

# 中科沃土沃祥债券型发起式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：中国工商银行股份有限公司

二〇一九年八月

## 重要提示

本基金根据 2017 年 3 月 30 日中国证券监督管理委员会《关于准予中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可[2017]423 号)进行募集。

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。

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。

本基金为债券型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

本基金为发起式基金，在基金募集时，使用基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员参与认购本基金的金额不低于 1000 万元，认购的基金份额持有期限不低于三年。基金管理人认购的基金份额持有期限满三年后，基金管理人将根据自身情况决定是否继续持有，届时，基金管理人有可能赎回认购的本基金份额。另外，本基金的基金合同生效三年后(指基金合同生效之日起三年后的对应日)，若基金资产净值低于两亿元的，基金合同自动终止。投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

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债券(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、证券公司短期公司债、中期票据、地方政府债、次级债、可转换公司债、可交换公司债、短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、协议存款、通知存款、银行存款和国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票和权证资产的比例不高于基金资产的 20%，其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%。本基金持有现金或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 7 月 19 日，与有关财务数据截止日为 2019 年 6 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：020-37128628

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，管理学博士，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。现任中科招商投资管理集团股份有限公司常务副总裁，广东中科科创创业投资管理有限责任公司副总裁，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，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，中科沃土基金管理有限公司总经理。现任中科沃土基金管理有限公司副董事长，广东普瑞投资发展合伙企业(有限合伙)执行事务合伙人，珠海横琴中科招商投资管理有限公司专家委员会副總裁。

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、法定代表人。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、法定代表人。

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，广州银行股份有限公司独立董事。

### (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，工学学士，信息技术部副总经理。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。

李文女士，金融学学士，综合管理部总经理助理，职工代表监事。曾任金鹰基金管理有限公司市场部销售经理、投研部投研秘书，现任综合管理部总经理助理、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。

陶安虎先生，哲学硕士，副总经理。曾任汤森路透北方区经理，长安基金管理有限公司拟任总经理助理、市场副总监、华北营销中心总经理，现任中科沃土基金管理有限公司副总经理。

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

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。

黄艺明先生，经济学硕士，权益投资部副总经理、基金经理。曾任广东粤财信托有限公司研究员，金鹰基金管理有限公司基金经理助理、研究总监助理，七匹狼控股集团有限公司投资经理助理，广东富业盛德资产管理有限公司投资部执行董事兼总经理、投资经理，中科沃土基金管理有限公司专户投资部副总经理、投资经理，现任权益投资部副总经理、中科沃土沃祥债券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基金经理。

乐瑞祺先生，经济学硕士，总经理助理兼权益投资部总经理、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兼权益投资部总经理、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和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。

### 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，简历同上。

乐瑞祺先生，经济学硕士，总经理助理兼权益投资部总经理、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，简历同上。

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：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

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币 34,932,123.46 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

## 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)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：陈四清

客服电话：95588

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

(2)广州农村商业银行股份有限公司

注册地址：广州市黄浦区映日路9号

办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路1号信合大厦16楼

法定代表人：王继康

联系人：刘强

电话：020-22389067

客服电话：95313

传真：020-28852692

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

(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

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：13802239370

客服电话：0756-96588

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)万联证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19层

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场E座12层

法定代表人：罗钦城

联系人：甘蕾

电话：020-38286026

客服电话：95322

传真：020-38286588

网址：[www.wlzq.cn](http://www.wlzq.cn)

(7)华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

客服电话：95597

传真：0755-82492962

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

(8)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

客服电话：95396

传真：020-88836984

网址：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.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

客户服务电话：95575

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

(10)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)

(11)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](http://www.hysec.com)

(12)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)

(13)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：021-20315125

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

(14)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.msyzq.com](http://www.msyzq.com)

(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](http://www.jhzq.com.cn)

(16)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](http://www.zszq.com)

(17)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：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 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>

(18)西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：陈宏

联系人：付佳

电话：021-23586603

客服电话：95357

传真：021-23586860

网站：<http://www.18.cn>

(19)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](http://www.dtfunds.com)

(20)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](http://www.yingmi.cn)

(21)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](http://www.lufunds.com)

(22)上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元

办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：金佶

联系人：陈云卉

电话：021-33323998

客服电话：4008213999

网址：licaijia.chinapnr.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

(24)北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 11 号邮电新闻大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

客服电话：400-818-8000

传真：01062020355

网址：www.myfund.com

(25)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

(26)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.chtwm.com

(27)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：95021/400-1818-188

传真：021-64385308

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

(28)乾道盈泰基金销售(北京)有限公司

注册地址：北京市西城区德外大街 13 号院 1 号楼 1302

办公地址：北京市西城区德外大街 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)

(29)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/>

(30)深圳安见基金销售有限公司

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

办公地址：深圳市罗湖区和平路鸿隆世纪广场 B 座 211 室

法定代表人：吴永宏

客服电话：400-800-8668

网址：[www.ph6.com](http://www.ph6.com)

(31)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.hcjijin.com](http://www.hcjijin.com)

(32)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(入驻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)

(33)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：025-66996699-884131

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

(34)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)

(35)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：洪弘

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)

(36)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

客服电话：95118

传真：58956600

网址：[fund.jd.com](http://fund.jd.com)

(37)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)

(38)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>

(39)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)

(40)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

电话：15870677622

客服电话：0791-86692502

传真：0791-86692502

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

(41)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

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服电话：400-166-6788

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

(42)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.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(43)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)

(44)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)

(45)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)

(46)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：<https://www.hongtaiwealth.com/>

(47)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)

(48)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)

(49)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)

(50)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)

(51)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](http://www.caiho.cn)

(52)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>

(53)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](http://www.leadfund.com.cn)

(54)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](http://www.noah-fund.com)

(55)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/>

(二)基金注册登记机构

名称：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：北京市盈科(广州)律师事务所

办公地址：广东省广州市天河区珠江新城洗村路5号凯华国际中心7、8、9层

负责人：牟晋军

经办律师：孙晶、侯旺

联系人：孙晶

电话：020-66857288

传真：020-66857289

### (四)会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所：瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)

主要经营场所：北京市海淀区西四环中路16号院2号楼4层

执行事务合伙人：杨荣华、刘贵彬、冯忠

经办注册会计师：桑涛、闫靖

联系人：饶锦莲

电话：13620977141

传真：0755-82237546

## 四、基金的名称

中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金

## 五、基金的类型

债券型发起式证券投资基金

## 六、基金的投资目标

本基金主要投资于债券资产，严格管理股票资产的投资比例，在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。

## 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的债券(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、证券公司短期公司债、中期票据、地方政府债、次级债、可转换公司债、可交换公司债、短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、协议存款、通知存款、银行存款和国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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：投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资于股票和权证资产的比例不高于基金资产的20%，其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的3%。本基金持有现金或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。

## 八、基金的投资策略

本基金是以债券资产的投资为主的债券型投资基金，通过债券资产的投资获取平稳收益，并适度参与股票资产的投资以增强回报，投资策略主要包括大类资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股票投资策略等。

### 1、大类资产配置策略

本基金将密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在各类资产之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例。

## 2、债券投资策略

本基金债券投资将主要采取利率预期策略与久期管理、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、债券选择策略等投资策略，在合理控制风险、保持适当流动性的基础上，以企业债和可转债为主要投资标的，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。

### (1)利率预期策略与久期管理

本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化，对 GDP、CPI、国际收支等引起利率变化的相关因素进行深入的研究，分析宏观经济运行的可能情景，并在此基础上判断包括财政政策、货币政策在内的宏观经济政策取向，对市场利率水平和收益率曲线未来的变化趋势做出预测和判断，结合债券市场资金供求结构及变化趋势，确定债券资产的久期配置。

### (2)收益率曲线策略

收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的依据之一，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配。本基金将通过对收益率曲线变化的预测，适时采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合，并进行动态调整。

### (3)骑乘策略

本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析，在可选的目标久期区间买入期限位于收益率曲线较陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下，随着其剩余期限的衰减，债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅度的下滑，从而获得较高的资本收益；即使收益率曲线上升或进一步变陡，这一策略也能够提供更多的安全边际。

### (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。

## 3、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

## 4、股票投资策略

本基金的股票投资采取自下而上的方法，以深入的基本面研究为基础，从定量和定性两个方面，精选上市公司中基本面良好、具有较好发展前景且价值被低估的优质上市公司进行积极投资，构建投资组合。

### (1)个股选择

上市公司股票选择因素主要包括但不限于：公司人力(战略管理、人才优势)、公司财力(财务能力、经营业绩)、公司物力(技术优势、产品优势、创新能力)、公司相对优势(相对于行业内其他公司的独特和领先之处)、公司销售与渠道能力。通过精选以上综合评价较高的公司进行投资。

### (2)估值水平分析

基金管理人将对备选股票进行估值分析，采用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，基金管理人将发掘出价值被低估或估值合理的股票。

### 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $10\% \times$  沪深 300 指数收益率 $+90\% \times$  中债综合指数收益率

### 十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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。

基金托管人中国工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 4 月 1 日至 2019 年 6 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 9,497,423.00 14.26

其中：股票 9,497,423.00 14.26

2 基金投资 --

3 固定收益投资 52,407,491.00 78.67

其中：债券 52,407,491.00 78.67

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 1,500,000.00 2.25

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 2,709,327.15 4.07

8 其他资产 501,907.44 0.75

9 合计 66,616,148.59 100.00

#### 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 999,430.00 2.07

B 采矿业 10,650.00 0.02

C 制造业 5,528,703.00 11.45  
 D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --  
 E 建筑业 --  
 F 批发和零售业 173,570.00 0.36  
 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 99,260.00 0.21  
 J 金融业 2,493,210.00 5.16  
 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 192,600.00 0.40  
 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 9,497,423.00 19.66

(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	601318	中国平安	21,000	1,860,810.00	3.85
2	000858	五粮液	13,000	1,533,350.00	3.17
3	600887	伊利股份	32,000	1,069,120.00	2.21
4	002714	牧原股份	17,000	999,430.00	2.07
5	600585	海螺水泥	23,000	954,500.00	1.98
6	000596	古井贡酒	4,500	533,295.00	1.10
7	600030	中信证券	20,000	476,200.00	0.99
8	600309	万华化学	10,000	427,900.00	0.89
9	000651	格力电器	5,000	275,000.00	0.57
10	603737	三棵树	6,200	269,948.00	0.56

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,897,680.00	6.00
2	央行票据	--	--
3	金融债券	8,106,500.00	16.78
其中：政策性金融债 8,106,500.00 16.78			
4	企业债券	1,174,112.00	2.43
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	--	--

7 可转债(可交换债) 40,229,199.00 83.29  
8 同业存单 --  
9 其他 --  
10 合计 52,407,491.00 108.51

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  
序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 018007 国开 1801 50,000 5,043,500.00 10.44  
2 127010 平银转债 39,400 4,692,934.00 9.72  
3 110053 苏银转债 43,500 4,639,275.00 9.61  
4 128024 宁行转债 34,500 4,619,550.00 9.56  
5 110049 海尔转债 37,100 4,463,872.00 9.24

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)本报告期内本基金未进行国债期货交易。

10、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 39,895.41  
2 应收证券清算款 -  
3 应收股利 -  
4 应收利息 461,112.75  
5 应收申购款 899.28  
6 其他应收款 -  
7 待摊费用 -  
8 其他 -  
9 合计 501,907.44

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号 债券代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 128024 宁行转债 4,619,550.00 9.56  
2 110049 海尔转债 4,463,872.00 9.24

3	113020	桐昆转债	4,099,290.00	8.49
4	110043	无锡转债	2,623,660.00	5.43
5	110040	生益转债	2,234,904.00	4.63
6	128048	张行转债	1,468,880.00	3.04
7	128021	兄弟转债	814,160.00	1.69
8	128034	江银转债	642,180.00	1.33
9	113516	苏农转债	537,200.00	1.11
10	128036	金农转债	406,710.00	0.84
11	128030	天康转债	174,450.00	0.36

(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。

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1	权益投资	9,497,423.00	14.26
	其中：股票	9,497,423.00	14.26
2	基金投资	--	
3	固定收益投资	52,407,491.00	78.67
	其中：债券	52,407,491.00	78.67
	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	1,500,000.00	2.25
	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	2,709,327.15	4.07
8	其他资产	501,907.44	0.75
9	合计	66,616,148.59	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	999,430.00	2.07
B	采矿业	10,650.00	0.02
C	制造业	5,528,703.00	11.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	
E	建筑业	--	
F	批发和零售业	173,570.00	0.36
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	99,260.00	0.21
J	金融业	2,493,210.00	5.16
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	192,600.00	0.40

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 9,497,423.00 19.66

(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	601318	中国平安	21,000	1,860,810.00	3.85
2	000858	五粮液	13,000	1,533,350.00	3.17
3	600887	伊利股份	32,000	1,069,120.00	2.21
4	002714	牧原股份	17,000	999,430.00	2.07
5	600585	海螺水泥	23,000	954,500.00	1.98
6	000596	古井贡酒	4,500	533,295.00	1.10
7	600030	中信证券	20,000	476,200.00	0.99
8	600309	万华化学	10,000	427,900.00	0.89
9	000651	格力电器	5,000	275,000.00	0.57
10	603737	三棵树	6,200	269,948.00	0.56

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1	国家债券	2,897,680.00	6.00
2	央行票据	--	--
3	金融债券	8,106,500.00	16.78
其中：政策性金融债 8,106,500.00 16.78			
4	企业债券	1,174,112.00	2.43
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	--	--
7	可转债(可交换债)	40,229,199.00	83.29
8	同业存单	--	--
9	其他	--	--
10	合计	52,407,491.00	108.51

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018007	国开 1801	50,000	5,043,500.00	10.44
2	127010	平银转债	39,400	4,692,934.00	9.72
3	110053	苏银转债	43,500	4,639,275.00	9.61

4 128024 宁行转债 34,500 4,619,550.00 9.56  
5 110049 海尔转债 37,100 4,463,872.00 9.24

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。

11、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  
本报告期末本基金未持有贵金属。

12、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。

13、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)本报告期内本基金未进行国债期货交易。

14、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 39,895.41

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 461,112.75

5 应收申购款 899.28

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 501,907.44

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号 债券代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 128024 宁行转债 4,619,550.00 9.56

2 110049 海尔转债 4,463,872.00 9.24

3 113020 桐昆转债 4,099,290.00 8.49

4 110043 无锡转债 2,623,660.00 5.43

5 110040 生益转债 2,234,904.00 4.63

6 128048 张行转债 1,468,880.00 3.04

7 128021 兄弟转债 814,160.00 1.69

8 128034 江银转债 642,180.00 1.33

9 113516 苏农转债 537,200.00 1.11

10 128036 金农转债 406,710.00 0.84

11 128030 天康转债 174,450.00 0.36

(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 6 月 29 日，基金合同生效以来(截至 2019 年 6 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)本报告期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 -0.45% 0.10% -0.15% 0.08% -0.30% 0.02%

2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 -0.22% 0.25% 1.78% 0.14% -2.00% 0.11%

2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 -8.04% 0.91% 2.92% 0.14% -10.96% 0.77%

基金合同生效至 2019 年 6 月 30 日 -8.66% 0.48% 3.76% 0.13% -12.42% 0.35%

(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

## 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)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- (4)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- (5)基金份额持有人大会费用；
- (6)基金的证券交易费用；
- (7)基金的银行汇划费用；
- (8)基金相关账户的开户费用及账户维护费用；
- (9)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 0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

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于次月首日起 3 个工作日内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 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 3-9 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后，可根据基金发展情况，履行适当程序后，调整基金 管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率。

基金管理人必须于新的费率实施日前在至少一种指定媒介上公告。

#### (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) 申购费率

M <100 万元 0.80%

100 万元≤M <200 万元 0.50%

200 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

投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金采用前端收费模式收取基金申购费用，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)申购费用适用比例费率的情形下：

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/T 日基金份额净值

2)申购费用适用固定金额的情形下：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-固定金额

申购份额=净申购金额/T 日基金份额净值

##### 2、赎回费

###### (1)赎回费率

持有基金份额期限(Y) 赎回费率(%)

Y<7 日 1.50%

7 日≤Y<30 日 0.75%

30日 $\leq$ Y<365日 0.10%

1年 $\leq$ Y<2年 0.05%

Y $\geq$ 2年 0.00%

## (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。不低于 25%的赎回费总额归入基金财产，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，计算公式：

赎回总金额=赎回份额 $\times$ T 日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额 $\times$ 赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

## 3、转换费率

目前，基金管理人已开通了本基金与旗下部分开放式基金之间的转换业务，具体实施办法和转换费率详见相关公告。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。

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《中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金基金合同》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对 2019 年 1 月 31 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，根据相关公告及最新资料更新了公司股权结构和主要人员情况信息。
- 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“五、相关服务机构”部分，根据相关公告更新了基金份额销售机构的信息。
- 4.在“十、基金的投资”部分，根据定期报告补充了本基金截至 2019 年 6 月 30 日的投资组合报告的内容。
- 5.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。
- 6.在“二十四、其他应披露事项”部分，根据相关公告内容进行了更新。

中科沃土基金管理有限公司

2019 年 8 月 9 日