

中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：众盈基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 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	6
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	10
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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
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	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	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	43
§ 8 基金份额持有人信息.....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 盈利投资者数量占比.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	44
§ 9 开放式基金份额变动.....	44
§ 10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	45
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
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.....	49
§ 12 影响投资者决策的备查文件目录.....	49
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	中科沃土沃瑞混合发起	
基金主代码	005855	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 1 月 14 日	
基金管理人	众盈基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	6,540,974.94 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分类基金的基金简称	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C
下属分类基金的交易代码	005855	005856
报告期末下属分类基金的份额总额	3,455,122.48 份	3,085,852.46 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过系统化的方法精选环境、财务可持续的上市公司，通过精选个股和风险控制，力争为投资者创造超越业绩比较基准的回报。
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×60%+中债综合指数(全价)收益率×40%
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、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		众盈基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李峰	方圆
	联系电话	0757-86208608	95559
	电子邮箱	lifeng0214@allwinfund.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-018-3610	95559
传真		0757-86208604	021-62701216
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)	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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)	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	528200	200336
法定代表人	钟光正	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.allwinfund.com.cn
基金中期报告置备地点	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	众盈基金管理有限公司	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

基金类别	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）	报告期（2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	1,491,017.58	1,219,949.34
本期利润	405,941.42	203,297.98
加权平均基金份额本期利润	0.0979	0.0549
本期加权平均净值利润率	2.98%	1.75%
本期基金份额净值增长率	0.55%	0.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 6 月 30 日）	
期末可供分配利润	6,963,481.03	5,778,265.86
期末可供分配基金份额利润	2.0154	1.8725
期末基金资产净值	10,418,603.51	8,864,118.32
期末基金份额净值	3.0154	2.8725
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 6 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	201.54%	187.25%

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。

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

中科沃土沃瑞混合发起 A

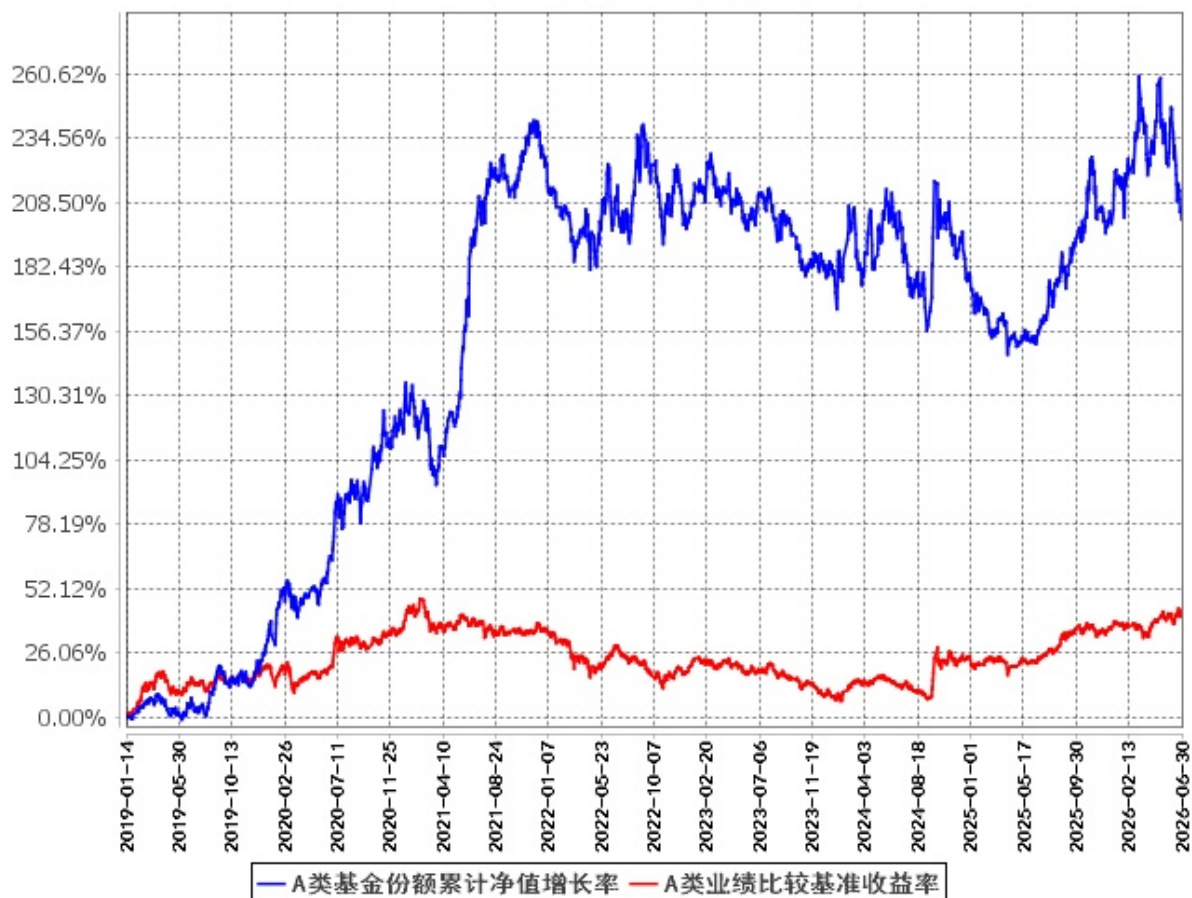
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	-8.08%	1.47%	7.36%	0.76%	-15.44%	0.71%
过去六个月	0.55%	1.50%	5.03%	0.68%	-4.48%	0.82%
过去一年	16.82%	1.28%	15.25%	0.61%	1.57%	0.67%
过去三年	-1.77%	1.23%	20.53%	0.66%	-22.30%	0.57%
过去五年	1.46%	1.18%	2.28%	0.66%	-0.82%	0.52%
过去七年	188.64%	1.28%	25.36%	0.69%	163.28%	0.59%
自基金合同 生效起至今	201.54%	1.26%	42.66%	0.71%	158.88%	0.55%

中科沃土沃瑞混合发起 C

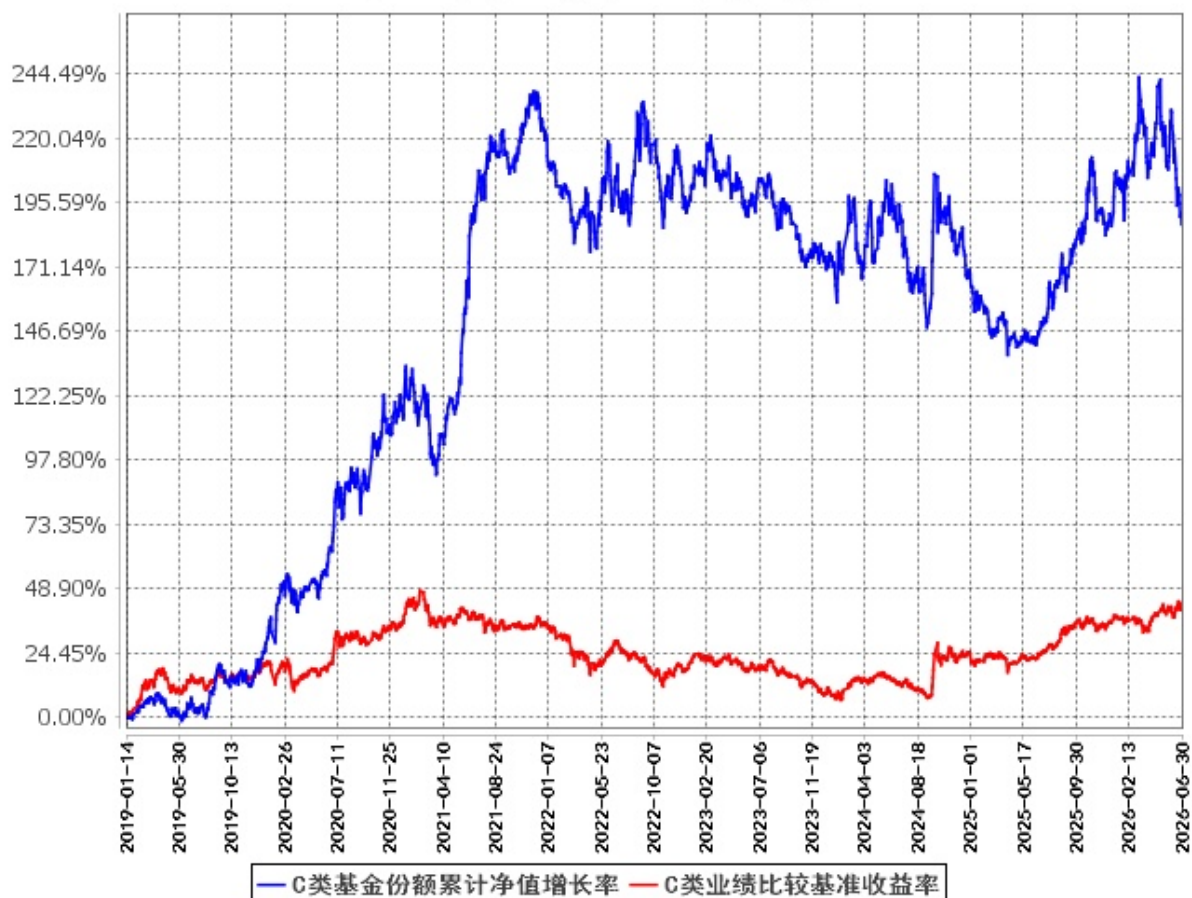
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	-8.24%	1.47%	7.36%	0.76%	-15.60%	0.71%
过去六个月	0.22%	1.50%	5.03%	0.68%	-4.81%	0.82%
过去一年	16.02%	1.28%	15.25%	0.61%	0.77%	0.67%
过去三年	-4.10%	1.23%	20.53%	0.66%	-24.63%	0.57%
过去五年	-2.33%	1.18%	2.28%	0.66%	-4.61%	0.52%
过去七年	175.96%	1.28%	25.36%	0.69%	150.60%	0.59%
自基金合同 生效起至今	187.25%	1.26%	42.66%	0.71%	144.59%	0.55%

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

A类基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2019年1月14日至2026年6月30日)



C类基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2019年1月14日至2026年6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

众盈基金管理有限公司获证监会证监许可【2015】1937号文批准，于2015年9月6日正式成立，公司注册资本2.42亿元，是国内第100家公募基金管理公司。经营范围包括公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理等业务。2021年12月，众盈基金总部整体搬迁至佛山市南海区千灯湖创投小镇，成为佛山市唯一持牌公募基金管理机构。众盈基金始终贯彻“为持有人创造长期价值、为股东创造稳定回报、为员工创造持续发展空间”的治理理念，坚持诚信、规范、稳健的经营方针，以“服务最广大持有人”为核心定位，聚焦不同客户的差异化需求，提供专业、精品、创新的理财服务，致力于成为广受投资者信赖的公募品牌和优秀卓越的综合型财富管理平台。截至2026年6月30日，众盈基金旗下共管理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		
徐伟	公募投 资部基 金经理	2022 年 3 月 1 日	-	14 年	工学硕士。曾任宏源证券研究所分析师，中信建投证券研究发展部首席分析师，上海磐信投资有限公司金融市场部高级研究员，众盈基金管理有限公司研究部资深研究员，现任众盈基金管理有限公司旗下中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金和中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式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”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

2026 年上半年，国内宏观经济仍然显示出了一定的韧性。各月份的制造业 PMI 分别为 49.3%、49.0%、50.4%、50.3%、50.0%、50.3%，自 3 月份开始 PMI 维持在扩张区间以上。2026 年上半年的出口总值实现了较快增长，在宏观经济三驾马车中表现比较突出，各月份出口总金额同比分别实现了 10%、39.6%、2.5%、14.0%、19.2%、26.9% 的增长，增速较高且在二季度逐步上行，我们认为主要原因是美伊冲突发生后，海外部分供应链受到冲击，转而向中国进行采购，虽然后续可能还有美方提高关税等贸易摩擦带来的不确定性，但我们仍然能预计 2026 年下半年的出口形势同比会有所好转。在消费方面，1~2 月的社会消费品零售总额增长是 2.8%，上半年后续各月份的社零总额分别是增长 1.70%、增长 0.20%、下降 0.60%、增长 1.00%，增长速度仍然处于下降趋势中，期待后续支持消费的政策能加大力度，产生更显著的拉动作用。在固定资产投资领域，房地产投资的下滑仍然是拖累投资增速的主要因素，基建投资的增长速度也开始出现下降。整体看我们认为国内宏观经济仍然处于逐步复苏的进程。

2026 年上半年国外宏观环境发生了微妙的变化，美联储依然维持利率不变，但加息预期开始上升，新的美联储主席沃什上台后也相对偏鹰派。从 2 月底美国以色列与伊朗爆发冲突刺激国际原油价格上涨以来，给欧美发达经济体带来再次通胀的隐忧，但目前看还不足以改变美联储的货币宽松进程。同时在中国较强的出口增长背景下，人民币也开启了升值进程，为国内货币政策的制定提供了较宽松的外部货币环境。

2026 年上半年国内的需求出现一些复苏迹象，国内 PPI 同比由降转升。主要原因是美伊冲突的爆发刺激了国际原油价格快速上涨，带动成品油与大部分化工产品价格转为上涨。另外国内的“反内卷”政策持续发力，开始显现效果，叠加需求较稳定，部分工业品价格企稳回升。PPI 同比转为正增长，有利于上市公司利润的增长、盈利能力的提升，对股票市场的上涨起到正面的作用。

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瑞混合发起 A 的基金份额净值为 3.0154 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.55%；截至本报告期末中科沃土沃瑞混合发起 C 的基金份额净值为 2.8725 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.22%；同期业绩比较基准收益率为 5.03%。

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 2026 年下半年我们认为，虽然有外部环境的不确定因素，但中国受到的影响相对较小，宏观经济有望维持稳定运行，大盘指数的走势主要取决于上市公司后续的业绩增长。通过学习两会的精神，我们认为在 2026 年三季度，经济政策尤其是财政政策的总基调偏积极、力度较大，国债和地方政府专项债的发行可能会靠前发力，对“两重”、“两新”项目的支持也会继续，尤其是对人工智能数据中心等领域的政策支持会持续发力，从而稳住 2026 年下半年的经济增长率。

同时相对于市场大盘，我们认为结构性机会或许更大，我们主要的工作将致力于挖掘业绩表现较好且估值较低的子行业与个股。我们的核心策略依然是精选优质公司，希望通过较长期持有权益市场上的优质标的，从而分享公司的业绩增长，为投资者创造价值。根据之前的研究，我们关注以下行业的机会：

1. 煤炭：在保供政策支持下，预计国内煤炭产量维持高位，但因为之前安全形势较严峻，部分东部、中部煤矿面临资源枯竭的风险，煤炭产量可能会有所下降，市场煤价格出现大幅度下跌的可能性也不大，整体上判断煤炭市场价格以偏高位稳定为主。从全球范围来看，煤炭的新增产能投放有限，存量产能的生产成本也在上升，海外煤价下跌的空间也比较有限。由于目前煤炭行业估值还较低，股息率较高，我们认为其中的优质公司仍有较大的投资价值。

2. 电力设备与新能源：国内新能源新增并网容量始终保持在较高水平，接入与消纳问题逐渐变得严峻，为此国家能源局主导出台了相关政策，2025 年 6 月份之后并网的新能源电力统一进入电力市场交易，在新型电力系统的框架下，提振了对电力系统调节资源的需求，预计对于调峰、调频有帮助的新技术、新投资需求将会迎来较快的增长，其中最重要的解决方案就是增配储能，因此化学储能需求增长可能维持较高增长。同时海外电价的快速上行，刺激了户用发电与储能的市场发展，全球户储系统的销量预计也有较快增长。我们认为储能相关公司的业绩增长也可能持续超预期，具有较大的投资机会。

3. 人工智能硬件：因为人工智能（AI）大模型的不断迭代，美国的头部 IT 公司持续开展 AI 计算基础硬件的军备竞赛，其资本开支继续加强，对 AI 硬件的需求迅速增长，拉动相关的服务器及其零部件的需求迅速增长，甚至部分零部件出现了短缺的情况，从而使得进入海外头部公司供应链的上市公司业绩也获得了快速增长。我们认为 2026 年三季度海外 AI 硬件的需求增长还将延续甚至加速，因此看好相关领域的投资机会。

4. 化工：目前市场对美伊冲突缓和的预期较高，对原油的供需基本面的预测较为悲观，油价也回落到了较低的位置，基于我们对中东地缘冲突可能长期化的判断，油价企稳回升的可能性较大；日韩与西欧的部分生产装置建成年代较早，有可能出现逐步关闭装置，实现部分产能的出清，叠加

国内在“反内卷”政策指导下，可能出现的产量控制，我们预计石化化工产品的价格与价差可能出现长期的价格拐点。

国家继续稳步推进金融改革，大幅提高了对股票欺诈发行、信息披露造假等金融证券犯罪的处罚力度，还开始逐步明确中介机构的责任，为资本市场的健康发展创造了良好的法律环境，资本市场在未来中国转型升级中将承担更为重要的角色，并将继续获得政策层面的大力支持。在上述判断下，我们将在 2026 下半年的投资策略中，保持相对中高水平的股票仓位与较均衡行业配置。

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进行利润分配。

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

本报告期内，基金托管人在中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职

尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，众盈基金管理有限公司在中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由众盈基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	9,472,958.62	2,357,917.93
结算备付金		796,600.36	795,523.95
存出保证金		10,925.01	12,192.65
交易性金融资产	6.4.7.2	8,435,443.05	24,326,957.58
其中：股票投资		8,435,443.05	24,326,957.58
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	—	—
应收清算款		870,932.99	1,243,997.96
应收股利		—	—
应收申购款		20,816.20	41,051.51
递延所得税资产		—	—

其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		19,607,676.23	28,777,641.58
负债和净资产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025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		-	1,617,412.70
应付赎回款		271,373.18	25,241.68
应付管理人报酬		21,486.21	28,674.31
应付托管费		3,581.05	4,779.05
应付销售服务费		6,602.84	8,542.63
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.17	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	21,910.95	13,388.45
负债合计		324,954.40	1,698,038.82
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	6,540,974.94	9,212,481.43
未分配利润	6.4.7.8	12,741,746.89	17,867,121.33
净资产合计		19,282,721.83	27,079,602.76
负债和净资产总计		19,607,676.23	28,777,641.58

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 6,540,974.94 份，其中中科沃土沃瑞混合发起 A 基金份额净值 3.0154 元，基金份额总额 3,455,122.48 份；中科沃土沃瑞混合发起 C 基金份额净值 2.8725 元，基金份额总额 3,085,852.46 份。

6.2 利润表

会计主体：中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026年1月1日至2026 年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025 年6月30日
一、营业总收入		831,947.00	-2,790,581.01
1. 利息收入		6,042.84	13,275.66
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,004.37	13,275.66
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		38.47	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,899,273.21	-2,829,196.08
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,739,132.33	-3,201,053.08
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	15,182.95	-5,795.76
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	144,957.93	377,652.76
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,101,727.52	-18,236.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	28,358.47	43,575.65
减：二、营业总支出		222,707.60	321,581.99
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	150,334.68	219,259.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	25,055.81	36,543.26
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	46,031.48	64,652.30
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	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		0.08	-
8. 其他费用	6.4.7.20	1,285.55	1,126.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		609,239.40	-3,112,163.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		609,239.40	-3,112,163.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		609,239.40	-3,112,163.00

6.3 净资产变动表

会计主体：中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 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	9,212,481.43	-	17,867,121.33	27,079,602.76
二、本期期初净资产	9,212,481.43	-	17,867,121.33	27,079,602.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,671,506.49	-	-5,125,374.44	-7,796,880.93
（一）、综合收益总额	-	-	609,239.40	609,239.40
（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）	-2,671,506.49	-	-5,734,613.84	-8,406,120.33
其中：1. 基金申购款	2,179,047.12	-	4,928,849.16	7,107,896.28
2. 基金赎回款	-4,850,553.61	-	-10,663,463.00	-15,514,016.61
（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	6,540,974.94	-	12,741,746.89	19,282,721.83
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 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	14,156,823.49	-	24,558,967.97	38,715,791.46
二、本期期初净资产	14,156,823.49	-	24,558,967.97	38,715,791.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,383,093.04	-	-5,032,283.00	-6,415,376.04

(一)、综合收益总额	-	-	-3,112,163.00	-3,112,163.00
(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)	-1,383,093.04	-	-1,920,120.00	-3,303,213.04
其中: 1. 基金申购款	5,922,006.01	-	9,160,213.54	15,082,219.55
2. 基金赎回款	-7,305,099.05	-	-11,080,333.54	-18,385,432.59
(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	12,773,730.45	-	19,526,684.97	32,300,415.42

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:

钟光正	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

中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]第 590 号《关于准予中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由众盈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《中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 10,472,931.26 元,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)(瑞华)验字第(2019)48090001 号验证报告予以验证。经向中国证监会备案,《中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 1 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 10,478,812.69 份基金份额,其中认购资金利息折合 5,881.43 份基金份额。本基金的基金管理人为众盈基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

根据《中科沃土沃瑞灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，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《中科沃土沃瑞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)、股指期货、国债期货、权证、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、货币市场工具、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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 0%-95%；权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%；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×60%+中债综合全价（总值）指数收益率×40%。

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”)、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集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〉》、《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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。于本期末，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本报告期末的财务状况以及本报告期间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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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[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》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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。2027年12月31日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2027年12月31日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自2025年8月8日起，对在该

日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入,恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入,免征增值税直至债券到期。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。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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	9,472,958.62
等于: 本金	9,472,210.48
加: 应计利息	748.14
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	9,472,958.62

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		9,870,828.80	-	8,435,443.05	-1,435,385.75
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		9,870,828.80	-	8,435,443.05	-1,435,385.75

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：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

注：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

注：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

注：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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	279.46
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	21,631.49
其中：交易所市场	21,631.49
银行间市场	-
应付利息	-
合计	21,910.95

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中科沃土沃瑞混合发起 A		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,079,847.91	5,079,847.91
本期申购	478,384.76	478,384.76
本期赎回(以“-”号填列)	-2,103,110.19	-2,103,110.19
本期末	3,455,122.48	3,455,122.48

金额单位：人民币元

中科沃土沃瑞混合发起 C		
项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,132,633.52	4,132,633.52
本期申购	1,700,662.36	1,700,662.36
本期赎回(以“-”号填列)	-2,747,443.42	-2,747,443.42
本期末	3,085,852.46	3,085,852.46

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中科沃土沃瑞混合发起 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,897,996.06	1,256,411.43	10,154,407.49
本期期初	8,897,996.06	1,256,411.43	10,154,407.49
本期利润	1,491,017.58	-1,085,076.16	405,941.42

本期基金份额交易产生的变动数	-3,160,924.01	-435,943.87	-3,596,867.88
其中：基金申购款	941,534.79	198,348.73	1,139,883.52
基金赎回款	-4,102,458.80	-634,292.60	-4,736,751.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,228,089.63	-264,608.60	6,963,481.03

单位：人民币元

中科沃土沃瑞混合发起 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,704,556.84	1,008,157.00	7,712,713.84
本期期初	6,704,556.84	1,008,157.00	7,712,713.84
本期利润	1,219,949.34	-1,016,651.36	203,297.98
本期基金份额交易产生的变动数	-1,947,365.76	-190,380.20	-2,137,745.96
其中：基金申购款	3,089,317.56	699,648.08	3,788,965.64
基金赎回款	-5,036,683.32	-890,028.28	-5,926,711.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,977,140.42	-198,874.56	5,778,265.86

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,756.62
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	1,228.52
其他	19.23
合计	6,004.37

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	48,171,420.22
减：卖出股票成本总额	45,365,937.01
减：交易费用	66,350.88

买卖股票差价收入	2,739,132.33
----------	--------------

6.4.7.11 基金投资收益

注：本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	24.26
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	15,158.69
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	15,182.95

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	307,707.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	292,126.52
减：应计利息总额	398.47
减：交易费用	24.02
买卖债券差价收入	15,158.69

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	144,957.93
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	144,957.93

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,101,727.52
——股票投资	-2,101,727.52
——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	-2,101,727.52

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	28,358.47
合计	28,358.47

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。

6.4.7.19 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	1,285.55
合计	1,285.55

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、关联关系

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
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
众盈基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

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 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	150,334.68	219,259.56
其中：应支付销售机构的客户维护费	50,903.00	81,165.84
应支付基金管理人的净管理费	99,431.68	138,093.72

注：支付基金管理人众盈基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%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 × 1.20% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	25,055.81	36,543.26

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值 × 0.20% / 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C	合计
众盈基金	-	4,075.11	4,075.11
交通银行	-	909.61	909.61
合计	-	4,984.72	4,984.72
获得销售服务费 的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C	合计
众盈基金	-	3,246.59	3,246.59
交通银行	-	1,863.27	1,863.27
合计	-	5,109.86	5,109.86

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 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给众盈基金，再由众盈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 类基金份额的基金资产净值 × 0.80% / 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

注：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

注：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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C
基金合同生效日（2019 年 1 月 14 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	327,083.32
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	327,083.32
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	5.00%

项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C
基金合同生效日（2019 年 1 月 14 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	327,083.32
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	327,083.32
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	2.56%

注：1. 基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。
2. 本基金本报告期末及上年度末基金管理人未投资中科沃土沃瑞混合发起 A 类基金份额。

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

份额单位：份

中科沃土沃瑞混合发起 A				
关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广州西拓投资合伙企业（有限合伙）	2,003,602.74	30.63%	2,003,602.74	21.75%

注：1. 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中科沃土沃瑞混合发起 C 类基金份额。

2. 广州西拓投资合伙企业（有限合伙）投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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		上年度可比期间	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	9,472,958.62	4,756.62	4,491,638.48	12,035.12

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：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

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001248	华润新能源	2026 年 6 月 23 日	1 个月内（含）	新股未上市流通受限	10.11	10.11	500	5,055.00	5,055.00	—

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：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

注：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

注：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交通银行，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

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

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期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货币资金、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
货币资金	9,472,958.62	-	-	-	-	-	9,472,958.62
结算备付金	796,600.36	-	-	-	-	-	796,600.36
存出保证金	10,925.01	-	-	-	-	-	10,925.01
交易性金融资 产	-	-	-	-	-	8,435,443.05	8,435,443.05
应收清算款	-	-	-	-	-	870,932.99	870,932.99
应收申购款	-	-	-	-	-	20,816.20	20,816.20
资产总计	10,280,483.99	-	-	-	-	9,327,192.24	19,607,676.23
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	271,373.18	271,373.18
应付管理人报 酬	-	-	-	-	-	21,486.21	21,486.21
应付托管费	-	-	-	-	-	3,581.05	3,581.05
应付销售服务 费	-	-	-	-	-	6,602.84	6,602.84
应交税费	-	-	-	-	-	0.17	0.17
其他负债	-	-	-	-	-	21,910.95	21,910.95
负债总计	-	-	-	-	-	324,954.40	324,954.40
利率敏感度缺 口	10,280,483.99	-	-	-	-	9,002,237.84	19,282,721.83
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
货币资金	2,357,917.93	-	-	-	-	-	2,357,917.93
结算备付金	795,523.95	-	-	-	-	-	795,523.95
存出保证金	12,192.65	-	-	-	-	-	12,192.65

交易性金融资产	-	-	-	-	-	24,326,957.58	24,326,957.58
应收清算款	-	-	-	-	-	1,243,997.96	1,243,997.96
应收申购款	-	-	-	-	-	41,051.51	41,051.51
资产总计	3,165,634.53	-	-	-	-	25,612,007.05	28,777,641.58
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	1,617,412.70	1,617,412.70
应付赎回款	-	-	-	-	-	25,241.68	25,241.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,674.31	28,674.31
应付托管费	-	-	-	-	-	4,779.05	4,779.05
应付销售服务费	-	-	-	-	-	8,542.63	8,542.63
其他负债	-	-	-	-	-	13,388.45	13,388.45
负债总计	-	-	-	-	-	1,698,038.82	1,698,038.82
利率敏感度缺口	3,165,634.53	-	-	-	-	-23,913,968.23	27,079,602.76

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

注：于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资(上期末：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(上期末：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%，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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	8,435,443.05	43.75	24,326,957.58	89.83
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	8,435,443.05	43.75	24,326,957.58	89.83

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	171,721.26	1,222,859.83
	沪深 300 指数下降 5%	-171,721.26	-1,222,859.83

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	8,430,388.05	24,326,957.58
第二层次	5,055.00	-
第三层次	-	-
合计	8,435,443.05	24,326,957.58

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

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上期末：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	8,435,443.05	43.02
	其中：股票	8,435,443.05	43.02
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	10,269,558.98	52.38
8	其他各项资产	902,674.20	4.60
9	合计	19,607,676.23	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	2,817,926.05	14.61
C	制造业	5,256,892.00	27.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,055.00	0.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	353,500.00	1.83
K	房地产业	2,070.00	0.01
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	8,435,443.05	43.75

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通标的股票。

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	600989	宝丰能源	55,500	1,128,315.00	5.85
2	600309	万华化学	14,500	991,945.00	5.14
3	600346	恒力石化	50,000	885,500.00	4.59
4	600985	淮北矿业	56,700	796,635.00	4.13
5	002709	天赐材料	11,000	565,730.00	2.93
6	002648	卫星化学	22,200	521,478.00	2.70
7	601666	平煤股份	64,600	461,890.00	2.40
8	002001	新 和 成	13,000	369,460.00	1.92
9	601628	中国人寿	10,000	353,500.00	1.83
10	601699	潞安环能	22,500	321,300.00	1.67
11	300750	宁德时代	800	314,408.00	1.63
12	601088	中国神华	7,600	296,704.00	1.54
13	600546	山煤国际	27,000	295,110.00	1.53
14	000990	诚志股份	34,200	279,756.00	1.45
15	600188	兖矿能源	14,665	260,597.05	1.35
16	601898	中煤能源	20,000	243,600.00	1.26
17	002202	金风科技	5,000	119,500.00	0.62
18	600395	盘江股份	20,500	93,480.00	0.48
19	600075	新疆天业	20,000	80,800.00	0.42
20	601918	新集能源	5,000	42,950.00	0.22
21	001248	华润新能源	500	5,055.00	0.03
22	000983	山西焦煤	500	2,900.00	0.02
23	600971	恒源煤电	400	2,760.00	0.01
24	000560	我爱我家	1,000	2,070.00	0.01

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	600346	恒力石化	2,035,228.00	7.52
2	600546	山煤国际	1,624,424.00	6.00

3	600989	宝丰能源	1,566,267.00	5.78
4	601699	潞安环能	1,308,800.00	4.83
5	600309	万华化学	1,227,878.00	4.53
6	002202	金风科技	1,164,340.00	4.30
7	600188	兖矿能源	1,011,804.00	3.74
8	601225	陕西煤业	1,003,659.00	3.71
9	601001	晋控煤业	971,586.00	3.59
10	600985	淮北矿业	909,105.00	3.36
11	002648	卫星化学	902,286.00	3.33
12	601666	平煤股份	843,600.00	3.12
13	600123	兰花科创	829,147.00	3.06
14	600348	华阳股份	693,197.00	2.56
15	002001	新 和 成	626,950.00	2.32
16	601318	中国平安	587,981.00	2.17
17	300432	富临精工	571,000.00	2.11
18	300750	宁德时代	539,070.00	1.99
19	601101	昊华能源	519,340.00	1.92
20	300274	阳光电源	509,918.00	1.88

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	600188	兖矿能源	2,685,809.40	9.92
2	601225	陕西煤业	2,586,471.40	9.55
3	002202	金风科技	2,581,814.00	9.53
4	601001	晋控煤业	2,347,755.00	8.67
5	002128	电投能源	2,017,558.00	7.45
6	601898	中煤能源	1,960,420.00	7.24
7	300274	阳光电源	1,809,626.00	6.68
8	300750	宁德时代	1,680,859.00	6.21
9	601088	中国神华	1,628,421.00	6.01
10	000333	美的集团	1,514,697.00	5.59
11	600546	山煤国际	1,371,210.00	5.06
12	688472	阿特斯	1,270,015.00	4.69
13	601699	潞安环能	1,012,475.00	3.74
14	300432	富临精工	1,001,700.00	3.70
15	600348	华阳股份	892,600.00	3.30
16	600549	厦门钨业	864,570.00	3.19
17	300014	亿纬锂能	855,687.00	3.16
18	600346	恒力石化	817,215.00	3.02

19	600123	兰花科创	736,019.70	2.72
20	002709	天赐材料	686,837.00	2.54
21	300308	中际旭创	681,757.00	2.52
22	600760	中航沈飞	608,449.00	2.25
23	002407	多氟多	565,470.00	2.09
24	601318	中国平安	561,644.00	2.07

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	31,576,150.00
卖出股票收入（成交）总额	48,171,420.22

注：买入股票成本、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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

本报告期内，本基金未参与股指期货投资。

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

本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

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本期是否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

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 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

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	10,925.01
2	应收清算款	870,932.99
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	20,816.20
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	902,674.20

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：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，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 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

份额类别	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
中科沃土沃瑞混合发起 A	1,531	2,256.77	2,004,630.79	58.02%	1,450,491.69	41.98%
中科沃土沃瑞混合发起 C	2,089	1,477.19	327,083.32	10.60%	2,758,769.14	89.40%
合计	3,620	1,806.90	2,331,714.11	35.65%	4,209,260.83	64.35%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比	79.23%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：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。

8.4 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

注：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

项目	中科沃土沃瑞混合发起 A	中科沃土沃瑞混合发起 C
基金合同生效日（2019 年 1 月 14 日）基金份额总额	8,992,376.24	1,486,436.45
本报告期期初基金份额总额	5,079,847.91	4,132,633.52
本报告期基金总申购份额	478,384.76	1,700,662.36

减：本报告期基金总赎回份额	2,103,110.19	2,747,443.42
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	3,455,122.48	3,085,852.46

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

§ 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，本基金管理人于 2026 年 2 月 9 日起，新聘任钟光正为总经理，于建伟不再担任总经理职务；经佛山市南海区市场监督管理局核准，本基金管理人法定代表人变更为钟光正，于建伟不再担任法定代表人，已于 2026 年 2 月 12 日公告。

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

本报告期内本基金投资策略无重大改变。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰海通证券(原海通)	1	36,596,863.59	45.89%	17,050.17	45.89%	—
国盛证券	1	27,676,336.44	34.71%	12,894.42	34.71%	—
长江证券	2	15,469,315.19	19.40%	7,207.04	19.40%	—
华安证券	1	—	—	—	—	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
长城证券	1	—	—	—	—	—
东兴证券	1	—	—	—	—	—
兴业证券	2	—	—	—	—	—
银河证券	2	—	—	—	—	—
东方财富证券	2	—	—	—	—	—
国投证券	1	—	—	—	—	—
财达证券	2	—	—	—	—	—
浙商证券	2	—	—	—	—	—
国融证券	1	—	—	—	—	—

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 基金租用或者通过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
国泰海通证券(原海通)	600,207.70	100.00%	300,000.00	100.00%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国融证 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	中科沃土基金管理有限公司关于新增上海利得基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 15 日
2	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金 2025 年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 22 日
3	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	中国证监会规定媒介	2026 年 2 月 10 日
4	中科沃土基金管理有限公司关于变更公司法定代表人的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 2 月 12 日
5	中科沃土基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 2 月 13 日
6	中科沃土基金管理有限公司关于终止江西正融基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 27 日
7	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 31 日
8	中科沃土基金管理有限公司关于新增排排网销售为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 1 日
9	中科沃土基金管理有限公司关于终止武汉佰鲲基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 2 日
10	中科沃土基金管理有限公司关于终止中证金牛(北京)投资咨询有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 2 日
11	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 17 日
12	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新 C 类份额	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 17 日
13	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新 A 类份额	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 17 日
14	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金 2026 年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 22 日
15	中科沃土基金管理有限公司关于关闭直销网上交易平台、微信服务号部分业	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 4 日

	务服务的公告		
16	中科沃土基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 27 日
17	中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同更新	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 27 日

§ 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	2026 年 1 月 1 日 -2026 年 6 月 30 日	2,003,602.74	-	-	2,003,602.74	30.63%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。本基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，有效防控产品流动性风险，在运作中保持合适的流动性水平，保护持有人利益。							

§ 12 影响投资者决策的备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的文件；
2. 《中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金合同》；
3. 《中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
5. 基金托管人业务资格批件、营业执照；

6. 关于申请募集注册中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金之法律意见书；
7. 中国证监会要求的其他文件。

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。

众盈基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日