

# 中科沃土沃安中短期利率债债券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：广州农村商业银行股份有限公司

二〇二〇年一月

## 【重要提示】

1、本基金由中科沃土沃安债券型证券投资基金转型而来，于 2019 年 2 月 1 日经中国证监会证监许可[2019]176 号文准予变更注册，并经 2019 年 3 月 15 日中科沃土沃安债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议通过。自 2019 年 3 月 18 日起，《中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金基金合同》正式生效，《中科沃土沃安债券型证券投资基金基金合同》同时失效。

2、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。

3、投资有风险，投资者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。

4、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。

5、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，低于股票型基金和混合型基金。

6、本基金的投资范围为国内依法发行上市的国债、央行票据、政策性金融债、债券回购、同业存单、银行存款、现金。本基金不参与股票、权证等资产的投资，同时本基金不投资于公司债、企业债、短期融资券、中期票据等信用债品种以及可转换债券、可交换债券。

7、基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中短期利率债的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结

算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金界定的中短期利率债指剩余期限不超过三年的国债、央行票据、政策性金融债。

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。

8、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。

9、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。

10、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。

11、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 2020 年 1 月 8 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

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

设立日期：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

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%
总计		100%

（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总监。

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，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总监、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责任公司董事长。

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书记、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。现任中国光大控股有限公司投资管理部董事总经理。

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，教育部创新创业教育指导委员会委员，广东省珠江学者岗位特聘教授，中国科学学与科技政策研究会常务理事，广东省创新方法与决策管理系统重点实验室主任，华南理工大学技术创新评估研究中心主任，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、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券型证券投资基金基金经理。

田钊先生，金融工程硕士，固定收益部投资副总监、基金经理。曾任国开证券有限责任公司销售交易部结构化产品经理，中信建投证券股份有限公司资产管理部投资经理。现任中科沃土基金管理有限公司固定收益部投资副总监、中科沃土货币市场基金基金经理、中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金基金经理、中科沃土沃安中短期利率债券型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。

## 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、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。

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，研究部总经理、基金经理。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、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。

## 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：广州农村商业银行股份有限公司（简称：广州农村商业银行）

住所：广州市黄埔区映日路9号

办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路1号

成立时间：2006年10月27日

注册资本：98.08亿元人民币

存续期间：持续经营

法定代表人：王继康

批准设立文号：银监复[2009]484号

基金托管业务资格批准文号：证监许可[2014]83号

联系人：李中良

电话：（020）22389371

传真：（020）28019340

## 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

联系电话：020-37128628

联系人：古琳花



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) 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)

### (3) 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)

### (4) 国信证券股份有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人: 何如

联系人: 周杨

电话: 0755-82130833

客服电话：95536

传真：0755-82130562

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

(5) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：杜晶、贾鹏

电话：028-86690057、028-86690058

客服电话：95310

传真：028-86690126

网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.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) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：刘畅

电话：010-65608231

客服电话：95587/4008-888-108

传真：010-65186621

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(8) 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)

(9) 中信证券(山东) 有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

联系人：刘晓明

电话：0531—89606165

客服电话：95548

传真：0532-85022605

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

(10) 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)

(11) 国元证券股份有限公司

注册地址：中国安徽省合肥市梅山路 18 号

办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座国元证券

法定代表人：蔡咏

联系人：米硕

联系电话：0551-68167601

客服电话：95578

网址：www.gyzq.com.cn

（12）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

（13）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：张永衡

联系人：梁微

电话：020-88836999

客服电话：95396

传真：020-88836984

网址：www.gzs.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16-18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16-20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

（15）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)

(16) 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)

(17) 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：山东省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)

(18) 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)

(19) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 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>

(20) 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](http://www.essence.com.cn)

(21) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7 层、8 层

法定代表人：黄扬录

联系人：罗艺琳

电话：0755- 82570586

客服电话： 95329

传真：0755-82960582

网址：www.zszq.com

（22）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

（23）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 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 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：姚杨

联系人：王骅

电话：021-20324174

客服电话：400-928-2266

传真：021-20324199

网址：www.dtfunds.com

（24）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东 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

(25) 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

网站：www.jfzinv.com

(26) 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

(27) 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](http://www.chtwm.com)

(28) 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)

(29) 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

联系电话：18810292781

客服电话：400-088-8080

传真：010-82057741

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

(30) 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/>

(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：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

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)

(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：025-66996699-886940

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路 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

(35) 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>

(36) 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

(37) 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.jxzzzg.com.cn

（38）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

（39）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

（40）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)

(41) 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)

(42) 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/>

(43) 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)

(44) 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

## （二）基金登记机构

名称：中科沃土基金管理有限公司

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

联系电话：020-37128624

传真：020-23388722

联系人：高寅初

## （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—9 层

负责人：牟晋军

电话：020-66857288

传真：020-66857289

经办律师：孙晶、侯旺

联系人：孙晶

## （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：杨剑涛、顾仁荣

电话：010-88095588

传真：010-88091190

经办注册会计师：闫靖

联系人：闫靖

电话：180 3809 7687

## 四、基金的名称

中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金

## 五、基金的类型

债券型证券投资基金

## 六、基金的投资目标

本基金通过重点投资中短期利率债券，在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。

## 七、基金的投资方向

本基金的投资范围为国内依法发行上市的国债、央行票据、政策性金融债、债券回购、同业存单、银行存款、现金。

本基金不参与股票、权证等资产的投资，同时本基金不投资于公司债、企业债、短期融资券、中期票据等信用债品种以及可转换债券、可交换债券。

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：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中短期利率债的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金界定的中短期利率债指剩余期限不超过三年的国债、央行票据、政策性金融债。

## 八、基金的投资策略

### 1、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、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。

### 2、债券投资策略

本基金以中短期利率债为主要投资标的。本基金债券投资将采取利率预期与久期管理策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略等积极投资策略。

#### （1）利率预期与久期管理策略

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，确定固定收益类资产的久期配置。

当预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。以达到利用市场利率的波动和债券组合久期的调整提高债券组合收益率目的。

#### （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一个重要依据，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，即通过对收益率曲线形状变化的预测，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

本基金应用骑乘策略，基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整。当收益率曲线比较陡峭时，即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平相对较高的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券收益率的下滑来获得资本利得收益。

#### （4）息差策略



本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资收益的目的。该策略是指在回购利率低于债券收益率的情形下，通过正回购将所获得的资金投资于债券，利用杠杆放大债券投资的收益。

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中短期利率债的比例不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 每个交易日日终，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者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、存出保证金和应收申购款等；

(3) 本基金持有一家公司的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家发行的证券，不超过该证券的 10%；

(5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(6) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(7) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(8) 本基金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的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述 (2)、(7)、(8) 情形之外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，或以调整后的规定为准。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中债 1-3 年政策性金融债指数收益率

## 十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

## 十一、基金的投资组合报告（未经审计）

### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,715,861.90	81.37
	其中：债券	30,715,861.90	81.37
	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	4,200,000.00	11.13
	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	2,159,493.51	5.72
8	其他资产	674,267.33	1.79
9	合计	37,749,622.74	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

本报告期末本基金未持有股票。

(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

本报告期末本基金未持有股票。

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	央行票据	-	-
3	金融债券	30,715,861.90	86.23
	其中：政策性金融债	30,715,861.90	86.23
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,715,861.90	86.23

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	018006	国开 1702	149,010	15,257,133.90	42.83

2	018007	国开 1801	123,190	12,466,828.00	35.00
3	018061	进出 1911	30,000	2,991,900.00	8.40

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	27,996.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	361,784.85
5	应收申购款	284,486.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	674,267.33

#### (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

本报告期末本基金未持有股票。

## 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2019年3月18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) 中科沃土沃安中短利率债券A类基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益

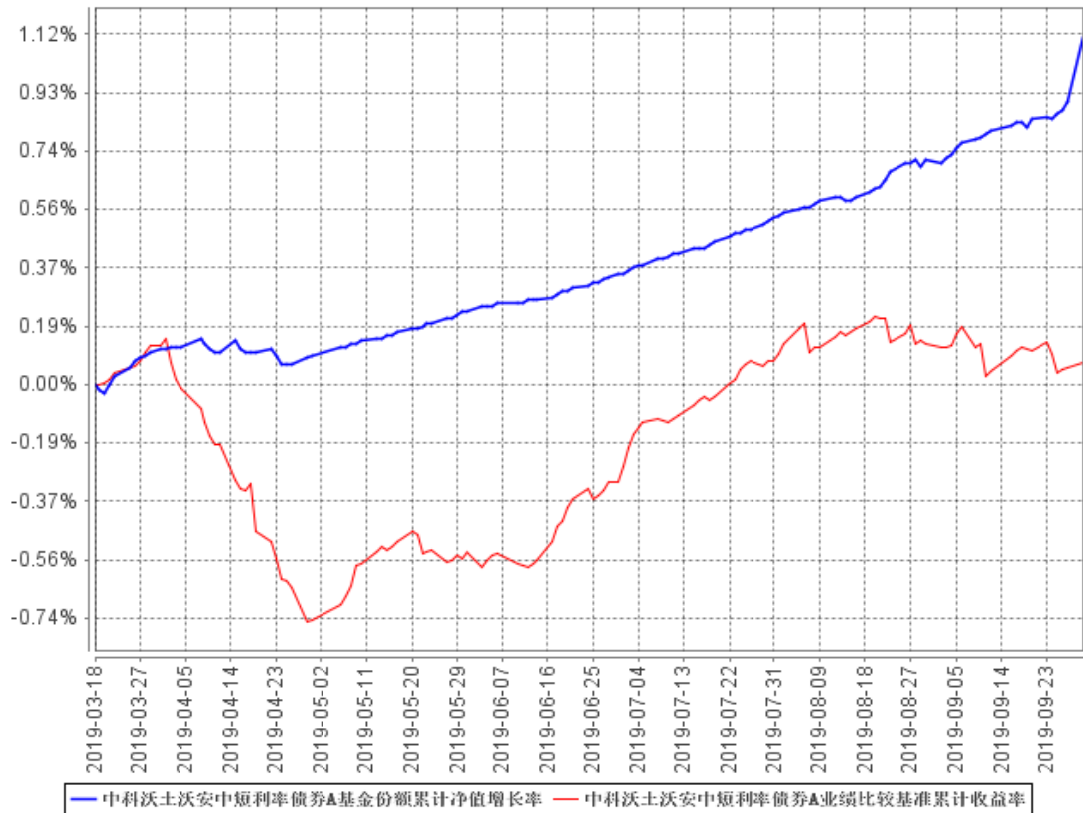
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
基金合同生效至 2019年9月30日	1.15%	0.02%	0.07%	0.04%	1.08%	-0.02%

(2) 中科沃土沃安中短利率债券C类基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益

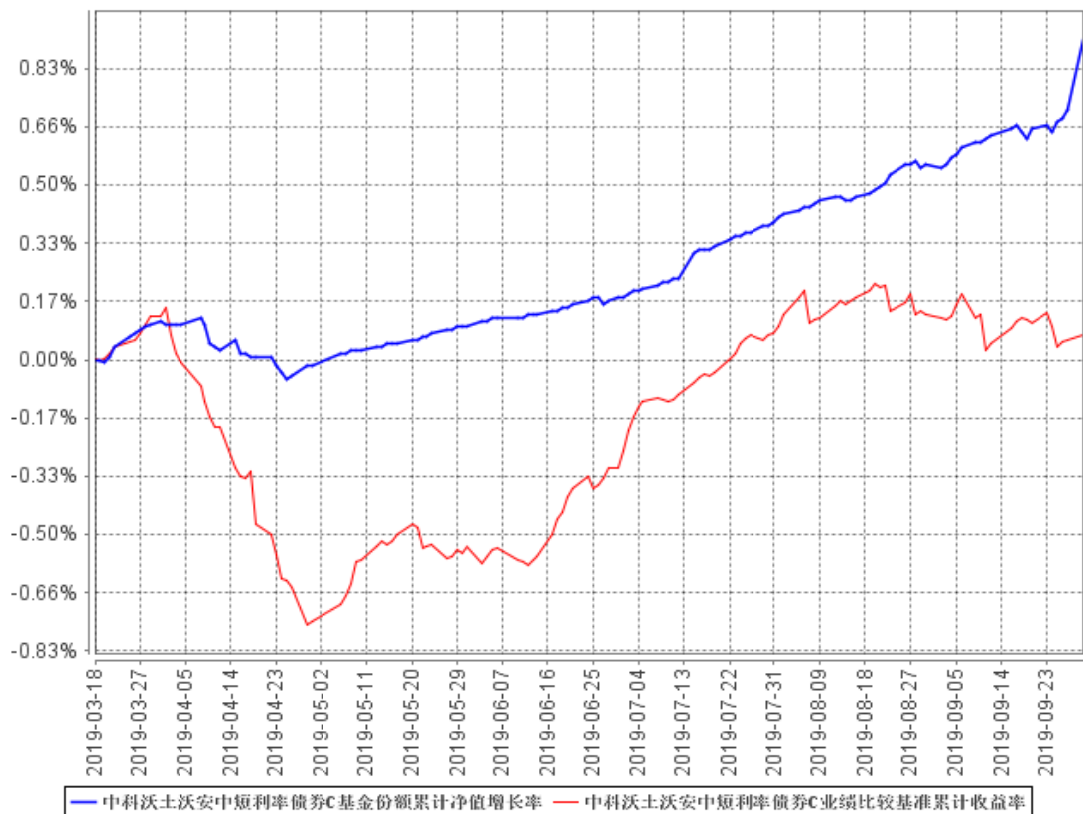
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
基金合同生效至 2019年9月30日	0.95%	0.02%	0.07%	0.04%	0.88%	-0.02%

(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

中科沃土沃安中短利率债券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



中科沃土沃安中短利率债券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、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和维护费用；
- 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。

### 二、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0.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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，基金托管人复核后于次月首日起2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0.08%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

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，基金托管人复核后于次月首日起 2 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 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月首日起 2 个工作日内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 4—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。

### 三、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。

### 四、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，调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。若法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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。

### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 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《中科沃土沃安中短期利率债债券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 12 月 27 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“第三部分基金管理人”，根据最新的资料对主要人员进行更新。
2. 在“第二十四部分其他应披露事项”，根据相关公告披露了部分内容。

中科沃土基金管理有限公司

2020 年 1 月 10 日