中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金

2018年第二季度报告

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
报告送出日期:2018年7月19日

§1 重要提示

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，于2018年7月18日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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中科沃土沃祥债券发起
交易代码	004550
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年6月29日
报告期末基金份额总额	79,716,868.65份
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。
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。
业绩比较基准	10%*沪深300指数收益率+90%*中债综合指数收益率。
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期（2018年4月1日 - 2018年6月30日）
1.本期已实现收益	542,963.00
2.本期利润	1,126,478.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0133
4.期末基金资产净值	78,548,764.87
5.期末基金份额净值	0.9853

注:（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

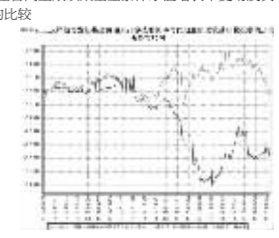
（2）本报告所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后的实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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
过去三个月	1.35%	0.15%	-0.09%	0.14%	1.44%	0.01%

3.2.2 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



注:本基金合同于2017年6月29日生效,按基金合同和招募说明书的约定,本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨凡	基金经理	2017年7月5日	-	6年	经济学硕士，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、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。中国国籍，具有基金从业资格。
马洪娟	固定收益部副总经理、基金经理	2017年6月29日	-	7年	金融学博士，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。中国国籍，具有基金从业资格。
李昱	副总经理兼任权益投资部总经理、基金经理	2017年6月29日	-	21年	管理学硕士，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。中国国籍，具有基金从业资格。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书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基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、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。本基金管理人规定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,以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年二季度债券市场收益率震荡下行。经济基本面方面,经济下行态势初显,但仍有一定韧性。基建、消费持续下滑,而制造业投资和房地产投资仍维持高位,但随着棚改货币化政策的转变,预期房地产投资将逐渐回落。CPI处于低位,国内通胀无忧。监管方面,去杠杆仍在继续,但随着融资环境的大幅恶化,信用风险的逐步暴露,监管层也在陆续出台相关政策缓释信用风险。货币政策方面,央行 6月并未跟随美联储加息且二季度两度宣布定向降准,货币政策有一定的调整。海外方面,中美贸易摩擦愈演愈烈,显著改变了国内债券市场投资者对未来基本面尤其是进出口方面的预期， 未来料将继续对国内债券市场走势形成阶段性影响。总体而言,利率债整体走牛而信用债明显分化。报告期内本基金债券持仓进行了一定的调整,增配一定量的利率债,适度拉长久期。

报告期内上证综指下行,部分板块和个股存在结构性行情,权益投资部分围绕新经济及大消费产业布局,结构配置以消费、医药为主,仓位根据市场态势动态调整,控制相对得当。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.9853元;本报告期基金份额净值增长率为1.35%,业绩比较基准收益率为-0.09%。

§5 投资组合报告

5.1 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	7,816,154.00	9.33
	其中:股票	7,816,154.00	9.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	64,456,425.20	76.93
	其中:债券	64,456,425.20	76.93
	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	7,500,000.00	8.95
	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	917,692.22	1.10
8	其他资产	3,094,362.06	3.69
9	合计	83,784,633.48	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	5,108,889.00	6.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	62,190.00	0.08
F	批发和零售业	265,580.00	0.34
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	994,680.00	1.27
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	161,415.00	0.21
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	1,223,400.00	1.56
S	综合	-	-
	合计	7,816,154.00	9.95

5.2.2 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。

5.3 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	601138	工业富联	90,000	1,659,600.00	2.11
2	603466	风语筑	30,000	787,500.00	1.00
3	600588	用友网络	20,000	490,200.00	0.62
4	601003	柳钢股份	50,000	396,000.00	0.50
5	603678	火炬电子	15,000	373,800.00	0.48
6	002156	通富微电	33,000	357,390.00	0.45
7	002815	崇达技术	20,000	322,000.00	0.41
8	600667	太极实业	43,000	316,480.00	0.40
9	300684	中石科技	3,700	287,749.00	0.37
10	000636	风华高科	17,000	269,960.00	0.34

5.4 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	7,023,499.40	8.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	23,365,489.00	29.75
	其中:政策性金融债	23,365,489.00	29.75
4	企业债券	34,067,436.80	43.37
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	64,456,425.20	82.06

5.5 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	90,000	8,957,700.00	11.40
2	108902	国开1704	83,050	8,305,000.00	10.57
3	1680312	16古阳债	80,000	7,500,800.00	9.55
4	010303	03国债（03）	70,780	7,023,499.40	8.94
5	112424	16文化01	69,970	6,861,957.90	8.74

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本报告期本基金未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	34,370.39
2	应收证券清算款	1,806,617.95
3	应收股利	-
4	应收利息	1,253,373.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,094,362.06

5.10.4 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。

5.10.5 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	91,445,227.55
报告期期间基金总申购份额	255.75
减:报告期期间基金总赎回份额	11,728,614.65
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	79,716,868.65

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	12.54

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	12.54	10,000,000.00	12.54	3年
基金管理人高级管理人员	228,962.98	0.29	228,962.98	0.29	3年
基金经理等人员	198,859.63	0.25	198,859.63	0.25	3年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,427,822.61	13.08	10,427,822.61	18.08	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	2018年4月1日至2018年6月30日	20,005,312.33	-	-	20,005,312.33	25.10%
产品特有风险							
本基金本报告期内有一名个人投资者出现持有份额比例超过20%的情况。原因是由于本基金基金规模缩减,导致其持有份额比例超过20%。截至本报告期末,其持有份额比例为25.10%。本报告期,未发现本基金产品实质上存在持有风险。							

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会准予中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金募集的文件;

2、《中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金基金合同》;

3、《中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、基金托管人业务资格批件、营业执照;

6、关于申请募集注册中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金之法律意见书;

7、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

10.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

中科沃土基金管理有限公司

2018年7月19日

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

2018年第二季度报告

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
报告送出日期:2018年7月19日

§1 重要提示

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，于2018年7月18日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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中科沃土沃鑫成长混合发起
交易代码	003125
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10月25日
报告期末基金份额总额	34,159,570.56份
投资目标	本基金秉承成长投资的理念，在严格控制风险并保持基金投资组合良好的流动性的前提下，通过积极挖掘成长性行业和企业所蕴含的投资机会,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	通过对经济周期及资产价格发展变化的理解，在把握经济周期性波动的基础上,动态评估不同资产类在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征,追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置及资产的稳健增长。基于成长投资的理念,投资于优选行业中的绩优股票;对于债券投资,采用期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、可转换债券投资策略等;适当参与股指期货、权证、国债期货等金融衍生品的投资,进行分散投资,力求实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合全价（总值）指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期收益和预期风险低于股票型基金,高于货币市场基金和债券型基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期（2018年4月1日 - 2018年6月30日）
1.本期已实现收益	-1,976,273.09
2.本期利润	-3,777,223.85
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1075
4.期末基金资产净值	30,506,234.10
5.期末基金份额净值	0.8930

注:（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

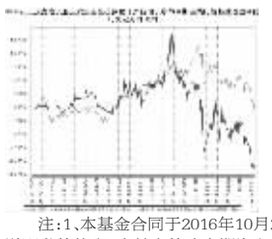
（2） 本报告所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后的实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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
过去三个月	-10.84%	0.94%	-4.47%	0.57%	-6.37%	0.37%

3.2.2 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



注:1、本基金合同于2016年10月25日生效,按基金合同和招募说明书的约定,本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李昱	副总经理兼任权益投资部总经理、基金经理	2016年10月25日	-	21年	管理学硕士，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。中国国籍,具有基金从业资格。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书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基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、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。本基金管理人规定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,以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,市场运行大体分为两段。4-5月小幅震荡,整体平稳,产品配置以计算机为代表的新经济和扩大内需稳经济的消费为主。5月底以来,受信用风险暴露、中美贸易摩擦升级、去杠杆监管政策及汇率下跌等影响,市场风险偏好显著回落,指数大幅调整。受市场影响,产品在二季度没有获取正收益,但也进行了有效的防御,提前降低仓位,有效控制了净值的回撤。展望三季度,预期监管边际放缓， 流动性压力有所缓解， 目前市场估值水平已经低于上证综指2638点时,不易过于悲观。配置方向以有望持续获得国家层面支持的大创新以及调整后的消费为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.8930元；本报告期基金份额净值增长率为-10.84%,业绩比较基准收益率为-4.47%。

§5 投资组合报告

5.1 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	7,925,772.69	25.01
	其中:股票	7,925,772.69	25.01
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	-	-
	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	23,669,721.99	74.69
8	其他资产	97,177.74	0.31
9	合计	31,692,672.42	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	7,925,772.69	25.98
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	7,925,772.69	25.98

5.2.2 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。

5.3 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	000977	浪潮信息	81,163	1,935,737.55	6.35
2	603939	益丰药房	23,276	1,235,257.32	4.05
3	000967	盈峰环境	93,883	748,247.51	2.45
4	603690	至纯科技	34,076	553,735.00	1.82
5	600845	宝信软件	18,897	497,935.95	1.63
6	603019	中科曙光	8,232	377,601.84	1.24
7	600588	用友网络	14,526	356,032.26	1.17
8	002371	北方华创	6,111	303,533.37	1.00
9	600271	航天信息	9,803	247,721.81	0.81
10	601318	中国平安	4,095	239,885.10	0.79

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

5.5 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

本报告期末本基金未持有债券。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	91,884.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,501.42
5	应收申购款	792.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	97,177.74

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603939	益丰药房	1,235,257.32	4.05	重大事项
2	000967	盈峰环境	748,247.51	2.45	重大事项
3	603690	至纯科技	553,735.00	1.82	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	35,967,740.31
报告期期间基金总申购份额	145,921.57
减:报告期期间基金总赎回份额	1,954,091.32
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	34,159,570.56

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	4,975,124.38
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	4,975,124.38
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	14.56

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	4,975,124.38	14.56	4,975,124.38	14.56	3年
基金管理人高级管理人员	1,931,683.70	5.65	1,931,683.70	5.65	3年
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	4,173,935.99	12.22	4,173,935.99	12.22	3年
其他	-	-	-	-	-
合计	11,080,744.07	32.44	11,080,744.07	32.44	3年

注:本基金的基金经理同时为基金管理人高级管理人员。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予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注册的文件;

2、《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合同》;

3、《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托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、基金托管人业务资格批件、营业执照;

6、关于申请募集注册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之法律意见书;

7、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

中科沃土基金管理有限公司

2018年7月19日

中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

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
报告送出日期:2018年7月19日

§1 重要提示

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,于2018年7月18日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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中科沃土转型升级混合
交易代码	005281
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年1月25日
报告期末基金份额总额	119,751,438.03份
投资目标	在严格控制风险的前提下，把握中国经济转型升级过程中所蕴含的投资机会,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	通过对经济周期及资产价格发展变化的理解，在把握经济周期性波动的基础上,动态评估不同资产类在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征,追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置及资产的稳健增长。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合全价（总值）指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期收益和预期风险低于股票型基金,高于货币市场基金和债券型基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期（2018年4月1日 - 2018年6月30日）
1.本期已实现收益	-2,796,765.95
2.本期利润	-7,615,673.77
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0608
4.期末基金资产净值	110,071,711.93
5.期末基金份额净值	0.9192

注:（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

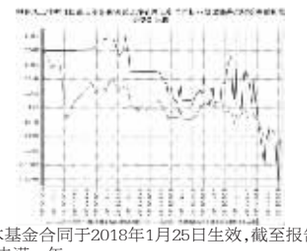
（2）本报告所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后的实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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
过去三个月	-6.30%	1.48%	-4.47%	0.57%	-1.83%	0.91%

3.2.2 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



注:1、本基金合同于2018年1月25日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定,本基金的建仓期为六个月，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨凡	基金经理	2018年1月25日	-	6年	经济学硕士，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