70
20	300723	一品红	1,242,369.00	0.60

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	126,226,061.80
卖出股票收入(成交)总额	73,822,749.24

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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的前十名资产支持证券投资明细

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

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

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

7.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

7.10.2本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未投资股指期货。

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

本报告期末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

(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

平安银行(代码:000001)为中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金的前十大持仓证券。

2017年9月26日,福建证监局针对平安银行福州分行向未封顶楼盘发放按揭贷款,处罚款20万元;2017年9月30日,温州证监局针对平安银行温州分行办理贸易背景不真实的票据贴现业务,处罚款20万元;2017年12月29日,山东银监局针对平安银行济南分行未真实核算国内信用证福费廷买卖业务,未真实反映授信业务追加担保情况,贷款三查不尽职等,处罚款255万元;2018年1月18日,上海银监局针对平安银行上海分行在2015年至2016年间对部分同业理财产品未尽合规性审查义务及违规对外签署同业投资合同,给予责令改正并处罚款100万元;。2018年1月19日,青岛银监局针对平安银行青岛分行办理银行承兑汇票未严格审查贸易背景真实性,处罚款20万元;2018年2月7日,大连银监局针对平安银行大连分行贷款资金转存款质押开立银行承兑汇票并在他行贴现,贴现资金回流转存款质押重复开立银行承兑汇票,处罚款40万元;2018年3月14日,中国人民银行针对平安银行违反清算管理规定、人民币银行结算账户管理相关规定、非金融机构支付服务管理办法相关规定,给予警告并没收违法所得303.61万元,并处罚款1030.81万元,合计处罚金额1334.42万元;2018年6月28日,天津银监局针对平安银行贷前调查不到位,向环保未达标的企业提供融资;贷后管理失职,流动资金贷款被挪用,处罚款50万元。

本基金投资平安银行的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除平安银行外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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	96,763.52
2	应收证券清算款	1,241,016.56
3	应收股利	-
4	应收利息	4,294.43
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,342,074.51

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

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
中科沃土沃嘉混合A	140	205,417.94	5,001,109.59	17.39%	23,757,402.00	82.61%
中科沃土沃嘉混合C	143	251,791.31	-	-	36,006,157.37	100.00%
合计	283	228,850.42	5,001,109.59	7.72%	59,763,559.37	92.28%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中科沃土沃嘉混合A	35,536.95	0.1236%
	中科沃土沃嘉混合C	284,021.87	0.7888%
	合计	319,558.82	0.4934%

8.4 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有本开放式基金	中科沃土沃嘉混合A	0~10
	中科沃土沃嘉混合C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中科沃土沃嘉混合A	0
	中科沃土沃嘉混合C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	中科沃土沃嘉混合A	中科沃土沃嘉混合C
基金合同生效日(2017年12月6日)基金份额总额	32,667,493.83	172,494,778.28
本报告期期初基金份额总额	32,667,493.83	172,494,778.28
本报告期基金总申购份额	71,492.88	1,911,776.45
减:本报告期基金总赎回份额	3,980,475.12	138,400,397.36
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	28,758,511.59	36,006,157.37

§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

本报告期内,本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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	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	
长江证券	2	200,048,811.04	100.00%	146,296.27	100.00%	-

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
长江证券	-	-	2,067,817,000.00	100.00%	-	-

中科沃土基金管理有限公司

2018年8月28日