

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

2018年半年度报告摘要

2018年半年度报告摘要
2018年6月30日
基金管理人:中科沃土基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

6.1 报告期内本基金托管人遵守诚信情况声明
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。

7.2 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

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构在对本基金的投资、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务中,均须遵守相关法律法规,并自行承担相应的法律责任。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2018年8月2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。

6.4.2 关联方交易
6.4.2.1 关联方关系
对基金构成控制的关联方及其他重大关联关系的关联方发生变化的情况
本报告期末未存在控制关联方及其他重大关联关系的关联方发生变化的情况。
6.4.2.2 本报告期与基金发生关联方交易的重大关联方

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末持仓, 公允价值, 占净值比例. Lists top 10 stock holdings.

6.2 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:中证500指数收益率×60%+沪深300指数收益率×40%
6.3 基金业绩表现
截至2018年6月30日,本基金资产净值为人民币1,325,515.52元。

6.4.2.3 关联方交易
6.4.2.3.1 股票交易
6.4.2.3.2 债券交易
6.4.2.3.3 债券回购交易
6.4.2.3.4 权证交易

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末持仓, 公允价值, 占净值比例. Lists top 10 asset holdings.

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
基金代码:005222
基金管理人:中科沃土基金管理有限公司

6.4.2.3.5 衍生品交易
6.4.2.3.6 资产支持证券
6.4.2.3.7 银行承兑票据
6.4.2.3.8 买入返售金融资产

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

Table with 4 columns: 项目, 期末余额, 期初余额, 变动原因. Lists top 10 stock purchases.

6.4.2.3.9 卖出回购金融资产
6.4.2.3.10 其他
6.4.2.3.11 其他
6.4.2.3.12 其他

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末持仓, 公允价值, 占净值比例. Lists top 10 asset purchases.

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
3.1.2 期末总资产和净资产

6.4.2.3.13 其他
6.4.2.3.14 其他
6.4.2.3.15 其他
6.4.2.3.16 其他

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
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

3.1.3 利润表
3.1.4 现金流量表
3.1.5 净资产收益率

6.4.2.3.17 其他
6.4.2.3.18 其他
6.4.2.3.19 其他
6.4.2.3.20 其他

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
本基金本报告期末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

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
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩表现及与同期业绩比较基准收益率变动的比较

6.4.2.3.21 其他
6.4.2.3.22 其他
6.4.2.3.23 其他
6.4.2.3.24 其他

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
本基金本报告期末未持有权证。
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

3.2.3 基金业绩评价
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。
3.2.4 基金合同生效以来基金业绩表现及与同期业绩比较基准收益率变动的比较

6.4.2.3.25 其他
6.4.2.3.26 其他
6.4.2.3.27 其他
6.4.2.3.28 其他

7.11 本期国债逆回购交易情况
7.12 投资组合报告附注
7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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、处罚的情况。

3.2.5 基金投资组合报告
3.2.5.1 报告期末基金资产组合情况
3.2.5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

6.4.2.3.29 其他
6.4.2.3.30 其他
6.4.2.3.31 其他
6.4.2.3.32 其他

7.13 本报告期末本基金投资的国债期货持仓和持仓明细
(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。

3.2.5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
3.2.5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

6.4.2.3.33 其他
6.4.2.3.34 其他
6.4.2.3.35 其他
6.4.2.3.36 其他

7.14 投资组合报告附注
7.14.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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、处罚的情况。

3.2.5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
3.2.5.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

6.4.2.3.37 其他
6.4.2.3.38 其他
6.4.2.3.39 其他
6.4.2.3.40 其他

7.15 投资组合报告附注
7.15.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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、处罚的情况。

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

6.4.2.3.41 其他
6.4.2.3.42 其他
6.4.2.3.43 其他
6.4.2.3.44 其他

7.16 投资组合报告附注
7.16.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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、处罚的情况。

3.2.5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
3.2.5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和持仓明细

6.4.2.3.45 其他
6.4.2.3.46 其他
6.4.2.3.47 其他
6.4.2.3.48 其他

7.17 投资组合报告附注
7.17.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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、处罚的情况。

3.2.5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
3.2.5.12 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

6.4.2.3.49 其他
6.4.2.3.50 其他
6.4.2.3.51 其他
6.4.2.3.52 其他

7.18 投资组合报告附注
7.18.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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、处罚的情况。

3.2.5.13 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
3.2.5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

6.4.2.3.53 其他
6.4.2.3.54 其他
6.4.2.3.55 其他
6.4.2.3.56 其他

7.19 投资组合报告附注
7.19.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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、处罚的情况。

3.2.5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
3.2.5.16 报告期末本基金投资的国债期货持仓和持仓明细

6.4.2.3.57 其他
6.4.2.3.58 其他
6.4.2.3.59 其他
6.4.2.3.60 其他

7.20 投资组合报告附注
7.20.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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、处罚的情况。

3.2.5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
3.2.5.18 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

6.4.2.3.61 其他
6.4.2.3.62 其他
6.4.2.3.63 其他
6.4.2.3.64 其他

7.21 投资组合报告附注
7.21.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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、处罚的情况。

3.2.5.19 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
3.2.5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

6.4.2.3.65 其他
6.4.2.3.66 其他
6.4.2.3.67 其他
6.4.2.3.68 其他

7.22 投资组合报告附注
7.22.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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、处罚的情况。

3.2.5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
3.2.5.22 报告期末本基金投资的国债期货持仓和持仓明细

6.4.2.3.69 其他
6.4.2.3.70 其他
6.4.2.3.71 其他
6.4.2.3.72 其他

7.23 投资组合报告附注
7.23.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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、处罚的情况。

3.2.5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
3.2.5.24 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

6.4.2.3.73 其他
6.4.2.3.74 其他
6.4.2.3.75 其他
6.4.2.3.76 其他

7.24 投资组合报告附注
7.24.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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、处罚的情况。

3.2.5.25 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
3.2.5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

6.4.2.3.77 其他
6.4.2.3.78 其他
6.4.2.3.79 其他
6.4.2.3.80 其他

7.25 投资组合报告附注
7.25.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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、处罚的情况。

3.2.5.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
3.2.5.28 报告期末本基金投资的国债期货持仓和持仓明细

6.4.2.3.81 其他
6.4.2.3.82 其他
6.4.2.3.83 其他
6.4.2.3.84 其他

7.26 投资组合报告附注
7.26.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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、处罚的情况。

3.2.5.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
3.2.5.30 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

6.4.2.3.85 其他
6.4.2.3.86 其他
6.4.2.3.87 其他
6.4.2.3.88 其他

7.27 投资组合报告附注
7.27.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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、处罚的情况。

3.2.5.31 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
3.2.5.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

6.4.2.3.89 其他
6.4.2.3.90 其他
6.4.2.3.91 其他
6.4.2.3.92 其他

7.28 投资组合报告附注
7.28.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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、处罚的情况。

3.2.5.33 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
3.2.5.34 报告期末本基金投资的国债期货持仓和持仓明细

6.4.2.3.93 其他
6.4.2.3.94 其他
6.4.2.3.95 其他
6.4.2.3.96 其他

7.29 投资组合报告附注
7.29.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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、处罚的情况。

3.2.5.35 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
3.2.5.36 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

6.4.2.3.97 其他
6.4.2.3.98 其他
6.4.2.3.99 其他
6.4.2.3.100 其他

7.30 投资组合报告附注
7.30.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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、处罚的情况。

3.2.5.37 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
3.2.5.38 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

6.4.2.3.101 其他
6.4.2.3.102 其他
6.4.2.3.103 其他
6.4.2.3.104 其他

7.31 投资组合报告附注
7.31.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告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、处罚的情况。