

中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 06 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:浙商银行股份有限公司

送出日期:2025 年 08 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。本中期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2025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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年1月1日至2025年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	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 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	47
§9 开放式基金份额变动.....	48
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	52
§12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金	
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06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	1,945,949.28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	1,468,381.27份	477,568.01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长。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。
--	----

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	李峰	林彬
	联系电话	0757-86208608	0571-88269636
	电子邮箱	lifeng0214@richlandasm.com.cn	zsyhzctgb@czbank.com
客户服务电话		400-018-3610	95527
传真		0757-86208604	0571-88268688
注册地址		佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号千灯湖创投小镇核心区（自编号）十三座（B4）	杭州市萧山区鸿宁路1788号
办公地址		佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号千灯湖创投小镇核心区（自编号）十三座（B4）	杭州市拱墅区环城西路76号
邮政编码		528200	310006
法定代表人		于建伟	陈海强（代为履行法定代表人职责）

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.richlandasm.com.cn
基金中期报告备置地点	佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号千灯湖创投小镇核心区（自编号）十三座（B4）

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中科沃土基金管理有限公司	佛山市南海区桂城街道桂澜北路6号

		千灯湖创投小镇核心区(自编号)十三座(B4)
--	--	------------------------

§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

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2025年01月01日-2025年06月30日)	
	中科沃土沃嘉混合 A	中科沃土沃嘉混合 C
本期已实现收益	177,865.63	107,011.16
本期利润	-608,134.97	-439,476.89
加权平均基金份额本期利润	-0.0134	-0.0129
本期加权平均净值利润率	-1.04%	-1.04%
本期基金份额净值增长率	-0.03%	-0.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)	
	中科沃土沃嘉混合 A	中科沃土沃嘉混合 C
期末可供分配利润	260,672.28	67,736.41
期末可供分配基金份额利润	0.1775	0.1418
期末基金资产净值	1,888,140.12	595,876.29
期末基金份额净值	1.2859	1.2477
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)	
	中科沃土沃嘉混合 A	中科沃土沃嘉混合 C
基金份额累计净值增长率	28.59%	24.77%

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

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	0.52%	0.24%	1.40%	0.28%	-0.88%	-0.04%
过去三个月	0.60%	0.19%	1.26%	0.52%	-0.66%	-0.33%
过去六个月	-0.03%	0.16%	0.12%	0.49%	-0.15%	-0.33%
过去一年	1.16%	0.11%	8.54%	0.67%	-7.38%	-0.56%
过去三年	3.38%	0.20%	-1.91%	0.54%	5.29%	-0.34%
自基金合同 生效起至今	28.59%	0.65%	10.43%	0.61%	18.16%	0.04%

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	0.49%	0.24%	1.40%	0.28%	-0.91%	-0.04%
过去三个月	0.51%	0.19%	1.26%	0.52%	-0.75%	-0.33%
过去六个月	-0.18%	0.16%	0.12%	0.49%	-0.30%	-0.33%
过去一年	0.91%	0.11%	8.54%	0.67%	-7.63%	-0.56%
过去三年	2.70%	0.20%	-1.91%	0.54%	4.61%	-0.34%
自基金合同 生效起至今	24.77%	0.65%	10.43%	0.61%	14.34%	0.04%

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

中科沃土沃嘉混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年12月06日-2025年06月30日)



中科沃土沃嘉混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年12月06日-2025年06月30日)



§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2.42亿元，是国内第100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”的首要经营原则，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2025年6月30日，中科沃土旗下共管理6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、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金和中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金。

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		
董清源	固定收益部基金经 理	2022- 04-29	2025- 06-25	12年	金融学硕士。曾任北京康思资本管理有限公司债券交易员、投资经理、投资总监，首建投信和（北京）资产管理有限公司常务副总经理，北京康思资本管理有限公司副总经理，现任中科沃土基金管理有限公司中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土货币市场基金和中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金的基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
徐平安	权益研究部副总经 理（主持工作）、基 金经理	2024- 01-04	-	11年	金融工程硕士。曾任法国邮政银行基金管理公司混合型基金分析师，安信期货有限责任公司高级金融工程分析师，东兴证券股份有限

					公司衍生品部投资经理，光大兴陇信托有限责任公司证券市场权益投资部权益类产品投资经理，现任中科沃土基金管理有限公司权益研究部副总经理（主持工作），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的基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。
卢振荣	公司总经理助理、固定收益部总经理、基金经理	2025-03-05	-	17年	理学硕士。曾任东莞农商银行总行公司部客户经理、资金中心债券交易岗和票据交易岗，广东省农村信用社资金调剂中心交易员，广东南粤银行金融市场部主管、金融市场部债券交易部总经理、资金运营中心债券部总经理助理，现任中科沃土基金管理有限公司总经理助理、固定收益部总经理，中科沃土基金管理有限公司中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金、中科沃土货币市场基金、中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金、中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金的基金经理。中国国籍，具有基金从业资格。

注：1.此处的“任职日期”和“离任日期”为公告确定的聘任日期和离任日期；

2.证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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。

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

2025年上半年我国经济面临较大挑战。

国际贸易方面，4月初特朗普政府发动全面贸易战，对全球金融市场造成较大冲击，国际风险资产价格产生较大波动，虽然后续国际贸易矛盾趋于缓和，但在“逆全球化”的趋势下，全球供应链格局遭受到较大冲击，我国对美贸易的总体形势仍然承压。

地缘政治方面，俄乌战争持续焦灼，巴以在加沙地区摩擦不断外，印度与巴基斯坦，以色列与伊朗也爆发多轮武装冲突。地区局势持续混乱为世界经济复苏提出新的挑战。在全球经济形势难言乐观的当下，更多国家在“安全”与“发展”的抉择中优先考虑前者，供应链安全与自主可控成为比国际分工与经贸合作更重要的政治考量。

在上述外部不利因素扰动的背景下，我国经济的复苏动能仍然较弱。外需承压叠加内需不振，需要更多的刺激政策来稳定国内经济的平稳运行。年初以来，中央政府继续在“两重”、“两新”方面持续发力，并运用降准降息等货币政策来托底市场信心，上半年国民经济运行总体平稳，实现了5.3%的经济增长。

权益市场方面，虽然外需动能减弱以及经济内生复苏动能不足的问题仍制约资本市场的全面复苏，但以Deepseek为代表的大模型及其他AI应用发展迅速，科技板块受到投资者的热烈关注。A股市场呈现结构性牛市格局。具体来看，AI算力、创新医药、稳定

币等热点题材表现活跃，中小市值风格也较为活跃，而消费、周期等传统中大市值板块表现较差。

报告期内，管理人谨慎参与了AI算力、电动汽车、半导体制造等具有发展前景的科技板块的投资机会。后续管理人将继续勤勉尽责，把握下半年权益市场中新质生产力方向的投资机会，力争继续提高组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中科沃土沃嘉混合A基金份额净值为1.2859元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.03%，同期业绩比较基准收益率为0.12%；截至报告期末中科沃土沃嘉混合C基金份额净值为1.2477元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.18%，同期业绩比较基准收益率为0.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，下半年我国经济形势仍存在较大不确定性。中美关税摩擦致使我国的外需形势承受较大压力，年初一度表现亮眼的内需消费下半年也面临一定的透支风险。我们期望后续国内宏观调控政策的进一步加力，包括更有力的财政支出、更大范围的消费刺激等。特别的，随着决策层“反内卷”政策的不断出台，后续国内价格水平持续低迷的局面有望得到改善。在此背景下，钢铁、有色、能源与化工等传统行业或迎来补涨行情。另外，随着市场风险偏好的持续改善，以半导体、新能源、算力与人工智能等新质生产力范式下的科技板块或出现新一波上涨行情。

2025年下半年，基金管理人将继续规范运作，勤勉尽责。本基金将积极把握市场机会，灵活运用各类策略，优化权益持仓风险敞口的暴露，在保证流动性安全的前提下，力争提高基金产品的收益率。

4.6 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。

定价服务机构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。

4.7 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，本基金本报告期末进行利润分配，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，本基金存在连续二十个工作日以上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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人--中科沃土基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在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。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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2025年中期报告中财务指标、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复核，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：2025年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
资 产：			

货币资金	6.4.7.1	1,122,639.89	1,075,333.48
结算备付金		33,927.34	2,282.25
存出保证金		9.71	94.42
交易性金融资产	6.4.7.2	994,805.00	135,826,012.55
其中：股票投资		994,805.00	25,701.11
基金投资		-	-
债券投资		-	135,800,311.44
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	38,005,076.72
应收清算款		499,408.16	-
应收股利		-	-
应收申购款		59.99	89.94
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,650,850.09	174,908,889.36
负债和净资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		83,645.42	-
应付赎回款		400.71	2,999.49
应付管理人报酬		1,622.35	118,059.25
应付托管费		304.20	22,136.12
应付销售服务费		96.79	13,119.17

应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	80,764.21	184,150.16
负债合计		166,833.68	340,464.19
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	1,945,949.28	137,464,806.61
未分配利润	6.4.7.7	538,067.13	37,103,618.56
净资产合计		2,484,016.41	174,568,425.17
负债和净资产总计		2,650,850.09	174,908,889.36

注：报告截止日2025年06月30日，基金份额总额1,945,949.28份，其中:A类基金份额净值1.2859元，A类基金份额1,468,381.27份；C类基金份额净值1.2477元，C类基金份额477,568.01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：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年01月01日至 2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至202 4年06月30日
一、营业总收入		-368,518.37	3,763,944.57
1.利息收入		60,029.55	327,649.96
其中：存款利息收入	6.4.7.8	2,076.35	25,561.83
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		57,953.20	302,088.13
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”		903,146.06	-29,215,533.14

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.9	20,181.69	-31,936,777.05
基金投资收益	6.4.7.10	-	-
债券投资收益	6.4.7.11	881,599.16	2,697,428.22
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.14	1,365.21	23,815.69
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.15	-1,332,488.65	32,632,472.96
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.16	794.67	19,354.79
减：二、营业总支出		679,093.49	1,599,137.03
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	408,200.22	1,114,888.92
2.托管费	6.4.10.2.2	76,537.53	209,041.64
3.销售服务费	6.4.10.2.3	43,013.98	128,753.52
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		24,740.80	12,023.31
其中：卖出回购金融资产 支出		24,740.80	12,023.31
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		-	6,022.04
8.其他费用	6.4.7.18	126,600.96	128,407.60
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-1,047,611.86	2,164,807.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-1,047,611.86	2,164,807.54

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,047,611.86	2,164,807.54

6.3 净资产变动表

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：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	137,464,806.61	37,103,618.56	174,568,425.17
二、本期期初净资产	137,464,806.61	37,103,618.56	174,568,425.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-135,518,857.33	-36,565,551.43	-172,084,408.76
（一）、综合收益总额	-	-1,047,611.86	-1,047,611.86
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-135,518,857.33	-35,517,939.57	-171,036,796.90
其中：1.基金申购款	167,180.55	42,929.88	210,110.43
2.基金赎回款	-135,686,037.88	-35,560,869.45	-171,246,907.33
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,945,949.28	538,067.13	2,484,016.41

产			
项 目	上年度可比期间		
	2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	347,149,605.61	83,308,338.98	430,457,944.59
二、本期期初净资产	347,149,605.61	83,308,338.98	430,457,944.59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-195,438,910.83	-44,529,989.78	-239,968,900.61
（一）、综合收益总额	-	2,164,807.54	2,164,807.54
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-195,438,910.83	-46,694,797.32	-242,133,708.15
其中：1.基金申购款	230,065.09	54,617.34	284,682.43
2.基金赎回款	-195,668,975.92	-46,749,414.66	-242,418,390.58
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	151,710,694.78	38,778,349.20	190,489,043.98

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：

于建伟

李峰

李峰

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")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[2017]第625号关于准予《中科沃土沃嘉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《中科沃土沃嘉灵活配置混合型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205,055,950.09元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2017)验字第61247680_G05号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年12月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为205,162,272.11份基金份额,其中认购资金利息折合106,322.02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,基金托管人为浙商银行股份有限公司(以下简称"浙商银行")。

根据《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市交易的股票(包括中小板、创业板、存托凭证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。本基金投资组合中股票占基金资产的比例为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,应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×50%+中债综合指数(全价)收益率×50%。

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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定

(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》、《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2025年中期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2025年6月30日的财务状况以及2025上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

(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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
活期存款	1,122,639.89
等于：本金	1,122,616.56
加：应计利息	23.33
减：坏账准备	-

定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,122,639.89

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		983,999.00	-	994,805.00	10,806.00
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		983,999.00	-	994,805.00	10,806.00

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,463.25
其中：交易所市场	514.79
银行间市场	2,948.46
应付利息	-
预提费用-审计费	20,000.54
预提费用-信息披露费	48,000.42
预提费用-账户维护费	9,300.00
合计	80,764.21

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 中科沃土沃嘉混合A

金额单位：人民币元

项目 (中科沃土沃嘉混合A)	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	75,405,540.28	75,405,540.28
本期申购	43,449.07	43,449.07
本期赎回（以“-”号填列）	-73,980,608.08	-73,980,608.08

本期末	1,468,381.27	1,468,381.27
-----	--------------	--------------

6.4.7.6.2 中科沃土沃嘉混合C

金额单位：人民币元

项目 (中科沃土沃嘉混合C)	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	62,059,266.33	62,059,266.33
本期申购	123,731.48	123,731.48
本期赎回（以“-”号填列）	-61,705,429.80	-61,705,429.80
本期末	477,568.01	477,568.01

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 中科沃土沃嘉混合A

单位：人民币元

项目 (中科沃土沃嘉混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,119,835.17	8,470,905.69	21,590,740.86
本期期初	13,119,835.17	8,470,905.69	21,590,740.86
本期利润	177,865.63	-786,000.60	-608,134.97
本期基金份额交易产生的变动数	-13,037,028.52	-7,525,818.52	-20,562,847.04
其中：基金申购款	7,593.62	4,792.88	12,386.50
基金赎回款	-13,044,622.14	-7,530,611.40	-20,575,233.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	260,672.28	159,086.57	419,758.85

6.4.7.7.2 中科沃土沃嘉混合C

单位：人民币元

项目 (中科沃土沃嘉混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
-------------------	-------	-------	---------

上年度末	8,697,738.12	6,815,139.58	15,512,877.70
本期期初	8,697,738.12	6,815,139.58	15,512,877.70
本期利润	107,011.16	-546,488.05	-439,476.89
本期基金份额交易产生的变动数	-8,737,012.87	-6,218,079.66	-14,955,092.53
其中：基金申购款	17,489.80	13,053.58	30,543.38
基金赎回款	-8,754,502.67	-6,231,133.24	-14,985,635.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	67,736.41	50,571.87	118,308.28

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
活期存款利息收入	1,668.37
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	407.86
其他	0.12
合计	2,076.35

6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出股票成交总额	87,230.17
减：卖出股票成本总额	66,406.46
减：交易费用	642.02
买卖股票差价收入	20,181.69

6.4.7.10 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	1,079,974.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-198,375.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	881,599.16

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	238,066,739.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	236,850,430.00
减：应计利息总额	1,410,109.50
减：交易费用	4,575.00
买卖债券差价收入	-198,375.00

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,365.21
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	1,365.21

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
1.交易性金融资产	-1,332,488.65
——股票投资	-6,148.65
——债券投资	-1,326,340.00
——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	-1,332,488.65

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
基金赎回费收入	794.67
合计	794.67

注：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。

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
审计费用	20,000.54
信息披露费	48,000.42
证券出借违约金	-
账户维护费-中债登	9,000.00
其他	40,000.00
账户维护费-上清所	9,600.00
合计	126,600.96

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中科沃土基金管理有限公司("中科沃土基金")	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("浙商银行")	基金托管人、基金销售机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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。

6.4.10.1.2 权证交易

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。

6.4.10.1.3 债券交易

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。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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。

6.4.10.1.5 基金交易

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基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至20 25年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至20 24年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	408,200.22	1,114,888.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,319.89	3,527.01
应支付基金管理人的净管理费	405,880.33	1,111,361.91

注：支付基金管理人中科沃土基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%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×0.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025年01月01日至2025年06月30日	2024年01月01日至2024年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	76,537.53	209,041.64

注：支付基金托管人浙商银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%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×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025年01月01日至2025年06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	0.00	42,343.18	42,343.18
浙商银行	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	42,343.18	42,343.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2024年01月01日至2024年06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	0.00	127,610.65	127,610.65
浙商银行	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	127,610.65	127,610.65

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中科沃土基金，再由中科沃土基金计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为：日销售服务费＝前一日C类的基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 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 2025年01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行股份有限公司	1,122,639.89	1,668.37	2,666,059.42	12,932.41

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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、合规风控部、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。

6.4.13.2 信用风险

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

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浙商银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	20,256,871.23
合计	-	20,256,871.23

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2、以上未评级的债券为政策性金融债、短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	-	-

AAA以下	-	-
未评级	-	115,543,440.21
合计	-	115,543,440.21

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为国债、中期票据、政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

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。

6.4.13.3 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。

于本报告期末，本基金的卖出回购金融资产款（若有）计息且利息金额不重大；除此之外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的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发行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报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节。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%。

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。于本报告期末,本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大,此外还持有货币资金、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产,因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2025年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资 金	1,122,639.89	-	-	-	1,122,639.89
结算备 付金	33,927.34	-	-	-	33,927.34
存出保 证金	9.71	-	-	-	9.71
交易性 金融资 产	-	-	-	994,805.00	994,805.00
应收清 算款	-	-	-	499,408.16	499,408.16
应收申 购款	-	-	-	59.99	59.99
资产总 计	1,156,576.94	-	-	1,494,273.15	2,650,850.09
负债					
应付清 算款	-	-	-	83,645.42	83,645.42
应付赎 回款	-	-	-	400.71	400.71
应付管 理人报 酬	-	-	-	1,622.35	1,622.35
应付托 管费	-	-	-	304.20	304.20
应付销 售服务 费	-	-	-	96.79	96.79
其他负 债	-	-	-	80,764.21	80,764.21
负债总 计	-	-	-	166,833.68	166,833.68
利率敏	1,156,576.94	-	-	1,327,439.47	2,484,016.41

感度缺口					
上年度末 2024年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,075,333.48	-	-	-	1,075,333.48
结算备付金	2,282.25	-	-	-	2,282.25
存出保证金	94.42	-	-	-	94.42
交易性金融资产	20,256,871.23	83,904,835.24	31,638,604.97	25,701.11	135,826,012.55
买入返售金融资产	38,005,076.72	-	-	-	38,005,076.72
应收申购款	-	-	-	89.94	89.94
资产总计	59,339,658.10	83,904,835.24	31,638,604.97	25,791.05	174,908,889.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,999.49	2,999.49
应付管理人报酬	-	-	-	118,059.25	118,059.25
应付托管费	-	-	-	22,136.12	22,136.12
应付销售服务费	-	-	-	13,119.17	13,119.17
其他负债	-	-	-	184,150.16	184,150.16
负债总计	-	-	-	340,464.19	340,464.19

计					
利率敏 感度缺 口	59,339,658.10	83,904,835.24	31,638,604.97	-314,673.14	174,568,425.17

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
	1.利率上升25个基点	0.00	-1,189,068.85
	2.利率下降25个基点	0.00	1,211,277.02

于本报告期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为0%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日		上年度末 2024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	994,805.00	40.05	25,701.11	0.01
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	994,805.00	40.05	25,701.11	0.01

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日

	沪深300指数上升5%	68,647.88	2,284.15
	沪深300指数下降5%	-68,647.88	-2,284.15

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	994,805.00	25,701.11
第二层次	-	135,800,311.44
第三层次	-	-
合计	994,805.00	135,826,012.55

6.4.14.2.2 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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2025年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2024年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	994,805.00	37.53
	其中：股票	994,805.00	37.53
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	1,156,567.23	43.63
8	其他各项资产	499,477.86	18.84
9	合计	2,650,850.09	100.00

7.2 报告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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	768,535.00	30.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	20,180.00	0.81
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,930.00	0.84
J	金融业	185,160.00	7.45
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	994,805.00	40.05

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601689	拓普集团	2,000	94,500.00	3.80
2	603986	兆易创新	500	63,265.00	2.55
3	600316	洪都航空	1,500	56,550.00	2.28
4	605333	沪光股份	2,000	54,900.00	2.21
5	002409	雅克科技	1,000	54,690.00	2.20

6	000680	山推股份	6,000	53,820.00	2.17
7	002545	东方铁塔	6,000	53,340.00	2.15
8	601881	中国银河	3,000	51,450.00	2.07
9	300750	宁德时代	200	50,444.00	2.03
10	600919	江苏银行	4,000	47,760.00	1.92
11	600036	招商银行	1,000	45,950.00	1.85
12	600160	巨化股份	1,500	43,020.00	1.73
13	601328	交通银行	5,000	40,000.00	1.61
14	002436	兴森科技	3,000	39,720.00	1.60
15	603197	保隆科技	1,000	39,070.00	1.57
16	002028	思源电气	500	36,455.00	1.47
17	002594	比亚迪	100	33,191.00	1.34
18	600150	中国船舶	1,000	32,540.00	1.31
19	600989	宝丰能源	2,000	32,280.00	1.30
20	002170	芭田股份	3,000	30,750.00	1.24
21	300738	奥飞数据	1,000	20,930.00	0.84
22	000963	华东医药	500	20,180.00	0.81

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	601689	拓普集团	96,960.00	0.06
2	603986	兆易创新	61,580.00	0.04
3	605333	沪光股份	56,130.00	0.03
4	000680	山推股份	53,640.00	0.03
5	002545	东方铁塔	52,980.00	0.03
6	601881	中国银河	52,680.00	0.03
7	600316	洪都航空	52,638.00	0.03

8	002409	雅克科技	52,559.00	0.03
9	300750	宁德时代	50,360.00	0.03
10	600919	江苏银行	47,840.00	0.03
11	600036	招商银行	44,300.00	0.03
12	600160	巨化股份	41,472.00	0.02
13	603197	保隆科技	38,700.00	0.02
14	601328	交通银行	38,500.00	0.02
15	002028	思源电气	36,700.00	0.02
16	002436	兴森科技	35,400.00	0.02
17	002594	比亚迪	34,000.00	0.02
18	603228	景旺电子	33,300.00	0.02
19	600989	宝丰能源	33,100.00	0.02
20	600150	中国船舶	32,300.00	0.02

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	603228	景旺电子	37,820.00	0.02
2	601601	中国太保	25,557.00	0.01
3	688691	灿芯股份	17,438.20	0.01
4	301539	宏鑫科技	6,414.97	0.00

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,041,659.00
卖出股票收入（成交）总额	87,230.17

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	9.71
2	应收清算款	499,408.16
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	59.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	499,477.86

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

58 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	201	7,305.38	888.90	0.06%	1,467,492.37	99.94%
中科 沃土 沃嘉 混合C	403	1,185.03	0.00	0.00%	477,568.01	100.00%
合计	604	3,221.77	888.90	0.05%	1,945,060.38	99.95%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截至本报告期末，本公司的从业人员未持有本开放式基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资、研究部门负责人和本基金基金经理未持有本开放式基金份额。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	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06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	75,405,540.28	62,059,266.33
本报告期基金总申购份额	43,449.07	123,731.48
减：本报告期基金总赎回份额	73,980,608.08	61,705,429.80
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,468,381.27	477,568.01

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金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，本基金管理人及本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.6.2 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，本基金托管人及其托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

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	
华创证券	1	717,237.00	63.53%	334.16	63.54%	-
长江证券	2	411,652.17	36.47%	191.75	36.46%	-
华西证券	2	-	-	-	-	-

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华创证券	-	-	165,240,000.00	58.34%	-	-	-	-
长江证券	-	-	118,000,000.00	41.66%	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金2024年第四季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025-01-21
2	中科沃土基金管理有限公司关于新增盈米基金为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-01-22
3	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	中国证监会规定报刊及网站	2025-01-22
4	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-06
5	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-08
6	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-08
7	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-08
8	中科沃土基金管理有限公司关于变更上海分公司地址的	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-27

	公告		
9	中科沃土基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年度）	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-31
10	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金2024年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-31
11	中科沃土基金管理有限公司关于新增攀赢基金为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-04-15
12	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金2025年第一季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025-04-22
13	中科沃土基金管理有限公司关于新增上海联泰基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-05-28
14	中科沃土基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理基金相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-05-28
15	中科沃土基金管理有限公司关于新增上海天天基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-06-18
16	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-06-26
17	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新C类份额	中国证监会规定报刊及网站	2025-06-28
18	中科沃土沃嘉灵活配置混合	中国证监会规定报刊及网站	2025-06-28

	型证券投资基金基金产品资料概要更新A类份额		
19	中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定报刊及网站	2025-06-28

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20250101 - 20250521	31,105,860.98	0.00	31,105,860.98	0.00	0.00%
	2	20250101 - 20250514	73,705,117.41	0.00	73,705,117.41	0.00	0.00%
	3	20250101 - 20250303	30,517,663.41	0.00	30,517,663.41	0.00	0.00%
	4	20250325 - 20250514	30,517,663.41	0.00	30,517,663.41	0.00	0.00%
个人	1	20250522 - 20250630	994,687.84	0.00	0.00	994,687.84	51.12%
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；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。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。							

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
2. 《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《中科沃土沃嘉灵活配置混合型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. 关于申请募集注册中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书；

6. 中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中科沃土基金管理有限公司

二〇二五年八月二十九日