

# 中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资 基金更新的招募说明书摘要

基金管理人：中科沃土基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

二〇一九年十二月

## 重要提示

本基金根据 2017 年 5 月 2 日中国证券监督管理委员会《关于核准中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]625 号）进行募集，于 2017 年 12 月 6 日成立。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金份额时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

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、银行存款等固定收益类资产，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。

基金的投资组合比例为：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。

本基金初始募集面值为人民币 1.00 元。在市场波动因素影响下，本基金净值可能低于初始面值，本基金投资者有可能出现亏损。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除非另有说明，本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 12 月 12 日，与有关财务数据截止日为 2019 年 9 月 30 日，（本报告中财务数据未经审计）。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人基本情况

1、基金管理人：中科沃土基金管理有限公司

公司住所：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-5668（集中办公区）

办公场所：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心21楼01单元自编06-08号

法定代表人：程文卫

成立日期：2015年9月6日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会，证监许可[2015]1937号

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

注册资本：人民币1.42亿元

存续期限：持续经营

联系电话：020-23388993

联系人：古琳花

### 2、股权结构：

序号	股东名称	出资比例(%)
1	广东中科科创创业投资管理有限责任公司	49.711%
2	广东省粤科金融集团有限公司	14.085%
3	广东普瑞投资发展合伙企业（有限合伙）	4.577%
4	珠海横琴沃智投资合伙企业（有限合伙）	4.486%
5	珠海横琴沃富投资合伙企业（有限合伙）	4.486%
6	珠海横琴西拓投资合伙企业（有限合伙）	4.486%
8	珠海横琴沃泽投资合伙企业（有限合伙）	4.225%
7	珠海横琴沃信投资合伙企业（有限合伙）	3.873%
9	珠海横琴沃土创业投资有限公司	3.451%
10	珠海横琴沃海投资合伙企业（有限合伙）	3.451%
11	广东中广投资管理有限公司	3.169%
	合计	100.000%

### （二）主要人员情况

#### 1、董事、监事及高级管理人员

### (1) 董事会成员

胡冬辉女士，会计硕士，董事长。曾任湖南省机械化施工公司财务主管，中国华建审计事务所审计部经理，中国华星集团公司财务部经理，中国乐凯集团公司总会计师，中央汇金投资有限责任公司专职董事（人保集团派出董事），中央汇金投资有限责任公司证券机构管理部、保险机构管理部副主任。现任中科沃土基金管理有限公司董事长。

朱为绎先生，中国注册会计师，会计学硕士，副董事长。曾任中国证监会广东监管局稽查二处主任科员、上市公司监管一处主任科员、基金监管处主任科员，广东中科科创创业投资管理有限责任公司研究部总经理、项目管理部总经理、副总裁，中科沃土基金管理有限公司董事长。现任中科沃土基金管理有限公司副董事长，兼任珠海横琴沃智投资合伙企业（有限合伙）执行事务合伙人，珠海横琴沃信投资合伙企业（有限合伙）执行事务合伙人，广东海印集团股份有限公司独立董事，广州零壹沃土新三板研究院有限公司董事，暨南大学会计硕士、审计硕士专业学位研究生实践指导教师。

杨绍基先生，管理学博士，副董事长。曾任广东发展银行资产管理部资产管理员，金鹰基金管理有限公司基金经理、研究部副总监、投资管理部总监、首席投资官。现任中科沃土基金管理有限公司副董事长。

刘卫东先生，经济学博士，董事。曾任核工业华南地质局科员，韶关证券登记公司登记部副经理、经理，中国人民银行韶关市分行办公室、金管科科长，中国人民银行翁源县支行副行长、行长，中国人民银行韶关市中心支行调查统计科、人事科科长，中国人民银行韶关市中心支行副行长。现任广东省粤科金融集团有限公司金融业务部总经理。兼任广东省粤科科技小额贷款股份有限公司董事长，广东省粤科融资租赁有限公司董事长，广东省小额贷款公司协会会长。

甘雨女士，学士，董事。曾任广州农商银行番禺支行财务会计部副经理，广州正虹科技发展有限公司财务总监，现任广州融晟投资发展有限公司办公室主任，兼任珠海横琴西拓投资合伙企业（有限合伙）执行事务合伙人，广州凯豪投资咨询有限公司监事。

程文卫先生，管理学博士，博士后，董事、总经理。曾任南开大学军事教研室讲师，中国科技国际信托投资公司证券投资经理、研究所所长，宏源证券股份有限公司研究所所长，渤海证券股份有限公司研究所所长，国开证券有限责任公司研究中心总经理，亿利资源集团有限公司金融集团副總裁、上市公司常务副总兼董秘，信达澳银基金管理有限公司副总经理、信达新兴财富资产管理有限公司总经理，现任中科沃土基金管理有限公司董事、总经理。

张志坚先生，金融硕士，独立董事。曾任北京市国家安全局科员、北京国际信托投资公司证券部客户经理、中国投资银行交易员，国家开发银行交易员、副处长、处长，国开证券有限责任公司固定收益总部总经理（正处级）、副总裁（副局级）。现任深圳市亚信鑫理资产管理有限公司董事长。

刘强先生，金融学硕士，独立董事。曾任中国进出口银行总行党委秘书、总行办公室主任科员、副处长、中国加拿大自然资源投资合作基金 MEC 顾问公司首席运营官兼董事会秘书。

朱桂龙先生，管理学博士，独立董事。曾任合肥工业大学预测与发展研究所助理研究员、副研究员、研究员，华南理工大学工商管理学院副院长、院长、教授、博士生导师。现任华南理工大学工商管理学院教授、博士生导师，获国务院“政府特殊津贴”。兼任江西九丰能源股份有限公司独立董事，广州银行股份有限公司独立董事，中国南玻股份有限公司（上市公司）独立董事，广州金域医学股份有限公司（上市公司）独立董事，广州广电运通股份有限公司（上市公司）独立董事。

### （2）监事会成员

胡玮先生，工商管理和信息化技术学士，监事会主席。曾任广东中科科创创业投资管理有限责任公司总经理助理，现任广东中广投资管理有限公司副总经理兼董事会秘书，兼任珠海横琴沃土创业投资有限公司法定代表人。

袁成龙先生，学士，信息技术部副总经理，职工代表监事。曾任明高资讯科技（广州）有限公司软件开发部软件工程师、明基逐鹿(苏州)软件有限公司软件实施部软件实施顾问、金鹰基金管理有限公司运作保障部系统管理员、富荣基金管理有限公司信息技术部副总监，现任中科沃土基金管理有限公司信息技术部副总经理、职工代表监事。

李泉先生，硕士，集中交易部副总经理，职工代表监事。曾任金鹰基金管理有限公司行政经理、渠道经理，深圳市前海聚能投资资产管理有限公司市场部总监，现任集中交易部副总经理、职工代表监事。

### （3）高级管理人员

胡冬辉女士，管理学博士，董事长，简历同上。

程文卫先生，管理学博士，总经理、法定代表人、董事，简历同上。

曹萍女士，经济学硕士，律师，督察长、合规负责人兼监察风控部总经理。曾任原华夏证券有限责任公司（现中信建投证券有限公司）广州分公司研究发展部、投资银行部经理助理，广东省风险投资集团战略发展部项目经理，金鹰基金管理有限公司监察稽核部负责人，泰康资产管理有限责任公司合规法律部总经理，现任中科沃土基金管理有限公司督察长、合规负责人兼监察风控部总经理。

傅军先生，计算机硕士，副总经理。曾任金鹰基金管理有限公司运作保障部副总监，富荣基金管理有限公司（筹）总经理助理、运营总监，现任中科沃土基金管理有限公司副总经理。

## 2、基金经理

乐瑞祺先生，经济学硕士，总经理助理、基金经理。曾任衡泰软件定量研究部定量分析师，博时基金管理有限公司基金经理助理，民生加银基金管理有限公司投资部总监、基金经理，第一创业证券股份有限公司资产管理部投资总监。现任中科沃土基金管理有限公司总经理助理、中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金基金经理、中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金基金经理、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中科沃土沃鑫成长精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理和中科沃土沃盛纯债债券型证券投资基金基金经理。

孟禄程先生，理学硕士，研究部总经理助理、基金经理。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长，中科沃土基金管理有限公司研究部研究员、研究部总经理助理，现任研究部总经理助理、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金经理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。

### 3、投资决策委员会成员

本公司投资决策委员会成员包括：程文卫先生、乐瑞祺先生、马洪娟女士、邱阳女士和徐力先生。

程文卫先生，管理学博士，董事、总经理、法定代表人，简历同上。

乐瑞祺先生，经济学硕士，总经理助理、基金经理，简历同上。

马洪娟女士，金融学博士，固定收益部副总经理、基金经理。曾任金鹰基金管理有限公司研究员、基金经理，现任中科沃土基金管理有限公司固定收益部副总经理、中科沃土货币市场基金、中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金基金经理和中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金基金经理。

邱阳女士，经济学学士，专户投资部总经理。曾任北京金美林投资顾问有限公司研究员，中国国际金融有限公司财富管理部新业务协调，亿利资源集团金融事业部业务总监，信达新兴财富（北京）资产管理有限公司投资总监，现任中科沃土基金管理有限公司专户投资部总经理。

徐力先生，MBA，工学硕士，专户投资部专户投资总监、投资经理，兼任研究部总经理。曾任方正证券研究所所长助理、TMT组长，中信建投研究所通信行业VP，海通证券研究所通信行业首席分析师，东吴证券研究所通信行业首席分析师，赛伯乐投资高级合伙人，江信基金研究总监，现任中科沃土基金管理有限公司专户投资部专户投资总监、投资经理，兼任研究部总经理。

### 4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

（备注：上述人员履历根据最新情况更新）

## 二、基金托管人

基金托管人基本情况

名称：浙商银行股份有限公司

住所：浙江省杭州市萧山区鸿宁路 1788 号

法定代表人：沈仁康

联系人：林彬

电话：0571-88269636

传真：0571-88268688

成立时间：1993 年 04 月 16 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 18,718,696,778 元

## 三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构：中科沃土基金管理有限公司

公司住所：广东省珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-5668

办公场所：广东省广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 21 楼 01 单元自编 06-08 号

法定代表人：程文卫

联系人：古琳花

联系电话：020-37128628

网址：[www.richlandasm.com.cn](http://www.richlandasm.com.cn)

2、非直销销售机构

（1）浙商银行股份有限公司

注册地址：杭州市庆春路 288 号

办公地址：杭州市延安路 368 号

法定代表人：沈仁康

联系人：唐燕

电话：0571-87659056

客服电话：95527

传真：0571-87659954



网址: [www.czbank.com](http://www.czbank.com)

(2) 中国工商银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人: 易会满

客服电话: 95588

网址: [www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

(3) 交通银行股份有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址: 上海市银城中路 188 号 17 楼

法定代表人: 彭纯

联系人: 胡佳敏

电话: 021-58781234

客服电话: 95559

传真: 021-58408483

网址: [www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(4) 珠海华润银行股份有限公司

注册地址: 广东省珠海市吉大九洲大道东 1346 号

办公地址: 广东省珠海市吉大九洲大道东 1346 号

法定代表人: 刘晓勇

联系人: 李阳

电话: 0755-82817529

客服电话: 0756-96588

传真: 0755-82817612

网址: [www.crbank.com.cn](http://www.crbank.com.cn)

(5) 中国银河证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

办公地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人: 陈共炎

联系人: 辛国政

电话: 010-83574507

客服电话: 4008-888-888 或 95551

传真: 010-83574507

网址: [www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)



(6) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：王一通

电话：010-60838888

客服电话：95548

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(7) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

电话：010-60833754

客服电话：400-990-8826

传真：0755-83217421

网址：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

(8) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268号

办公地址：上海市浦东新区长柳路36号兴业证券大厦20楼

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

电话：021-38565547

客服电话：95562

传真：021-38565783

网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

(9) [广发证券股份有限公司](#)

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址：广州市天河区马场路26号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

客服电话：95575

网址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

(10) 广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：胡伏云

联系人：梁微

电话：020-88836999

客服电话：95396

传真：020-88836984

网址：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

(11) 民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16 层--18 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16 层--20 层

法定代表人：冯鹤年

联系人：韩秀萍

电话：010-85127609

客服电话：95376

传真：010-85127641

网址：[www.msza.com](http://www.msza.com)

(12) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层

法定代表人：李梅

联系人：余敏

电话：021-33388229

客服电话：95523 或 4008895523

传真：021-33388224

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(13) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：李琦



联系人：王怀春

电话：0991-2307105

客服电话：400-800-0562

传真：0991-2301927

网址：www.hysec.com

（14）中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市市中区经七路 86 号

办公地址：济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

电话：021-20315290

客服电话：95538

传真：0531-68889095

网址：www.zts.com.cn

（15）江海证券有限公司

注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：哈尔滨市松北区创新三路 833 号

法定代表人：赵洪波

联系人：姜志伟

电话：0451-87765732

客服电话：400-666-2288

传真：0451-82337279

网址：www.jhzq.com.cn

（16）平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：何之江

联系人：王阳

电话：021-38632136

客服电话：95511-8

传真：0755-82435367

网址：<http://stock.pingan.com>

（17）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

联系人：陈剑虹

电话：0755-82558305

客服电话：4008-001-001

传真：0755-82558355

网址：www.essence.com.cn

(18) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

办公地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

法定代表人：林炳城

联系人：罗艺琳

电话：0755-82943755

客服电话：95329

传真：0755-82960582

网址：www.zszq.com

(19) 国融证券股份有限公司

注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道 1 号 4 楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西楼 11 层

法定代表人：张智河

联系人：叶密林

电话：010-83991719

客服电话：95385

传真：010-66412537

网址：www.grzq.com

(20) 大泰金石基金销售有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 102 号 708 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：陈达伟

客服电话：400-928-2266

网址：www.dtfunds.com

(21) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室—3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道 1 号保利国际广场南塔 1201-1203 室



法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

电话：020-89629099

客服电话：020-89629066

传真：020-89629011

网址：www.yingmi.cn

(22) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号

法定代表人：王之光

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

客服电话：400-821-9031

传真：021-22066653

网址：www.lufunds.com

(23) 深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层  
1108

办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层  
1108

法定代表人：赖任军

联系人：刘昕霞

电话：0755-29330513

客服电话：400-9302-888

传真：0755-26920530

网址：[www.jfzinv.com](http://www.jfzinv.com)

(24) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

法定代表人：薛峰

联系人：徐丽平

电话：0755-33227950

客服电话：400-678-8887

传真：0755-33227951

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

(25) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室

法定代表人：周斌

联系人：陈霞

电话：010-53509644

客服电话：400-8980-618

传真：010-59313586

网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

(26) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：潘世友

联系电话：021-54509977

客服电话：95021/4001818188

传真：021-64385308

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(27) 乾道盈泰基金销售(北京)有限公司

注册地址：北京市西城区德胜门外大街 13 号院 1 号楼 1302

办公地址：北京市西城区德胜门外大街 13 号院 1 号楼 1302

法定代表人：董云巍

联系人：马林

电话：18810292781

客服电话：400-088-8080

传真：010-82057741

网址：[www.qiandaojr.com](http://www.qiandaojr.com)

(28) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：陈慧慧

电话：010-85657353



客服电话：400-920-0022

传真：010-65884788

网址：<http://licaike.hexun.com/>

(29) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108号

办公地址：北京市西城区西直门外大街西环广场T2-19

法定代表人：王伟刚

联系人：王骁骁

电话：010-56251471

客服电话：400-619-9059

传真：010-62680827

网址：[www.hcjjjin.com](http://www.hcjjjin.com)

(30) 奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

电话：0755-89460507

客服电话：400-684-0500

传真：0755-21674453

网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

(31) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：王锋

联系人：赵耶

电话：18551602256

客服电话：95177

传真：025-66996699

网址：[www.snjjjin.com](http://www.snjjjin.com)

(32) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼





法定代表人：凌顺平

联系人：林海明

电话：0571-88911818

客服电话：4008-773-772

传真：0571-86800423

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(33) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法定代表人：马勇

联系人：文雯

电话：010-83363101

客服电话：400-116-1188

传真：010-83363072

网址：[8.jrj.com.cn](http://8.jrj.com.cn)

(34) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市大兴区科创十一街京东集团总部 15 层

法定代表人：江卉

联系人：韩锦星

电话：13810801527

传真：58956600

客服电话：95118

网址：[fund.jd.com](http://fund.jd.com)

(35) 上海云湾基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

办公地址：上海市浦东新区锦康路 308 号 6 号楼 6 层

法定代表人：桂水发

联系人：桂水发

电话：021-20538888

客服电话：400-820-1515

传真：021-20538999

网址：[www.zhengtongfunds.com](http://www.zhengtongfunds.com)

(36) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部  
科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部  
科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

联系人：赵媛媛

电话：18501377331

客服电话：010-62675369

传真：010-62675369

网址：<https://fund.sina.com.cn/fund/web/index>

(37) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：武汉市江汉区台北一路 17-19 号环亚大厦 B 座 601 室

办公地址：武汉市江汉区台北一路 17-19 号环亚大厦 B 座 601 室

法定代表人：陶捷

联系人：陈玲

电话：18040516241

客服电话：400-027-9899

传真：027-83862682

网址：[www.buyfunds.cn](http://www.buyfunds.cn)

(38) 江西正融基金销售有限公司

注册地址：江西省南昌市高新开发区紫阳大道紫峰大厦 1103 室

办公地址：江西省南昌市高新开发区紫阳大道紫峰大厦 1103 室

法定代表人：陆雯

联系人：傅翌乔

联系电话：15870677622

客服电话：0791-86692502

传真：0791-86692502

网址：[www.jxzzrg.com.cn](http://www.jxzzrg.com.cn)

(39) 上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：尹彬彬

联系人：兰敏

联系电话：021-52822063

传真：021-52975270

客户服务电话：400-166-6788

网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(40) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼好买财富

法定代表人：杨文斌

联系人：王诗琦

电话：13482256958

客服电话：400-700-9665

传真：021-68596916

网址：[www.howbuy.com](http://www.howbuy.com)

(41) 喜鹊财富基金销售有限公司

注册地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

办公地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

法定代表人：陈皓

联系人：张萌

电话：010-58349088/18600730680

客服电话：400-699-7719

传真：010-88371180

网址：[www.xiquefund.com](http://www.xiquefund.com)

(42) 上海中正达广基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人：黄欣

联系人：戴珉微

电话：021-33768132

客服电话：400-6767-523

传真：021-33768132-802

网址：[www.zhongzhengfund.com](http://www.zhongzhengfund.com)

(43) 上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：冷飞



联系人：孙琦

电话：021-50810673

客服电话：400-711-8718

传真：021-50810687

网址：[www.wacaijijin.com](http://www.wacaijijin.com)

(44) 洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司

注册地址：青岛市香港东路 195 号 9 号楼 701 室

办公地址：北京市西城区西什库大街 31 号院九思文创园 5 号楼 501 室

法定代表人：杨雅琴

联系人：邢智

电话：18513134199

客服电话：400-8189-598

传真：0532-66728591

网址：[www.hongtaiwealth.com](http://www.hongtaiwealth.com)

(45) 万家财富基金销售（天津）有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人：李修辞

联系人：王芳芳

电话：010-59013842

客服电话：010-59013842

传真：010-59013828

网址：[www.wanjiawealth.com](http://www.wanjiawealth.com)

(46) 上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：邱燕芳

电话：021-20691935

客服电话：400-8202-899

传真：021-2069-1861

网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(47) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

联系人：吴鸿飞

电话：021-65370077-268

传真：021-55085991

客服电话：400-820-5369

网址：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

（48）泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：李春光

联系人：徐江

电话：0411-88891212

客服电话：400-0411-001

传真：0411-84396536

网址：[www.haojiyoujijin.com](http://www.haojiyoujijin.com)

（49）深圳信诚基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街 16 号中国人寿大厦 5 层雷格斯 C1 房间

法定代表人：周文

联系人：廖鹏

客服电话：0755-23946579

传真：0755-82786863

网址：[www.ecpefund.com](http://www.ecpefund.com)

（50）北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 19 号 A 座 1505 室

法定代表人：张冠宇

联系人：王丽敏

电话：010-85932810

客服电话：400-819-9868

网站：<https://www.tdyhfund.com>



(51) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 18 层

法定代表人：李兴春

联系人：叶雪飞

电话：021-60195121

客服电话：95733

传真：021-61101630

网站：www.leadfund.com.cn

(52) 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层

法定代表人：李科

电话：010-85632771

传真：010-85632773

联系人：王超

客服热线：95510

网站：<http://fund.sinosig.com/>

(53) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

法定代表人：汪静波

联系人：李娟

电话：021-80358236

客服电话：4008-215-399

传真：021-80358749

网站：www.noah-fund.com

(54) 深圳前海财厚基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区深圳湾科技生态园三区 11 栋 A 座 3608 室

法定代表人：杨艳平

联系人：叶见云

电话：15999517027

客服电话：4001286800

传真：0755-26640652

网站：www.caiho.cn

基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。

（二）基金注册登记机构

名称：中科沃土基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-5668

办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心21楼01单元自编06-08号

法定代表人：程文卫

联系人：高寅初

联系电话：020-37128624

传真：020-23388994

（三）律师事务所和经办律师

律师事务所：广东广信君达律师事务所

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路6号广州周大福金融中心（广州东塔）29、

10层

负责人：王晓华

电话：(020)37181333

传真：(020)37181388

经办律师：刘智、杨琳

联系人：刘智

（四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所：天健会计师事务所（特殊普通合伙）

主要经营场所：杭州市西溪路128号9楼

执行事务合伙人：胡少先

经办注册会计师：杨克晶

联系人：卢玲玉

电话：020-37600380

传真：020-37606120

## 四、基金的名称

中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金

## 五、基金的类型

混合型证券投资基金

## 六、基金的投资目标

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。

## 七、基金的投资方向

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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产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。

## 八、基金的投资策略

### （一）资产配置策略

本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、税收、货币、汇率政策等），并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型，动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健收益。

### （二）股票投资策略

本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；



并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股，力争实现组合的保值增值。

### 1、行业配置策略

本基金主要通过行业景气度分析和行业竞争格局分析，就行业投资价值进行综合评估，从而确定并动态调整行业配置比例。在行业景气分析方面，本基金将重点投资于景气度较高且具有可持续性的行业；在行业竞争格局方面，本基金将重点投资于行业竞争格局良好的行业。

### 2、个股投资策略

#### （1）公司基本面分析

本基金将通过分析上市公司的经营模式、产品研发能力、公司治理等多方面的运营管理能力，判断公司的核心价值与成长能力，选择具有良好经营状况的上市公司股票。

经营模式方面，选择主营业务鲜明、行业地位突出、产品与服务符合行业发展趋势的上市公司股票；产品研发能力方面，选择具有较强的自主创新和市场拓展能力的上市公司股票；公司治理方面，选择公司治理结构规范，管理水平较高的上市公司股票。

本基金将重点关注上市公司的盈利能力、成长和股本扩张能力以及现金流管理水平，选择优良财务状况的上市公司股票。盈利能力方面，主要考察销售毛利率、净资产收益率（ROE）等指标；成长和股本扩张能力方面，主要考察主营业务收入增速、净资产增速、净利润增速、每股收益（EPS）增速、每股现金流净额增速等指标；现金流管理能力方面，主要考察每股现金流净额等指标。

#### （2）估值水平分析

本基金将根据上市公司的行业特性及公司本身的特点，选择合适的股票估值方法。可供选择的估值方法包括市盈率法（P/E）、市净率法（P/B）、市盈率—长期成长法（PEG）、企业价值/销售收入（EV/SALES）、企业价值/息税折旧摊销前利润法（EV/EBITDA）、自由现金流贴现模型（FCFF，FCFE）或股利贴现模型（DDM）等。通过估值水平分析，基金管理人力争发掘出价值被低估或估值合理的股票。

#### （3）股票组合的构建与调整

本基金在行业分析、公司基本面分析及估值水平分析的基础上，进行股票组合的构建。当行业、公司的基本面、股票的估值水平出现较大变化时，本基金将对股票组合适时进行动态调整。

### （三）债券投资策略

#### 1、利率策略

研究 GDP、物价、就业、国际收支等国民经济运行状况，分析宏观经济运行的可能情景，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋

势及结构，在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势，以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

组合久期是反映利率风险最重要的指标，根据对市场利率水平的变化趋势的预期，综合宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，可以制定出组合的目标久期，预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期，以规避债券价格下降的风险和资本损失，获得较高的再投资收益；预期市场利率将下降时，提高组合的久期，在市场利率实际下降时获得债券价格上升的收益，并获得较高利息收入。

## 2、信用策略

根据国民经济运行周期阶段，分析债券发行人所处行业发展前景、发行人业务发展状况、企业市场地位、财务状况、管理水平、债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定债券的信用风险利差与投资价值。

## 3、债券选择与组合优化

本基金将根据债券市场情况，基于利率期限结构及债券的信用级别，在综合考虑流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上，评估债券投资价值，选择定价合理或者价值被低估的债券构建投资组合，并根据市场变化情况对组合进行优化。

## 4、可转债投资策略

本基金可投资可转债、分离交易可转债或含赎回或回售权的债券等，这类债券赋予债权人或债务人某种期权，比普通的债券更为灵活。

### 1) 可转债投资策略

可转债具有债权的属性，投资者可以选择持有可转债到期，得到本金与利息收益；也具有期权的属性，可以在规定的时间内将可转债转换成股票。因此，可转债的价格由债权价格和期权价格两部分组成。

本基金将采用专业的分析和计算方法，综合考虑可转债的久期、票面利率、风险等债券因素以及期权价格，力求选择被市场低估的品种，获得超额收益。

### 2) 其他附权债券投资策略

本基金在对这类债券基本情况进行研究的同时，重点分析附权部分对债券估值的影响。

对于分离交易可转债的债券部分将按照债券投资策略进行管理，权证部分将在可交易之日起不超过 3 个月的时间内卖出。

## （四）资产支持证券投资策略

本基金将通过研究宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

## （五）衍生品投资策略

### 1、股指期货投资策略

本基金为提高投资效率，更好地达到本基金的投资目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货投资。本基金将根据对现货和期货市场的分析，发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点，采用股指期货在短期内取代部分现货，获取市场敞口，投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。多头套期保值指当基金需要买入现货时，为避免市场冲击，提前建立股指期货多头头寸，然后逐步买入现货并解除股指期货多头，当完成现货建仓后将股指期货平仓；空头套期保值指当基金需要卖出现货时，先建立股指期货空头头寸，然后逐步卖出现货并解除股指期货空头，当现货全部清仓后将股指期货平仓。本基金在股指期货套期保值过程中，将定期测算投资组合与股指期货的相关性、投资组合 beta 的稳定性，精细化确定投资方案比例。

### 2、国债期货投资策略

本基金为提高对利率风险管理能力，在风险可控的前提下，本着谨慎原则参与国债期货投资。国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析；构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

### 3、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具。本基金将在权证理论定价模型的基础上，综合考虑权证的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素，对权证进行合理定价。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。

## 九、基金的业绩比较基准

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%。

## 十、基金的风险收益特征

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。

## 十一、基金的投资组合报告（未经审计）

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告有关数据期间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 9 月 30 日。

### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	6,133,281.00	28.98
	其中：股票	6,133,281.00	28.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,015,438.55	70.94
8	其他资产	17,158.20	0.08
9	合计	21,165,877.75	100.00

### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### （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	103,290.00	0.50
C	制造业	2,330,366.00	11.31
D	电力、热力、燃气及水生产	-	-

	和供应业		
E	建筑业	374,518.00	1.82
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	39,200.00	0.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	91,953.00	0.45
J	金融业	2,779,498.00	13.49
K	房地产业	248,220.00	1.20
L	租赁和商务服务业	148,896.00	0.72
M	科学研究和技术服务业	17,340.00	0.08
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	6,133,281.00	29.77

### (2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通投资股票。

### 3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600519	贵州茅台	700	805,000.00	3.91
2	601318	中国平安	8,900	774,656.00	3.76
3	600036	招商银行	17,100	594,225.00	2.88
4	601166	兴业银行	23,900	418,967.00	2.03
5	600276	恒瑞医药	5,100	411,468.00	2.00
6	600030	中信证券	13,200	296,736.00	1.44
7	600887	伊利股份	9,900	282,348.00	1.37

8	601668	中国建筑	35,100	190,593.00	0.93
9	601601	中国太保	5,200	181,324.00	0.88
10	600048	保利地产	11,700	167,310.00	0.81

#### 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

#### 5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

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

本报告期末本基金未持有贵金属。

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

本报告期末本基金未持有权证。

#### 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 本报告期末本基金未持有股指期货。

(2) 本报告期本基金未进行股指期货交易。

#### 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本报告期末本基金未持有国债期货。

(2) 本报告期本基金未进行国债期货交易。

#### 11. 投资组合报告附注

(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。

(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。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	13,817.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,300.42

5	应收申购款	40.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,158.20

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

## 十二、基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、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，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。

投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。本基金合同生效日为 2017 年 12 月 6 日，基金合同生效以来（截至 2019 年 9 月 30 日）的投资业绩及同期业绩比较基准的比较如下表所示：

(一) (1) 中科沃土沃嘉混合 A 类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

阶段	净值增长率①	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
基金合同生效至 2017 年 12 月 31 日	0.17%	0.01%	-0.15%	0.45%	0.32%	-0.44%
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	-18.18%	0.65%	-10.26%	0.66%	-7.92%	-0.01%
2019 年 1 月 1 日至 2019 年 9 月 30 日	5.10%	0.44%	13.7%	0.68%	-8.60%	-0.24% %

基金合同生效至 2019年9月30日	-13.86%	0.56%	-0.07%	0.66%	-13.79%	-0.10%
-----------------------	---------	-------	--------	-------	---------	--------

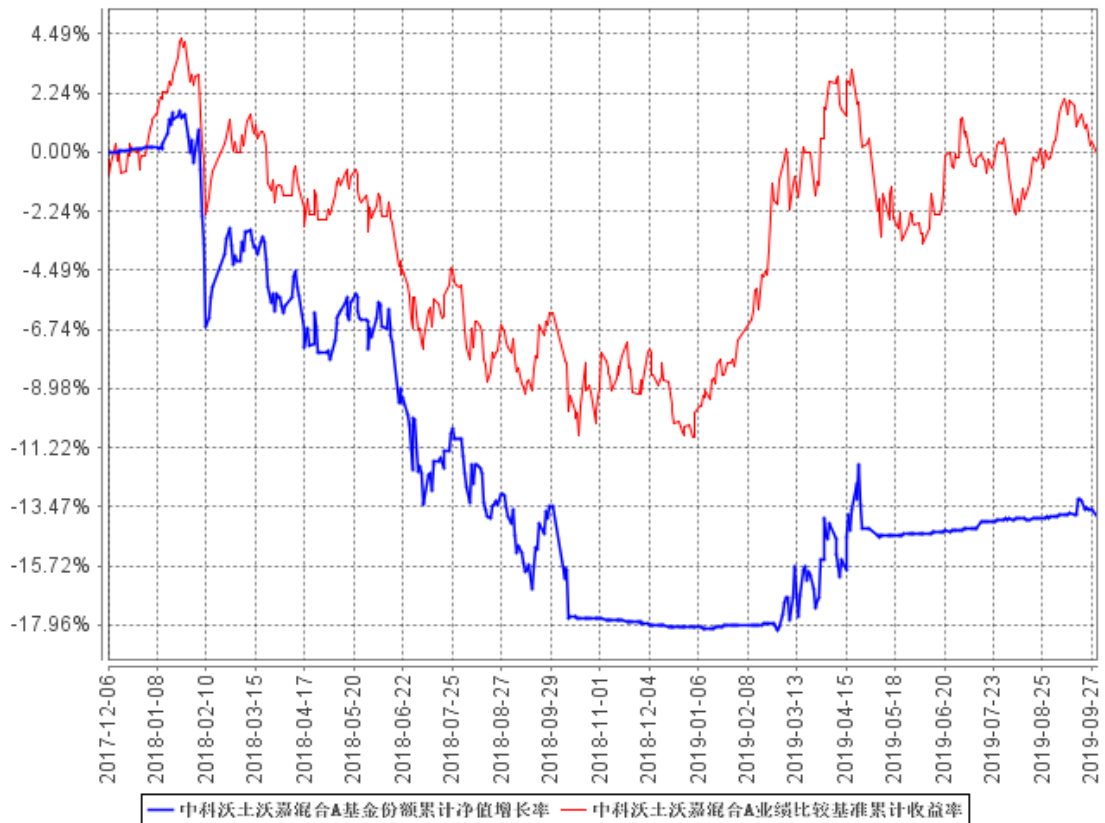
## (2) 中科沃土沃嘉混合C类基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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
基金合同生效至 2017年12月31日	0.15%	0.01%	-0.15%	0.45%	0.30%	-0.44%
2018年1月1日至 2018年12月31日	-18.37%	0.65%	-10.26%	0.66%	-8.11%	-0.01%
2019年1月1日至 2019年9月30日	4.27%	0.43%	13.7%	0.68%	-9.43%	-0.24%
基金合同生效至 2019年9月30日	-14.76%	0.56%	-0.07%	0.66%	-14.69%	-0.10%

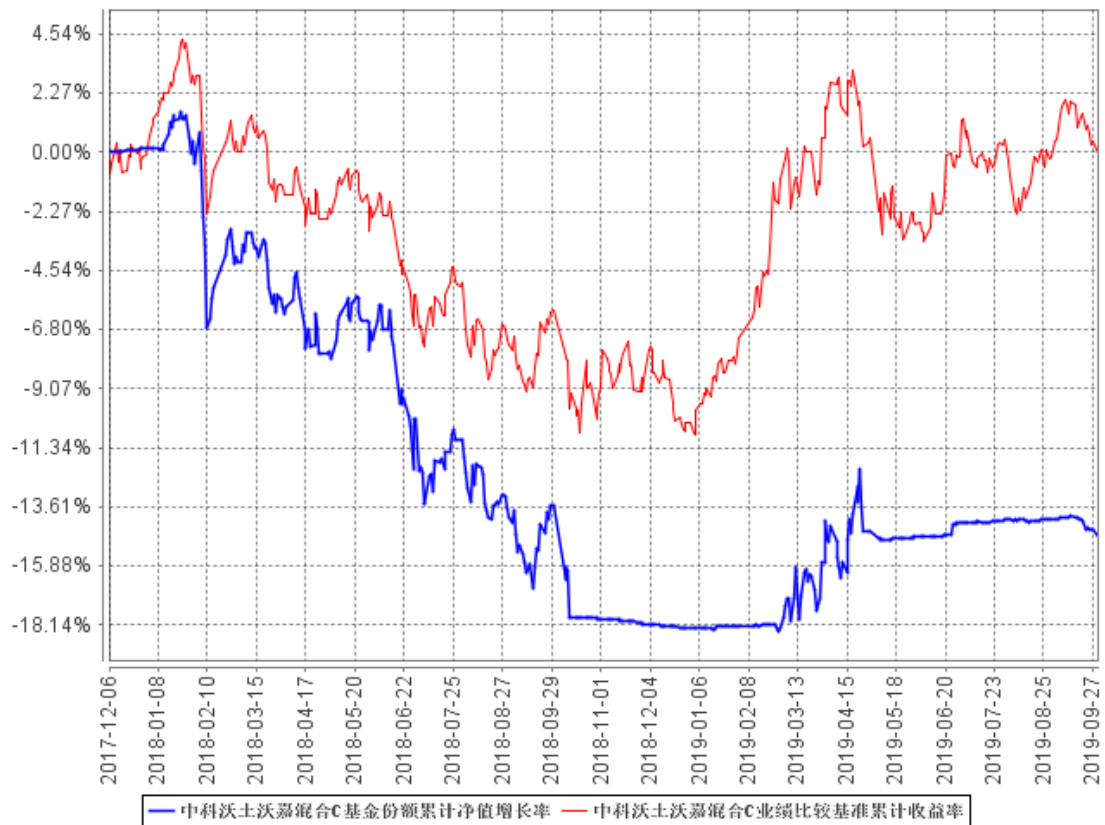
(二) 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



### 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



### 中科沃土沃嘉混合C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



## 十三、费用概览

### （一）与基金运作相关的费用

#### 1、基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）C类基金份额的销售服务费；
- （4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （5）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- （6）基金份额持有人大会费用；
- （7）基金的证券、期货交易费用；
- （8）基金的银行汇划费用；
- （9）基金相关账户的开户费用及账户维护费用；
- （10）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

#### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### （1）基金管理人的管理费

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

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

##### （2）基金托管人的托管费

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

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

##### （3）C类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。C 类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

上述“一、基金费用的种类中第 3—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- (1) 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- (2) 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- (3) 《基金合同》生效前的相关费用；
- (4) 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 4、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致并履行相关程序后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费等相关费率。

基金管理人必须于新的费率实施日前 2 个工作日在至少一种指定媒介上公告。

### 5、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### (二) 与基金销售有关的费用

##### 1、申购费

###### (1) 申购费率

申购金额 (M)	A 类份额申购费率	C 类份额申购费率
M < 100 万元	1.20%	0%
100 万元 ≤ M < 300 万元	0.70%	
300 万元 ≤ M < 500 万元	0.30%	
M ≥ 500 万元	1000 元/笔	



## (2) 申购费的收取方式和用途

本基金的申购费用由投资者承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

## (3) 申购金额的计算方式

### 1、A类基金份额的申购

申购本基金A类份额的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），投资者的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购A类份额的计算方式如下：

#### 1) 申购费用适用比例费率的情形下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T日A类基金份额净值}$$

#### 2) 申购费用适用固定金额的情形下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{固定金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T日A类基金份额净值}$$

例：假定T日A类基金份额净值为1.0560元，某投资者本次申购本基金A类份额40万元，对应的本次申购费率为1.20%，该投资者可得到的基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 400,000 / (1 + 1.20\%) = 395,256.92 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 400,000 - 395,256.92 = 4,743.08 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 395,256.92 / 1.0560 = 374,296.33 \text{ 份}$$

即：投资者投资40万元申购本基金A类份额，假定申购当日A类基金份额净值为1.0560元，可得到374,296.33份基金份额。

例：假定T日A类基金份额净值为1.0560元，某投资者投资550万元申购本基金A类份额，其对应的申购费用为1000元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购费用} = 1000 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 500,000 - 1000 = 499,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 499,000 / 1.0560 = 472,537.88 \text{ 份}$$

即：投资者投资550万元申购本基金A类份额，假定申购当日A类基金份额净值为1.0560元，可得到472,537.88份基金份额。

### 2、C类基金份额的申购

申购C类份额的计算方式如下：

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T日C类基金份额净值}$$

例：某投资者投资5万元申购本基金的C类基金份额，假设申购当日C类基金份额净值为1.0500元，则可得到的申购份额为：

净申购金额=50,000/(1+0%)=50,000元

申购费用=50,000-50,000=0元

申购份额=50,000/1.0500=47,619.05份

即：投资者投资5万元申购本基金的C类基金份额，假设申购当日C类基金份额净值为1.0500元，则其可得到47619.05份C类基金份额。

## 2、赎回费

### (1) 赎回费率

	持有基金份额期限 (Y)	赎回费率 (%)
A类赎回费率	Y < 7日	1.50%
	7日 ≤ Y < 30日	0.75%
	30日 ≤ Y < 180日	0.50%
	Y ≥ 180日	0%
C类赎回费率	Y < 7日	1.50%
	7日 ≤ Y < 30日	0.5%
	Y ≥ 30日	0%

### (2) 赎回费的收取方式和用途

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担。对持续持有期少于30日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于30日但持续持有期少于3个月的A类份额投资者收取的赎回费，将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于3个月但少于6个月的A类份额投资者收取的赎回费，将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于6个月的A类份额投资者，将不低于赎回费总额的25%计入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

### (3) 赎回金额的计算方式：

采用“份额赎回”方式，赎回价格以T日的基金份额净值为基准进行计算。

#### 1、A类基金份额的赎回

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。如果投资者赎回A类基金份额，则赎回金额的计算方法如下：

赎回总金额=赎回份额×T日A类基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×A类基金份额赎回费率

净赎回金额=赎回总金额—赎回费用

例：某投资者赎回本基金1万份A类基金份额，持有时间为三年，对应的赎回费率为0%，假设赎回当日A类基金份额净值是1.2500元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.2500=12,500.00元

赎回费用=12,500×0%=0.00元

净赎回金额=12,500-0=12,500.00元

即：投资者赎回本基金 1 万份 A 类基金份额，持有时间为三年，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.2500 元，则其可得到的赎回金额为 12,500.00 元。

## 2、C 类基金份额的赎回

如果投资者赎回 C 类基金份额，则赎回金额的计算方法如下：

赎回总金额=赎回份额×赎回日 C 类基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×C 类基金份额赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

例：某投资者赎回本基金 1 万份 C 类基金份额，持有时间小于 30 天，对应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.2500 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.2500=12,500 元

赎回费用=12,500×0.50%=62.50 元

净赎回金额=12,500-62.50=12,437.50 元

即：投资者赎回本基金 1 万份 C 类基金份额，持有期限小于 30 天，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.2500 元，则其可得到的赎回金额为 12,437.50 元。

## 3、转换费率

基金转换费由基金份额持有人承担，由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用按照基金合同、更新的招募说明书及最新的相关公告约定的比例归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费，具体实施办法和转换费率详见相关公告。转换费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位。

4、基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整上述费率。上述费率如发生变更，基金管理人应按照《信息披露办法》或其他相关规定于新的费率实施前在至少一种指定媒体公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金销售费率。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及《中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对 2019 年 6 月 28 日刊登的本基金的招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

1. 在“三、基金管理人”部分，根据最新资料更新了主要人员情况信息。
2. 在“四、基金托管人”部分，根据最新资料更新了托管人的相关信息。

3. 在“十、基金的投资”部分，根据定期报告补充了本基金 2019 年第 3 季度投资组合报告的内容。
4. 在“十一、基金的业绩”部分，根据定期报告更新了自基金合同生效以来的投资业绩数据。
5. 在“二十四、其他应披露事项”部分，根据相关公告更新了内容。

中科沃土基金管理有限公司

2019 年 12 月 27 日