# 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
二〇一八年一月
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，由投资者自行负担。

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%。

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2017年12月29日，与有关财务数据截止日为2017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

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：朱为绎

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 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：

| 股东名称 | 持股比例 |
|---|---|
| 广东中科招商创业投资管理有限责任公司 | 51% |
| 广东省粤科金融集团有限公司 | 20% |
| 广东中广投资管理有限公司 | 4.5% |
| 珠海横琴沃土创业投资有限公司 | 4.9% |
| 珠海横琴沃海投资合伙企业（有限合伙） | 4.9% |
| 珠海横琴沃智投资合伙企业（有限合伙） | 4.9% |
| 珠海横琴沃富投资合伙企业（有限合伙） | 4.9% |
| 珠海横琴沃泽投资合伙企业（有限合伙） | 4.9% |
| 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

朱为绎先生，会计学硕士，董事长，中国注册会计师。曾任中国证监会广东证监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，广东中科招商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，现任中科沃土基金管理有限公司董事长，兼任中科招商投资管理集团股份有限公司常务副总裁、广东中科招商创业投资管理有限责任公司副总裁、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，珠海横琴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，董事，总经理。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董事，总经理。

谢勇先生，企业管理硕士，董事。曾任大鹏证券公司高级投资经理，赛博维尔中国投资基金执行董事，中科招商投资管理集团股份有限公司董事执行副总裁，中炬高新技术实业（集团）股份有限公司独立董事，现任中科招商投资管理集团股份有限公司联席总裁，广东中科招商创业投资管理有限责任公司首席投资官、董事总经理，兼任中山公用事业集团股份有限公司独立董事，广州市政协第十三届委员会委员，广州市股权投资行业协会联席会长，中国股权投资基金50人论坛执行副秘书长，广东省创业投资协会常务副会长，新三板投融资俱乐部首任轮值主席，广州市天河区工商联合会（总商会）执行委员会副主席，广州市天河区工商联合会（总商会）执行委员会副主席。

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、金管科科员，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副部长。兼任广东省粤科融资担保股份有限公司董事长。

潘捷先生，经济学博士，董事。曾任广东省国际问题研究中心副主任科员，广东省政府办公厅副主任科员、主任科员，广东省粤科金融集团有限公司高级经理，广东省粤科母基金投资管理有限公司投资副总监。现任广东省粤科母基金投资管理有限公司副总经理。兼任广东浙大粤科华南创业投资合伙企业（有限合伙）执行事务合伙人委派代表，广东浙大粤科世纪投资管理有限公司法定代表人、总经理，广东省粤科松山湖创新创业投资母基金有限公司董事、总经理。

彭志红女士，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），董事。现任完美（中国）有限公司财务中心总经理，兼任中山市玛丽艳娜美容品有限公司董事，珠海横琴沃海投资合伙企业（有限合伙）执行事务合伙人。

马经先生，高级经济师，独立董事。曾任中国人民银行贵州省分行、海南省分行、深圳特区分行副行长，中国人民银行稽核监督局副局长，中国人民银行广州市分行、深圳中心支行、广州分行行长，中国人民银行巡视二组组长，广东省金融学会第七届理事会会长，十一届全国政协委员。2013年3月退休。

邢志盈先生，文学学士，独立董事。曾任中国工商银行广东省分行科长、办公室副主任、信贷处长、资金计划处长、行长助理、副行长，海南省分行行长。现任中国秦发集团有限公司独立董事。

杨建斌先生，法学博士，独立董事。现任黑龙江大学法学院教授，黑龙江大学知识产权研究中心主任，中国知识产权法学研究会副秘书长，黑龙江省法学会知识产权法学研究会会长，黑龙江省高级人民法院知识产权审判技术咨询专家，黑龙江省商标协会理事，哈尔滨仲裁委员会仲裁员。

（2）监事会成员

胡玮先生，工商管理和信息技术学士，监事会主席。现任广东中科招商创业投资管理有限责任公司总经理助理，广东中广投资管理有限公司副总经理兼董事会秘书。

洪树林先生，FRM，经济学硕士，产品设计与业务创新部总经理、职工代表监事。曾任招商证券股份有限公司资产管理总部投资风险和绩效评估分析师，金鹰基金管理有限公司产品研究员，平安大华基金管理有限公司产品经理，现任中科沃土基金管理有限公司产品设计与业务创新部总经理、职工代表监事。

白玉玲女士，法学硕士，监察风控部副总经理、职工代表监事。曾任河南省信阳国家投资银行营业部科员，中国银行广东省分行法律事务处科员、个人金融部风险经理，现任中科沃土基金管理有限公司监察风控部副总经理、职工代表监事。

（3）高级管理人员

朱为绎先生，会计学硕士，董事长，中国注册会计师，简历同上。

杨绍基先生，管理学博士，董事，总经理，简历同上。

曹萍女士，经济学硕士，律师，督察长。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部门负责人，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。

李昱女士，管理学硕士，副总经理兼权益投资部总经理、基金经理。曾任广发证券股份有限公司环市东营业部业务经理、投资理财部投资经理、资产管理部投资经理，新华基金管理有限公司专户管理部副总监、专户管理部负责人、基金管理部基金经理、基金管理部副总监，现任中科沃土基金管理有限公司副总经理兼任权益投资部总经理、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祥债券型发起式证券投资基金基金经理。

钟俊敏先生，经济学学士、EMBA，常务副总经理兼市场营销总部总经理。曾任中国工商银行广东省营业部个人金融业务部副总经理，博时基金管理有限公司零售部总经理兼任销售管理部总经理，现任中科沃土基金管理有限公司常务副总经理兼任市场营销总部总经理。

傅军先生，计算机专业硕士，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基金经理和中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金基金经理。

李昱女士，管理学硕士，副总经理兼权益投资部总经理、基金经理，简历同上。

杨凡先生，经济学硕士，基金经理。曾任金鹰基金管理有限公司研究部研究员，广发证券股份有限公司自营部研究员，现任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嘉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

本公司公募投资决策委员会成员包括：杨绍基先生、李昱女士、马洪娟女士、赵湘媛女士、杨凡先生。

杨绍基先生，管理学博士，董事，总经理，简历同上。

李昱女士，管理学硕士，副总经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。

赵湘媛女士，工学硕士，研究部副总经理。曾任玛氏中国信息技术部分析师，新华富时指数有限公司研究发展部高级分析师，金鹰基金管理有限公司研究发展部研究员，现任中科沃土基金管理有限公司研究部副总经理。

杨凡先生，经济学硕士，基金经理，简历同上。

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：易会满
注册资本：人民币35,640,625.71万元
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：朱为绎
联系人：古琳花
联系电话：020-23388993
网址：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：易会满
联系人：杨菲
客服电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

（2）广州农村商业银行股份有限公司
注册地址：广州市天河区珠江新城华夏路1号信合大厦
办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路1号信合大厦
法定代表人：王继康
联系人：刘强
电话：020-22389067
客服电话：95313
传真：020-22389031
网址：www.grcbank.com

（3）交通银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路188号
办公地址：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：牛锡明
联系人：张作伟
电话：021-58781234-1740
客服电话：95559
传真：021-58408483
网址：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

（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：010-66568990
网址：www.chinastock.com.cn

（6）万联证券有限责任公司
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：张建军
联系人：甘蕾
电话：020-38286026
客服电话：400-888-8133
传真：020-38286588
网址：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

（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
联系人：梁微
电话：020-88836999
客服电话：95396
传真：020-88836984
网址：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：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41、42、43 楼
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

（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：李玉婷
电话：021-33388229
客服电话：95523或4008895523
传真：021-33388224
网址：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：韩志谦
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

（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

（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：0531-68889095
网址：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：易楠
电话：010-85127629
客服电话：400-619-8888
传真：010-85127641
网址：www.mszq.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：孙名扬
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）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发展大楼7层、8层
办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
法定代表人：黄扬录
联系人：罗艺琳
电话：0755-82943755
客服电话：95329
传真：0755-82960582
网址：www.zszq.com

（17）平安证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人：刘世安
联系人：周一涵
电话：021-38637436
客服电话：95511-8
传真：0755-82435367
网址：http://stock.pingan.com

（18）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：袁顾明
联系人：王骅
电话：021-20324174
客服电话：400-928-2266
传真：021-20324199
网址：http://www.dtfunds.com

（19）珠海盈米财富管理有限公司
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

（20）上海陆金所资产管理有限公司
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15楼
法定代表人：胡学勤
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

（21）上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19楼
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：傅晨
电话：021-33323998
客服电话：4008213999
网址：licaijia.chinapnr.com

（22）深圳市金斧子投资咨询有限公司
注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼
办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼
法定代表人：赖任军
联系人：张烨
电话：0755-29330502
客服电话：400-9500-888
传真：0755-26920530
网址：www.jfzinv.com

（23）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15-1号邮电新闻大厦6层
法定代表人：闫振杰
联系人：刘静
电话：010-59601366-7055
客服电话：400-818-8000
传真：01062020355
网址：www.myfund.com

（24）深圳众禄金融控股股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：0755-33227950
客服电话：400-678-8887
传真：0755-33227951
网址：www.jmmw.com

（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：张鼎
电话：010-53509644
客服电话：400-786-8868
传真：010-56642623
网址：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：黄妮娟
联系电话：021-54509998
客服电话：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn/

（27）乾道金融信息服务（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合生财富广场1302室
法定代表人：王兴吉
联系人：宋子琪
电话：18500501595
客服电话：400-088-8080
传真：010-82057741
网址：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：刘洋
电话：010-85650628
客服电话：400-920-0022
传真：010-65884788
网址：licaike.hexun.com

（29）深圳前海京西票号基金销售有限公司
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：深圳市罗湖区和平路鸿隆世纪广场B座211室
法定代表人：吴永宏
联系人：盖润英
电话：0755-66606450
客服电话：400-800-8668
网址：www.ph6.com

（30）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：熊小满
电话：010-56251471
客服电话：400-619-9059
传真：010-62680827
网址：www.hcjijin.com

（31）奕丰金融服务（深圳）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：0755-89460500
客服电话：400-684-0500
传真：0755-21674453
网址：www.ifastps.com.cn

（32）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：刘汉青
联系人：赵邸
电话：025-66996699-884131
客服电话：95177
传真：025-66996699-884131
网址：www.snjijin.com

（33）浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：杭州市文二西路1号903室
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：刘宁
电话：0571-88911818
客服电话：4008-773-772
传真：0571-86800423
网址：www.5ifund.com

（34）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

（35）北京肯特瑞财富投资管理有限公司
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：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座
法定代表人：江卉
联系人：徐伯宇
电话：010-89189285
客服电话：95118
网址：fund.jd.com

（36）上海云湾投资管理有限公司
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：戴新装
联系人：朱学勇
电话：021-20538888
客服电话：400-820-1515
传真：021-20538999
网址：www.zhengtongfunds.com

（37）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：吴翠
电话：010-60619607
客服电话：010-62675369
传真：8610-62676582
网址：www.xincai.com

（38）武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址：武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号
办公地址：武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号
法定代表人：陶捷
联系人：徐淼
电话：027-87006009-8015
客服电话：400-027-9899
传真：027-87006010
网址：www.buyfunds.cn

（39）江西正融资产管理有限公司
注册地址：江西省南昌市高新开发区紫阳大道绿地新都会38栋商业楼2107室
办公地址：江西省南昌市高新开发区紫阳大道绿地新都会38栋商业楼2107室
法定代表人：陆雯
联系人：傅翌乔
电话：0791-86692502
客服电话：0791-86692502
传真：0791-86692502
网址：www.jxzrzg.com.cn

（40）上海联泰资产管理有限公司
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：燕斌
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

（41）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：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室
法定代表人：杨文斌
联系人：王诗玙
电话：021-20613999
客服电话：400-700-9665
传真：021-68596916
网址：www.ehowbuy.com

（42）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：曹砚财、张萌
电话：010-58349088
客服电话：0891-6177483
传真：010-88371180
网址：www.xiquefund.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：朱为绎
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：广东省广州市越秀区广州大道中289号南方传媒大厦15、16、17、18层
负责人：牟晋军
经办律师：侯旺、陈设
联系人：侯旺
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：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%。

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%*沪深300 指数收益率+90%*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2017年7月1日至2017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 | 227,400.00 | 0.14 |
| | 其中：股票 | 227,400.00 | 0.14 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 110,720,150.00 | 66.04 |
| | 其中：债券 | 110,720,150.00 | 66.04 |
| | 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 | 51,600,000.00 | 30.78 |
| | 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 | 3,150,882.33 | 1.88 |
| 8 | 其他资产 | 1,948,449.20 | 1.16 |
| 9 | 合计 | 167,646,881.53 | 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 | - | - |
| C | 制造业 | 227,400.00 | 0.14 |
| 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 | - | - |
| 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 | - | - |
| 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 | - | - |
| 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 | 227,400.00 | 0.14 |

（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 | 000933 | 神火股份 | 20,000 | 227,400.00 | 0.14 |

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 | 7,996,000.00 | 4.81 |
|