

中科沃土沃富 3 号  
集合资产管理计划  
2021 年第四季度报告

2021 年 12 月 31 日



资产管理人：中科沃土基金管理有限公司

资产托管人：中国光大银行股份有限公司北京分行

报告送出日期：二〇二二年一月二十八日

## § 1 重要提示

资产管理人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法律责任。

资产托管人中国光大银行股份有限公司北京分行根据本资产管理合同规定，于 2022 年 1 月 24 日复核了本报告中的主要财务指标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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

## § 2 产品概况

资产管理合同名称	中科沃土沃富 3 号集合资产管理计划资产管理合同
合同生效日	2021年5月24日
投资目标	在风险可控的前提下，力求资产的长期稳定增值
业绩比较基准	从前一次业绩报酬计提日（若无则为份额参与日）至本次业绩报酬基准日，若基金单位份额年化收益率 R 小于或等于 6%时，管理人不提取业绩报酬；若基本计划单位份额年化收益率 R 大于 6%，管理人对超过 6%以上的部分提取 50%作为业绩报酬。
业绩报酬	<p>以业绩报酬计提期间的年化收益率 R，作为计提业绩报酬的基准。</p> $R = \frac{A - B}{C} \times \frac{365}{N} \times 100\%$ <p>A=为本次业绩报酬基准日累计单位净值； B=为上一个业绩报酬计提日（若无则为份额参与日）的累计单位净值； C=为上一个业绩报酬计提日（若无则为份额参与日）的单位净值； N=为本次计提业绩报酬区间天数，即上一个业绩报酬计提日对应的确认日（若无则为份额参与日）至本次业绩报酬基准日对应的确认日的间隔天数。</p> <p>从前一次业绩报酬计提日（若无则为份额参与日）至</p>

	<p>本次业绩报酬基准日，若基金单位份额年化收益率 R 小于或等于 6%时，管理人不提取业绩报酬；若基本计划单位份额年化收益率 R 大于 6%，管理人对超过 6%以上的部分提取 50%作为业绩报酬。</p> <table border="1" data-bbox="667 394 1453 636"> <thead> <tr> <th>年化收益率 (R)</th> <th>计提比例</th> <th>业绩报酬 (H) 计算方法</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td><math>R \leq 6\%</math></td> <td>0</td> <td><math>H = 0</math></td> </tr> <tr> <td><math>6\% &lt; R</math></td> <td>50%</td> <td><math>H = (R - 6\%) \cdot 50\% \cdot C \cdot F \cdot \frac{N}{365}</math></td> </tr> </tbody> </table> <p>F 为业绩报酬基准日投资者单笔投资持有（适用于终止日计提业绩报酬）或退出份额（适用于提取申请日计提业绩报酬）。</p> <p>业绩报酬固定结算日，管理人计算每笔份额的应计提业绩报酬金额，如果有可计提业绩报酬的，对可计提业绩报酬的每笔投资分别计提业绩报酬。份额累计净值保持不变，计提业绩报酬后对每笔投资对应的份额进行扣减。扣减的份额对应的产品资产作为业绩报酬由托管户划出支付给管理人。</p> <p>业绩报酬采用按账户计提的方式，多次追加提取的份额在确定份额参与日或最近报酬计提日时采用“先进先出”法。业绩报酬的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此带来的收益和损失归入计划资产。</p> <p>业绩报酬由注册登记机构负责计算，资产托管人不进行复核，资产管理人向资产托管人发送划款指令，由资产托管人从资产管理计划财产中一次性支付给资产管理人的指定账户。业绩报酬在计提结束后 10 个工作日内支付。</p>	年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (H) 计算方法	$R \leq 6\%$	0	$H = 0$	$6\% < R$	50%	$H = (R - 6\%) \cdot 50\% \cdot C \cdot F \cdot \frac{N}{365}$
年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (H) 计算方法								
$R \leq 6\%$	0	$H = 0$								
$6\% < R$	50%	$H = (R - 6\%) \cdot 50\% \cdot C \cdot F \cdot \frac{N}{365}$								
<p>资产管理人</p>	<p>中科沃土基金管理有限公司</p>									
<p>资产管理费</p>	<p>本合同委托财产的年管理费率为[0.6%]。计算方法如下：</p> $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的委托财产管理费</p> <p>E 为前一日委托财产净值</p> <p>资产管理人的管理费自本计划初始投资起始日（含）起计算，每日计提，按季支付。每季度结束及计划终止日后 10</p>									

	个工作日内，资产管理人向资产托管人发送划款指令，资产托管人收到划款指令后进行复核，并从委托财产中一次性支付给资产管理人。若遇不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。本合同终止（包括提前或延期）后，依据清算程序支付托管人尚未支付的管理费。
资产托管人	中国光大银行股份有限公司北京分行
资产托管费	<p>本委托财产年托管费率为[0.02%]。计算方法如下：</p> $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的委托财产托管费</p> <p>E 为前一日委托财产净值</p> <p>资产托管人的托管费自本计划初始投资起始日（含）起计算，每日计提，按季支付。每季度结束及计划终止日后 10 个工作日内，资产管理人向资产托管人发送划款指令，资产托管人收到划款指令后进行复核，并从委托财产中一次性支付给资产托管人。若遇不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。本合同终止（包括提前或延期）后，依据清算程序支付托管人尚未支付的托管费。</p>

### § 3 主要财务指标

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年10月01日-2021年12月31日）
1.期末单位净值	1.0330
2.期间单位净值增长率	1.61%
3.期末组合资产净值	18,944,263.00

### § 4 投资组合报告

#### 4.1 报告期末委托资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占资产管理计划总资产的比例（%）
----	----	-------	------------------

1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	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	18,150,000.00	95.60
	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	797,361.35	4.20
8	其他资产	38,633.72	0.20
9	合计	18,985,995.07	100.00

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

本报告期末未持有股票。

#### 4.3 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末未持有债券。

#### 4.4 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

本报告期末未持有债券。

#### 4.5 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末未持有资产支持证券。

#### 4.6 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排名的前十名金融衍生品投资明细

本报告期末未持有金融衍生品。

#### 4.7 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本报告期末未持有基金。

#### 4.8 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	38,633.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	38,633.72

#### 4.9 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 4.10 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末未持有股票。

### § 5 管理人履职报告

#### 5.1 管理人对报告期内本资产管理计划运作合规守信情况的说明

本报告期内,本资产计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及资产计划合同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资产管理计划资产,在控制风险的前提下,为委托资产持有人谋求最大利益。在本报告期内,资产管理计划运作合法合规,无损害委托资产持有人利益的行为。

## 5.2 管理人对报告期内风险管理与内部控制制度的执行情况的说明

本资产计划管理人实行私募资产管理业务与其他业务在场地、人员、账户、资金、信息等方面相分离，不同投资经理管理的资产管理计划的持仓和交易等重大非公开投资信息相隔离，控制敏感信息的不当流动和使用。本报告期内未发现内幕交易、利用未公开信息交易、利益冲突和利益输送等情况。

本资产计划管理人建立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。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。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，未发现异常交易行为。

本资产计划管理人建立了信用风险管理制度，对投资对象、交易对手开展必要的尽职调查，实施严格的准入管理和交易额度管理，本报告期内未出现可能影响投资者权益的事项。

本资产计划管理人建立了关联交易管理制度，对关联交易认定标准、交易定价方法、交易审批程序进行规范。本报告期本资产管理计划未与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场。

本资产计划管理人建立了完善的信息披露管理制度，设置专门部门或者专岗负责信息披露工作，本报告期内本资产计划管理人通过规范渠道及时、准确、完整地向投资者披露了相关信息。

本资产计划管理人建立了销售机构和投资顾问的授权管理体系，明确销售机构和投资顾问的准入标准和程序，对相关机构资质条件、专业服务能力和风险管理制度等进行尽职调查。报告期本资产计划管理人严格履行相关程序，未发现销售机构有违法违规行为。

本资产计划管理人按照法规要求开展私募资管产品压力测试，结合测试结果进行风险提示。

本资产计划管理人按照法规要求计提资产管理的风险准备金，选定具有基金托管资格的商业银行开立专门的私募资产管理业务风险准备金账户，严格与公募基金风险准备金账户及其他类型账户分开。

### 5.3 管理人对报告期内委托财产投资策略和运作分析

四季度经济基本面保持一个平稳运行状态，资金面流动性较为宽松，连续降息的言论也时有发生，但是我们注意到，海外病毒变异有可能引发新一轮疫情爆发和蔓延，进而危及全球经济基本面。而中期来说，如果这是一次更严重的病毒入侵，那么一方面：国内管控也会更加严格，不利于一些服务性消费的恢复；另一方面：冲击全球供应链造成市场波动。

针对可能存在的市场波动风险，沃富三号下沉风险偏好。投资策略以逆回购为主，严格把控质押券种，保证产品平稳运行。

### 5.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021年12月29日债市短端和长端较强，是一个比较强的预期信号，市场对于降息存在着一致性，通过降息预期我们可以判断出2022年经济政策还是以宽货币，宽财政，宽信用为主要思路。

沿着主要思路我们判断，2022年会呈现一个开门红的状态，因为有宽信用和宽货币的支撑，需要关注1月份公布的12月份数据和2月份公布的1月份数据。同时在经济走弱的背景下利率也会有调整的可能，所以宽信用和宽财政会对利率构成一定压力，这就导致二季度存在调整的可能性。总体来看2022年市场会呈现先下后上最后走入震荡阶段。

### 5.5 管理人对报告期内资产管理计划投资收益分配情况的说明

本报告期内本资产管理计划未进行分配。

## § 6 资产托管人履职报告

### 6.1 报告期内资产托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，资产托管人——中国光大银行股份有限公司北京分行不存在任何损害计划份额持有人利益的行为，严格遵守了《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他有关法律法规、资产管理合同的约定，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

## 6.2 资产托管人对报告期内本计划投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，托管人未发现管理人在本计划的投资运作、计划资产净值的计算、收益分配、计划份额申购赎回价格的计算、计划费用开支等问题上存在损害计划份额持有人利益的行为，未发现管理人在各重要方面的运作存在违反资产管理合同约定的行为。

## 6.3 资产托管人对本期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本计划的托管人依法对管理人（或其委托的服务机构）提供给托管人复核的2021年第四季度报告中的财务数据进行了复核，复核无误。

## § 7 重大事件揭示

无。

## § 8 声明

本公司郑重承诺报告所提供的内容、数据、报表真实、准确、完整。

中科沃土基金管理有限公司  
二〇二二年一月二十八日



基金