

# 中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 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:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 31 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月30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2023年1月1日至2023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	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	48

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
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 .....	49
§9 开放式基金份额变动 .....	49
§10 重大事件揭示 .....	50
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	52
§11 备查文件目录 .....	54
11.1 备查文件目录 .....	54
11.2 存放地点 .....	55
11.3 查阅方式 .....	55

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中科沃土转型升级混合	
基金主代码	005281	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年01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	8,359,218.87份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中科沃土转型升级混合A	中科沃土转型升级混合C
下属分级基金的交易代码	005281	018660
报告期末下属分级基金的份额总额	8,359,217.85份	1.02份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，把握中国经济转型升级过程中所蕴含的投资机会，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。
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	李峰	郭明
	联系电话	0757-86208608	010-66105799
	电子邮箱	lifeng0214@richlandasm.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-018-3610	95588
传真		0757-86208604	010-66105798
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）	北京市西城区复兴门内大街55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）	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		528200	100140
法定代表人		智会杰	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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.richlandasm.com.cn">http://www.richlandasm.com.cn</a>
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 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	中科沃土转型升级 混合A	中科沃土转型升级 混合C
本期已实现收益	-527,243.64	-
本期利润	-524,470.72	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0574	-
本期加权平均净值利润率	-5.57%	-
本期基金份额净值增长率	-5.72%	0.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	-167,525.33	-0.02
期末可供分配基金份额利润	-0.0200	-0.0196
期末基金资产净值	8,191,692.52	1.00
期末基金份额净值	0.9800	0.9804
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-2.00%	0.46%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

4、本基金自2023年6月29日起增设C类份额。

### 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

中科沃土转型升级混合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	0.17%	0.61%	0.68%	0.43%	-0.51%	0.18%
过去三个月	-7.13%	0.62%	-2.10%	0.41%	-5.03%	0.21%
过去六个月	-5.72%	0.62%	0.34%	0.42%	-6.06%	0.20%
过去一年	-5.44%	0.63%	-6.53%	0.49%	1.09%	0.14%
过去三年	-18.16%	1.44%	-1.21%	0.60%	-16.95%	0.84%
自基金合同 生效起至今	-2.00%	1.48%	0.95%	0.63%	-2.95%	0.85%

中科沃土转型升级混合C

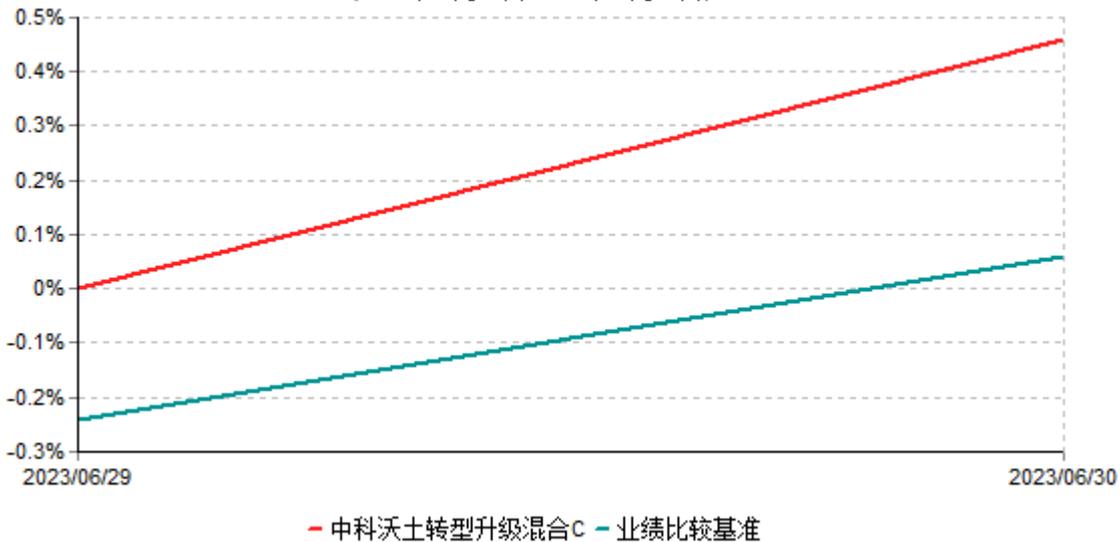
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
自基金合同 生效起至今	0.46%	0.33%	0.06%	0.37%	0.40%	-0.04%

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

中科沃土转型升级混合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  
(2018年01月25日-2023年06月30日)



中科沃土转型升级混合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  
(2023年06月29日-2023年06月30日)



注：本基金自2023年6月29日起增设C类份额。

## §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2023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		
孟禄程	权益研究部副总经理（主持工作）	2019-11-08	-	7年	理学硕士，曾任广东东阳光药业研究院研发工程师，广东中科招商创业投资管理有限公司公募筹备组组员，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”为公告确定的聘任日期。

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

2023年上半年的A股，有涨有跌结构分化。板块之间的分化较大，TMT上涨较明显，截至6月30日，通信、传媒、计算机涨幅均超过27%。然而食品饮料、医药等消费板块自2月下旬开始持续调整，受权重影响，沪深300指数年初至今基本持平未取得正收益。这一结果的出现主要是宏观经济与中观产业趋势联合作用产生。宏观经济在一季度脉冲式复苏后边际走弱，出口逐步走弱，消费受多因素影响复苏低于预期，出现消费降级现象，这导致顺经济周期板块持续调整。在经济亮点较少的背景下，中观产业ChatGPT的面世与创新性吸引了市场的目光，伴随着产业上各类AI模型的发布、硬件建设与应用的探索，TMT板块走出了趋势性上涨行情。

报告期内本基金采用中性仓位运作，在市场分化行情下对TMT板块仓位保守未能取得正收益，后续我们也将加强行业研究与改进投资体系来更好适应多变的市场。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中科沃土转型升级混合A基金份额净值为0.9800元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.72%，同期业绩比较基准收益率为0.34%；截至报告期末中科沃土转型升级混合C基金份额净值为0.9804元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.46%，同期业绩比较基准收益率为0.06%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

考虑到目前权益市场悲观要素讨论比较充分，这也导致权益市场处于历史相对低位，市场或将进入反应经济新的边际变化阶段。展望下半年，经济刺激政策落地有望加速与显现效果，7月份政治局会议显示出对经济与产业结构的发展思路。因此我们对权益市场保持乐观，建议投资上也保持定力，坚持投资体系，逢低加大权益配置。重点关注以下方面：

- 1) ChatGPT平台及其与行业应用结合带来的生产力变革机遇下的投资机会；
- 2) 大安全（信创、半导体、机械设备）；
- 3) 中国特色估值体系与“一带一路”（央企、建筑）；
- 4) 估值性价比较高的顺周期板块。

#### 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

本基金本报告期内未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

#### 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，本基金存在连续六十个工作日以上基金资产净值低于五千万元的情形，已向监管部门提交解决方案。

## §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，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、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期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本基金2023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：中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,829,530.28	4,078,771.46
结算备付金		51,273.12	73,760.21
存出保证金		6,972.48	5,790.50
交易性金融资产	6.4.7.2	5,358,992.60	6,064,278.00
其中：股票投资		5,358,992.60	6,064,278.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	699,794.03
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,078.42	807.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		8,247,846.90	10,923,201.26
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	754,773.46
应付赎回款		4,045.49	11,896.84
应付管理人报酬		10,098.05	12,929.62
应付托管费		1,683.00	2,154.92
应付销售服务费		-	-
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	6.4.7.6	40,326.84	63,778.37
负债合计		56,153.38	845,533.21
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	8,359,218.87	9,694,619.95
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-167,525.35	383,048.10
净资产合计		8,191,693.52	10,077,668.05
负债和净资产总计		8,247,846.90	10,923,201.26

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额总额8,359,218.87份，其中A类基金份额净值0.9800元，A类基金份额8,359,217.85份；C类基金份额净值0.9804元，C类基金份额1.02份。

## 6.2 利润表

会计主体：中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		-426,978.01	-841,613.09
1.利息收入		6,802.85	27,114.69
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,972.72	12,385.54
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		830.13	14,729.15
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-439,070.49	-784,877.78

其中：股票投资收益	6.4.7.10	-476,307.19	-796,304.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	150.78
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	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	37,236.70	11,276.38
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.16	2,772.92	-116,643.42
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	2,516.71	32,793.42
<b>减：二、营业总支出</b>		97,492.71	111,574.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	70,275.72	82,007.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	11,712.60	13,667.88
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	15,504.39	15,899.39
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		-524,470.72	-953,187.43
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-524,470.72	-953,187.43
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-524,470.72	-953,187.43

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	9,694,619.95	-	383,048.10	10,077,668.05
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	9,694,619.95	-	383,048.10	10,077,668.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,335,401.08	-	-550,573.45	-1,885,974.53
（一）、综合收益总额	-	-	-524,470.72	-524,470.72
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减	-1,335,401.08	-	-26,102.73	-1,361,503.81

少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	520,624.91	-	8,734.27	529,359.18
2.基金赎回款	-1,856,025.99	-	-34,837.00	-1,890,862.99
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	8,359,218.87	-	-167,525.35	8,191,693.52
项目	上年度可比期间			
	2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	13,977,043.15	-	1,560,355.58	15,537,398.73
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	13,977,043.15	-	1,560,355.58	15,537,398.73
三、本期增减变	-5,286,216.41	-	-1,244,209.59	-6,530,426.00

动额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	-953,187.43	-953,187.43
（二）、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）	-5,286,216.41	-	-291,022.16	-5,577,238.57
其中：1.基金申购款	2,651,018.73	-	174,316.43	2,825,335.16
2.基金赎回款	-7,937,235.14	-	-465,338.59	-8,402,573.73
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	8,690,826.74	-	316,145.99	9,006,972.73

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：

智会杰

智会杰

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

中科沃土转型升级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1484号关于准予《中科沃土转型升级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《中科沃土转型升级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252,803,465.23元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2018)验字第61247680\_G01号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2018年1月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为252,921,526.43份基金份额,其中认购资金利息折合118,061.20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股份有限公司(以下简称"中国工商银行")。

根据中科沃土基金管理有限公司于2023年6月29日发布的《关于中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》,自2023年6月29日起本基金增加C类基金份额。

根据《中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书》,本基金根据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。在投资人申购时收取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《中科沃土转型升级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的股票(含主板、中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票等)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工。其中,股票投资比例为基金资产的0%-95%,其中,投资于转型升级主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和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。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率 $\times$ 50%+中债综合全价(总值)指数收益率 $\times$ 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》、《中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于2023年6月30日，本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍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2023年6月30日的财务状况以及2023上半年度的经营成果和基金净值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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023年06月30日
活期存款	2,829,530.28
等于：本金	2,829,232.42
加：应计利息	297.86
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	2,829,530.28

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	5,416,319.31	-	5,358,992.60	-57,326.71
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	5,416,319.31	-	5,358,992.60	-57,326.71

### 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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4.78
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	25,445.67
其中：交易所市场	25,445.67
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	14,876.39
合计	40,326.84

### 6.4.7.7 实收基金

#### 6.4.7.7.1 中科沃土转型升级混合A

金额单位：人民币元

项目 (中科沃土转型升级混合A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,694,619.95	9,694,619.95
本期申购	520,623.89	520,623.89
本期赎回（以“-”号填列）	-1,856,025.99	-1,856,025.99
本期末	8,359,217.85	8,359,217.85

#### 6.4.7.7.2 中科沃土转型升级混合C

金额单位：人民币元

项目 (中科沃土转型升级混合C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	1.02	1.02
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1.02	1.02

注：本基金自2023年6月29日起增设C类份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 中科沃土转型升级混合A

单位：人民币元

项目 (中科沃土转型升级混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	3,795,754.32	-3,412,706.22	383,048.10
本期利润	-527,243.64	2,772.92	-524,470.72
本期基金份额交易产生的变动数	-500,243.97	474,141.26	-26,102.71
其中：基金申购款	190,925.20	-182,190.91	8,734.29
基金赎回款	-691,169.17	656,332.17	-34,837.00
本期已分配利润	-	-	-

本期末	2,768,266.71	-2,935,792.04	-167,525.33
-----	--------------	---------------	-------------

#### 6.4.7.8.2 中科沃土转型升级混合C

单位：人民币元

项目 (中科沃土转型升级混 合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-	-	-
本期基金份额交易产 生的变动数	-0.02	-	-0.02
其中：基金申购款	-0.02	-	-0.02
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-0.02	-	-0.02

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	5,465.71
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	447.31
其他	59.70
合计	5,972.72

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	32,761,819.99

减：卖出股票成本总额	33,152,638.81
减：交易费用	85,488.37
买卖股票差价收入	-476,307.19

#### 6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	37,236.70
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	37,236.70

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	2,772.92
——股票投资	2,772.92
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,772.92

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	2,516.71
合计	2,516.71

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。

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	628.00
合计	15,504.39

### 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
中国工商银行股份有限公司（"中国工商银行"）	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

本基金本报告期及上年度可比期间无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

本基金本报告期及上年度可比期间无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

本基金本报告期及上年度可比期间无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

本基金本报告期及上年度可比期间无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

本基金本报告期及上年度可比期间无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

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	70,275.72	82,007.07
其中：支付销售机构的客户维护费	27,461.43	36,561.22

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。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	11,712.60	13,667.88

注：支付基金托管人中国工商银行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。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：1、本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

2、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0.30%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 X 0.30%/ 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未出现除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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
中国工商银行	2,829,530.28	5,465.71	5,652,398.79	10,914.93

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023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从事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、风险管理部、合规稽核部、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 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有债券。

### 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 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

#### 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6.4.12。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%。

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。

#### 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,829,530.28	-	-	-	2,829,530.28
结算备付金	51,273.12	-	-	-	51,273.12
存出保证金	6,972.48	-	-	-	6,972.48
交易性金融资产	-	-	-	5,358,992.60	5,358,992.60
应收申购款	-	-	-	1,078.42	1,078.42
资产总计	2,887,775.88	-	-	5,360,071.02	8,247,846.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,045.49	4,045.49
应付管理人报酬	-	-	-	10,098.05	10,098.05
应付托管费	-	-	-	1,683.00	1,683.00
其他负债	-	-	-	40,326.84	40,326.84
负债总计	-	-	-	56,153.38	56,153.38
利率敏感度缺口	2,887,775.88	-	-	5,303,917.64	8,191,693.52
上年度末 2022年1 2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	4,078,771.46	-	-	-	4,078,771.46
结算备付金	73,760.21	-	-	-	73,760.21

存出保证金	5,790.50	-	-	-	5,790.50
交易性金融资产	-	-	-	6,064,278.00	6,064,278.00
买入返售金融资产	699,794.03	-	-	-	699,794.03
应收申购款	-	-	-	807.06	807.06
资产总计	4,858,116.20	-	-	6,065,085.06	10,923,201.26
负债					
应付清算款	-	-	-	754,773.46	754,773.46
应付赎回款	-	-	-	11,896.84	11,896.84
应付管理人报酬	-	-	-	12,929.62	12,929.62
应付托管费	-	-	-	2,154.92	2,154.92
其他负债	-	-	-	63,778.37	63,778.37
负债总计	-	-	-	845,533.21	845,533.21
利率敏感度缺口	4,858,116.20	-	-	5,219,551.85	10,077,668.05

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

于2023年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2022年12月31日：0%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022年12月31日：同)。

#### 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资产的0%-95%，其中，投资于转型升级主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和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 2023年06月30日		上年度末 2022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	5,358,992.60	65.42	6,064,278.00	60.18
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	5,358,992.60	65.42	6,064,278.00	60.18

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	97,058.15	323,041.96
	业绩比较基准下降5%	-97,058.15	-323,041.96

#### 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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	5,358,992.60	6,064,278.00
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	5,358,992.60	6,064,278.00

#### 6.4.14.2 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2023年6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(2022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	5,358,992.60	64.97
	其中：股票	5,358,992.60	64.97
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	2,880,803.40	34.93
8	其他各项资产	8,050.90	0.10
9	合计	8,247,846.90	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	266,500.00	3.25
C	制造业	3,080,282.00	37.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	148,410.00	1.81
F	批发和零售业	515,749.00	6.30
G	交通运输、仓储和邮政业	353,805.00	4.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	620,646.60	7.58
J	金融业	-	-
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	373,600.00	4.56
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	5,358,992.60	65.42

## 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	300668	杰恩设计	16,000	373,600.00	4.56
2	603043	广州酒家	13,000	367,380.00	4.48
3	000513	丽珠集团	9,000	350,190.00	4.27
4	603993	洛阳钼业	50,000	266,500.00	3.25
5	301015	百洋医药	9,200	255,392.00	3.12
6	301263	泰恩康	12,100	252,648.00	3.08
7	002252	上海莱士	32,200	241,822.00	2.95
8	688772	珠海冠宇	12,000	241,800.00	2.95
9	002930	宏川智慧	10,500	239,085.00	2.92
10	300037	新宙邦	4,500	233,505.00	2.85
11	002555	三七互娱	6,000	209,280.00	2.55
12	603806	福斯特	5,000	185,950.00	2.27
13	603345	安井食品	1,000	146,800.00	1.79
14	601800	中国交建	13,000	141,830.00	1.73
15	603051	鹿山新材	3,000	140,490.00	1.72
16	000063	中兴通讯	3,000	136,620.00	1.67
17	600584	长电科技	4,000	124,680.00	1.52
18	002439	启明星辰	4,000	119,040.00	1.45
19	600004	白云机场	8,000	114,720.00	1.40
20	688779	长远锂科	10,000	112,700.00	1.38
21	603517	绝味食品	3,000	111,450.00	1.36
22	002092	中泰化学	17,000	109,650.00	1.34
23	688777	中控技术	1,670	104,842.60	1.28

24	300452	山河药辅	6,000	104,640.00	1.28
25	688680	海优新材	800	97,456.00	1.19
26	300685	艾德生物	4,000	97,040.00	1.18
27	688111	金山办公	200	94,444.00	1.15
28	605007	五洲特纸	6,000	90,960.00	1.11
29	002424	贵州百灵	10,000	89,800.00	1.10
30	605186	健麾信息	1,600	79,200.00	0.97
31	002230	科大讯飞	1,000	67,960.00	0.83
32	601360	三六零	2,000	25,080.00	0.31
33	002020	京新药业	1,000	12,820.00	0.16
34	600976	健民集团	100	7,709.00	0.09
35	000032	深桑达 A	200	6,580.00	0.08
36	300779	惠城环保	100	5,329.00	0.07

## 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	002439	启明星辰	1,081,115.00	10.73
2	600161	天坛生物	842,514.00	8.36
3	002230	科大讯飞	795,507.00	7.89
4	000403	派林生物	754,003.00	7.48
5	300481	濮阳惠成	752,595.00	7.47
6	601390	中国中铁	701,180.00	6.96
7	300383	光环新网	646,933.00	6.42
8	000032	深桑达 A	643,384.00	6.38
9	603658	安图生物	628,512.00	6.24
10	603993	洛阳钼业	596,550.00	5.92
11	601800	中国交建	580,110.00	5.76
12	600845	宝信软件	542,403.40	5.38

13	002675	东诚药业	536,998.00	5.33
14	300685	艾德生物	534,749.00	5.31
15	688777	中控技术	534,644.22	5.31
16	002555	三七互娱	534,277.00	5.30
17	301015	百洋医药	513,367.00	5.09
18	688779	长远锂科	510,842.29	5.07
19	603833	欧派家居	507,426.00	5.04
20	603345	安井食品	498,189.00	4.94
21	688772	珠海冠宇	489,451.86	4.86
22	002930	宏川智慧	484,882.00	4.81
23	600754	锦江酒店	463,576.00	4.60
24	688111	金山办公	456,314.00	4.53
25	002020	京新药业	416,410.00	4.13
26	301263	泰恩康	410,375.00	4.07
27	688012	中微公司	405,984.38	4.03
28	300294	博雅生物	404,084.00	4.01
29	603043	广州酒家	389,745.00	3.87
30	600085	同仁堂	388,978.00	3.86
31	300668	杰恩设计	377,343.00	3.74
32	002988	豪美新材	374,782.00	3.72
33	688227	品高股份	372,371.58	3.70
34	600183	生益科技	369,359.00	3.67
35	600703	三安光电	369,172.88	3.66
36	300832	新产业	366,004.00	3.63
37	601899	紫金矿业	357,980.00	3.55
38	301018	申菱环境	356,930.00	3.54
39	603688	石英股份	350,215.00	3.48
40	000513	丽珠集团	349,854.00	3.47
41	300628	亿联网络	345,136.00	3.42
42	000739	普洛药业	322,533.00	3.20
43	002291	遥望科技	312,487.00	3.10

44	300452	山河药辅	301,018.00	2.99
45	605186	健麾信息	286,615.00	2.84
46	300010	*ST豆神	276,200.00	2.74
47	000539	粤电力 A	267,227.00	2.65
48	688601	力芯微	255,928.07	2.54
49	002129	TCL中环	250,286.00	2.48
50	002252	上海莱士	245,535.00	2.44
51	300207	欣旺达	242,630.00	2.41
52	002511	中顺洁柔	236,272.00	2.34
53	300037	新宙邦	235,576.00	2.34
54	688369	致远互联	227,427.80	2.26
55	601857	中国石油	226,000.00	2.24
56	301101	明月镜片	225,935.00	2.24
57	002027	分众传媒	223,140.00	2.21
58	688315	诺禾致源	222,428.44	2.21
59	002529	海源复材	216,460.00	2.15
60	603985	恒润股份	214,500.00	2.13
61	300738	奥飞数据	211,925.80	2.10
62	000831	中国稀土	205,480.00	2.04

注：买入金额按买入成交金额（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	600161	天坛生物	1,225,190.60	12.16
2	000403	派林生物	1,088,119.00	10.80
3	002439	启明星辰	966,766.00	9.59
4	300481	濮阳惠成	887,988.00	8.81
5	600754	锦江酒店	836,640.00	8.30
6	002230	科大讯飞	806,214.00	8.00

7	002930	宏川智慧	803,578.00	7.97
8	002675	东诚药业	787,537.05	7.81
9	601390	中国中铁	719,433.80	7.14
10	300383	光环新网	707,600.00	7.02
11	000032	深桑达 A	640,474.00	6.36
12	603345	安井食品	635,427.00	6.31
13	603658	安图生物	619,075.00	6.14
14	600845	宝信软件	617,770.20	6.13
15	300294	博雅生物	588,691.00	5.84
16	688012	中微公司	536,180.80	5.32
17	688779	长远锂科	515,055.18	5.11
18	300207	欣旺达	511,748.00	5.08
19	002988	豪美新材	507,670.00	5.04
20	603833	欧派家居	492,632.00	4.89
21	601800	中国交建	436,130.00	4.33
22	688777	中控技术	423,292.00	4.20
23	688111	金山办公	394,700.00	3.92
24	688227	品高股份	392,377.19	3.89
25	300685	艾德生物	390,618.00	3.88
26	002555	三七互娱	374,872.00	3.72
27	300832	新产业	373,769.00	3.71
28	688315	诺禾致源	372,261.05	3.69
29	600085	同仁堂	371,752.00	3.69
30	002027	分众传媒	368,440.00	3.66
31	600183	生益科技	366,100.00	3.63
32	300015	爱尔眼科	355,983.00	3.53
33	301018	申菱环境	354,088.00	3.51
34	601899	紫金矿业	348,622.00	3.46
35	600703	三安光电	340,700.00	3.38
36	300438	鹏辉能源	338,952.00	3.36
37	002352	顺丰控股	337,124.00	3.35

38	002020	京新药业	336,671.00	3.34
39	002511	中顺洁柔	332,400.00	3.30
40	300628	亿联网络	322,552.00	3.20
41	603688	石英股份	308,208.00	3.06
42	300068	南都电源	300,284.00	2.98
43	603993	洛阳钼业	299,460.00	2.97
44	688369	致远互联	286,924.00	2.85
45	002291	遥望科技	282,528.00	2.80
46	301162	国能日新	278,106.32	2.76
47	002475	立讯精密	275,832.00	2.74
48	000739	普洛药业	274,681.00	2.73
49	301101	明月镜片	271,770.00	2.70
50	605186	健麾信息	251,248.00	2.49
51	688772	珠海冠宇	249,801.48	2.48
52	688601	力芯微	249,314.80	2.47
53	301011	华立科技	238,776.00	2.37
54	000539	粤电力 A	237,706.00	2.36
55	002529	海源复材	230,978.00	2.29
56	301015	百洋医药	230,267.00	2.28
57	601857	中国石油	220,000.00	2.18
58	300738	奥飞数据	215,200.00	2.14
59	603517	绝味食品	207,064.00	2.05

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 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	32,444,580.49
卖出股票收入（成交）总额	32,761,819.99

注：买卖金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 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

本基金本报告期末投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

### 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	6,972.48
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,078.42
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,050.90

#### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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。

### §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
中科沃土转型升级混合A	2,041	4,095.65	1,332,169.16	15.94%	7,027,048.69	84.06%
中科沃土转型升级混合C	1	1.02	0.00	0.00%	1.02	100.00%
合计	2,0	4,093.64	1,332,169.16	15.9	7,027,049.71	84.06%

	42			4%	
--	----	--	--	----	--

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中科沃土转型升级混合A	13,231.18	0.16%
	中科沃土转型升级混合C	1.02	100.00%
	合计	13,232.20	0.16%

### 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

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	中科沃土转型升级 混合A	0
	中科沃土转型升级 混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	中科沃土转型升级 混合A	0~10
	中科沃土转型升级 混合C	0
	合计	0~10

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	中科沃土转型升级混合 A	中科沃土转型升级混合 C
基金合同生效日(2018年01月25 日)基金份额总额	252,921,526.43	-
本报告期期初基金份额总额	9,694,619.95	-

本报告期基金总申购份额	520,623.89	1.02
减：本报告期基金总赎回份额	1,856,025.99	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	8,359,217.85	1.02

注：本基金自2023年6月29日起增设C类份额。

## §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，自2023年6月19日起，杨绍基不再担任本基金管理人第三届董事会非独立董事，同时辞任副董事长职务。自2023年6月26日起，本基金管理人新聘任李峰为督察长、合规负责人，曹萍不再担任督察长、合规负责人。

本报告期内，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

#### 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相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	65,091,840.48	100.00%	47,602.00	100.00%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	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。

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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	6,400,000.00	100.00%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	中科沃土转型升级灵活配置	证券时报及基金管理人网站	2023-01-20

	混合型证券投资基金2022年第四季度报告		
2	中科沃土基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	证券时报及基金管理人网站	2023-01-20
3	中科沃土基金管理有限公司关于新增华泰期货为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及基金管理人网站	2023-03-22
4	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的公告	证券时报及基金管理人网站	2023-03-27
5	中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金2022年年度报告	证券时报及基金管理人网站	2023-03-30
6	中科沃土基金管理有限公司关于新增普益基金为旗下基金销售机构的公告	证券时报及基金管理人网站	2023-04-05
7	中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金2023年第一季度报告	证券时报及基金管理人网站	2023-04-22
8	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的公告	证券时报及基金管理人网站	2023-04-28
9	中科沃土基金管理有限公司关于新增同花顺为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及基金管理人网站	2023-05-12
10	中科沃土基金管理有限公司关于调整公司客户服务热线人工服务时间的公告	证券时报及基金管理人网站	2023-05-29
11	中科沃土基金管理有限公司关于董事变更的公告	证券时报及基金管理人网站	2023-06-20
12	中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证券时报及基金管理人网站	2023-06-21

13	中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	证券时报及基金管理人网站	2023-06-21
14	中科沃土基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证券时报及基金管理人网站	2023-06-27
15	中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	证券时报及基金管理人网站	2023-06-29
16	中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金托管协议更新	证券时报及基金管理人网站	2023-06-29
17	中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金合同更新	证券时报及基金管理人网站	2023-06-29
18	关于中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告	证券时报及基金管理人网站	2023-06-29
19	中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	证券时报及基金管理人网站	2023-06-29
20	中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	证券时报及基金管理人网站	2023-06-29

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
2. 《中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《中科沃土转型升级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. 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转型升级灵活配置混合型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。

### **11.2 存放地点**

基金管理人、基金托管人处。

### **11.3 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  
二〇二三年八月三十一日