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
二〇一八年七月

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。

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2018年6月6日,与有关财务数据截止日为2018年3月31日,有关净值表现截止日为2018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
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,中国注册会计师,会计学硕士,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、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、广东中科招商沃土一号创业投资基金合伙企业(有限合伙)执行事务合伙人(广东中科招商创业投资管理有限责任公司)委派代表。

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,中山公用事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执行官、董事总经理,兼任广州市政协第十三届委员会委员,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,广州市工商联合会(总商会)执行委员会常务委员,广州市股权投资行业协会联席会长,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,广东省粤科横琴创新创业投资母基金有限公司法定代表人。

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,珠海横琴中鹰企业管理咨询有限公司监事。

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。

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、省行行长助理、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。

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,中国人民银行穆棱监管局副局长,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。

(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。

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部投资风险绩效分析师,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专户业务部产品经理,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,总经理,董事,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、投资银行部总经理助理,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。

李显女士,管理学硕士,副总经理兼任权益投资部总经理、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、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转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

钟俊敏先生,EMBA,常务副总经理兼任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

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、中科沃土沃嘉灵活配置混合型证券投资基金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。

李日曼女士,经济学硕士,基金经理。曾任广州市华美丰收资产管理有限公司投资经理、广东华美国际投资集团有限公司基金经理,现任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、李显女士、马洪娟女士、杨凡先生、赵湘媛女士。

杨绍基先生,管理学博士,总经理、董事,简历同上。

李显女士,管理学硕士,副总经理兼任权益投资部总经理、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。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和中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金基金经理。

杨凡先生,经济学硕士,基金经理,简历同上。

赵湘媛女士,工学硕士,研究部副总经理、基金经理助理。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、基金经理助理。

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:浙江省杭州市庆春路288号
法定代表人:沈仁康
联系人:陈方伟
电话:0571-88261139
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17,959,696,778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: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)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

(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
联系人:杨菲
客服电话:95588
网址:www.icbc.com.cn

(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:沈彬
电话:021-20581763
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:010-83574507
网址: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:郑慧
电话:010-60838888
客服电话:95548
传真:010-60836029
网址: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

(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

(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:黄凤
客户服务电话:95575
网址: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

(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:王超
电话:010-85127570
客服电话:400-619-8888
传真:010-85127641
网址:www.mszq.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:李玉婷
电话:021-33388229
客服电话:95523或4008895523
传真:021-33388224
网址: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: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

(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: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)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

(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

(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605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:www.dtfunds.com

(20)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

(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15楼
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

(22)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
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7层
法定代表人:赖任军
联系人:刘昕霞
电话:0755-29330513
客服电话:400-930-0660
传真:0755-84034477
网址:www.jzinv.com

(23)深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区梨园路6号物资控股置地大厦8楼
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:童彩平
电话:0755-33227950
客服电话:400-678-8887
传真:0755-33227951
网址:www.zlfund.cn

(24)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:400-8980-618
传真:010-56642623
网址:www.chtfund.com

(25)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:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn

(26)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

(27)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

(28)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

(29)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:0755-89460507
客服电话:400-684-0500
传真:0755-21674453
网址:www.ifastps.com.cn

(30)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:赵邵
电话:025-66396699-884131
客服电话:95177
传真:025-66996699-884131
网址:www.snjijin.com

(31)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

(32)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:文斐
电话:010-83363101
客服电话:400-116-1188
传真:010-83363072
网址:8.jrj.com.cn

(33)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

(34)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: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

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

(36)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:15871739736
客服电话:400-027-9899
传真:027-83862682
网址:www.buyfunds.cn

(37)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
联系电话:0791-86692502
客户服务电话:0791-86692502
网址:www.jxzrzg.com.cn

(38)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
联系电话:021-52822063
传真:021-52975270
客户服务电话:400-166-6788
网址:www.66zichan.com

(39)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:王诗玲
电话:13482256958
客服电话:400-700-9665
传真:021-68596916
网址:www.ehowbuy.com

(40)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.xiqufund.com

(41)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

(42)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:李娟
电话:021-50810687
客服电话:021-50810673
传真:021-58300279
网址:www.wacaijijin.com

(43)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:任淑桢
联系人:周映筱
电话:010-66162800
客服电话:400-670-6863
传真:010-66162800
网址:www.hongtaiwealth.com

(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: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: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、梁晓惠
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、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。

(四)资产支持证券投资策略

本基金将通过对宏观经济、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,综合考虑权证标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2018年1月1日至2018年3月31日。

1.报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金