中科沃土转型升级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：中国工商银行股份有限公司
二〇一八年八月

重要提示

本基金根据2017年8月11日中国证券监督管理委员会《关于准予中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]1484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。

本基金可以参与中小企业私募债券的投资。中小企业私募债发行人为中小微、非上市企业，存在着公司治理结构相对薄弱、企业经营风险高、信息披露透明度不足等特点。投资中小企业私募债将存在违约风险和流动性不足的风险，这将在一定程度上增加基金的信用风险和流动性风险。

本基金为混合型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金和债券型基金，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的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、货币市场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：股票投资比例为基金资产的0%-95%，其中，投资于转型升级主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券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、应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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8月22日，与有关财务数据截止日为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（集中办公区）

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 1.3 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	54.30%
广东省粤科金融集团有限公司	15.38%
珠海横琴沃智投资合伙企业（有限合伙）	4.90%
珠海横琴沃富投资合伙企业（有限合伙）	4.90%
珠海横琴沃拓投资合伙企业（有限合伙）	4.90%
珠海横琴沃泽投资合伙企业（有限合伙）	4.62%
珠海横琴沃土创业投资有限公司	3.77%
珠海横琴沃海投资合伙企业（有限合伙）	3.77%
广东中广投资管理有限公司	3.46%
合计	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。

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。现任中国奏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。

（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、合规负责人。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。

李昱女士，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、资产管理部基金经理、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。

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

李昱女士，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。

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、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。

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、赵湘媛女士及杨凡先生。

杨绍基先生，管理学博士，总经理、董事，简历同上。

李昱女士，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。

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。

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）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

（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：0755-82817529

客服电话：0756-96588

传真：0755-82817612

网址：www.crbank.com.cn

（4）东莞证券股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号

法定代表人：陈照星

联系人：李荣

电话：0769-22115712

客服电话：95328

传真：0769-22115712

网址：www.dgzq.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：马静懿

电话：010-60833889

客服电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

（7）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

客服电话：95575

网址：www.gf.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）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

（10）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

（11）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

（12）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

（13）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

（14）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- 82570586

客服电话：95329

传真：0755-82960582

网址：www.zszq.com

（15）长江期货股份有限公司

注册地址：武汉市武昌区中北路9号长城汇T2号写字楼第27、28层

办公地址：武汉市武昌区中北路9号长城汇T2号写字楼第27层

法定代表人：谭显荣

联系人：梅晨

电话：027-65261375

客服电话：027-85861133、95579

传真：027-85860103

网址：www.cjfco.com.cn

（16）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

（17）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

（18）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

（19）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2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：010-62020355

网址：www.myfund.com

（20）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

传真：021-64385308

网址：www.1234567.com.cn

（21）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

（22）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

（23）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

（24）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：赵耶

电话：18551602256

客服电话：95177

传真：025-66008800-884131

网址：www.snjijin.com

（25）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路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

（26）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

（27）北京恃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

（28）上海云湾基金销售有限公司

注册地址：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

（29）武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第7栋23层1号、4号

办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第7栋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

（30）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：王诗玙

电话：13482256958

客服电话：400-700-9665

传真：021-68596916

网址：www.howbuy.com

（31）江西正融基金销售有限公司

注册地址：江西省南昌市高新技术产业开发区紫阳大道绿地新都会紫峰大厦写字楼1103室

办公地址：江西省南昌市高新技术产业开发区紫阳大道绿地新都会紫峰大厦写字楼1103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

（32）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

（33）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

（34）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

（35）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

（36）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

（37）天津万家财富资产管理有限公司

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A座五层

法定代表人：李修辞

联系人：王茜蕊

电话：15321711533

客服电话：010-59013825

传真：010-59013828

网址：www.wanjiawealth.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：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冼村路5号凯华国际中心7-9楼

负责人：牟晋军

电话：020-66857288

传真：020-66857289

经办律师：孙晶、陈设

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：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

中科沃土转型升级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

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。

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股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、货币市场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：股票投资比例为基金资产的0%-95%，其中，投资于转型升级主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券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、应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

八、基金的投资策略

1、类属资产配置策略

基金管理人基于稳健投资的原则，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。

（1）当宏观基本面向好、GDP稳步增长且预期股票市场趋于上涨时，本基金将采取积极进取的做法，主要投资于股票市场，分享股票市场上涨带来的收益；

（2）当宏观基本面一般、GDP增长缓慢且预期股票市场趋于下跌时，本基金将采取相对稳健的做法，减少股票投资比例，增加债券或现金类资产比例，回避股票市场下跌的系统性风险，避免投资组合的损失；

（3）在预期利率上升、债券价格将下降时，本基金将及时调整债券组合久期，债券资产主要投资于浮息债券和久期较短的债券；

（4）在预期利率下降、债券价格将上升时，本基金的债券资产将主要投资于中长期债券，以实现较高的收益；

（5）在预期股票市场和债券市场都存在下跌风险时，本基金将减少股票和债券的持有比例，除现金资产外，增加债券回购、央行票据等现金类资产的比例。

基于基金管理人对经济周期及资产价格发展变化的深刻理解，通过定性和定量的方法分析宏观经济、资本市场、政策导向等各方面因素，建立基金管理人对各大类资产收益的绝对或相对预期，决定各大类资产配置权重。

2、股票投资策略

（1）转型升级主题界定

本基金所指的转型升级主题主要指的是转型升级过程中所不断涌现出的行业个股的投资机会。转型升级主要包含三个层次，即经济结构转型、产业结构转型升级和企业自身的转型升级。其一，经济结构转型的核心是转变经济增长的方式，即把高投入、高消耗、高污染、低产出、低质量、低效益转为低投入、低消耗、低污染、高产出、高质量、高效益，把粗放型转为集约型，实现经济增长的健康持续；其二，产业结构转型升级，既包括产业间的转型升级，如在整个产业结构的转型，即产业结构中由第一产业占优势比重逐级向第二、第三产业占优势比重演进，也包括产业内的升级，即某一产业内部的加工和再加工程度逐步向纵深化发展，实现技术集约化，不断提高生产效率；其三，企业通过内部技术创新，流程重组等，提升企业自身的生产效率，提高企业的价值，或者进行资产重组，通过兼并、接管、破产、倒闭等方式寻求资源的有效利用。

具体而言，本基金界定的转型升级主题主要包括以下三点：

1）符合国家经济结构转型战略的、在国家经济结构转型中受益成长的，由此而获取持续健康增长的行业及公司；

2）在产业转型升级背景下，行业整体效率显著提升并带来市场容量的进一步扩大，内在发展潜力显著增强的行业及公司；

3）主动采用技术革新、重组、兼并等方式积极调整转型升级的，并因此获取持续健康成长的公司；

（2）行业配置

在行业配置层面，管理人倾向于以下三类行业：

1）受益于经济结构转型的现代服务及消费领域

根据国外发展经验，在经济转型过程中，消费在国民经济中的占比会有所上升，我国的经济发展中正在逐步体现，与此相关，经济转型期的现代服务业也存在较大的发展空间和投资机会。如智能家居、在线教育、现代物流等领域的需求将明显增加。

2）受益于产业结构优化升级中新兴产业占比提升的行业

新兴产业是随着新的科研成果和新兴技术的发明和应用出现的新的部门和行业，具有知识技术密集、物质资源消耗少、成长潜力大、综合效益好的特点。新兴产业在产业结构转型过程中存在广阔的机遇，同时也对未来新经济增长动力的形成起到重要作用。新兴产业主要包括节能环保、信息技术、生物技术、新能源、新材料、新能源汽车等。

3）传统行业中主动通过技术革新、并购、重组等方式积极转型的

在经济结构及发展模式转型过程中，总需求放缓导致传统行业竞争趋于激烈，提高传统企业竞争力需求更加强烈，其中的优势企业将率先主动转型升级，从而激烈的在竞争中脱颖而出，占据更高的市场份额。与之相关的行业集中度随之进一步提升，由此将带来竞争格局改善和盈利能力提升，龙头公司、优势企业将在转型升级的过程中将持续受益。相关产业主要包括现代农业，商业零售的线上线下模式，吸收并综合利用电子信息技术、计算机、机械、材料以及现代管理技术的先进制造业，如电力及通信设备制造、装备制造、医药制造、医疗仪器制造等。

具体分析时，管理人通过跟踪各行业整体的收入增速、利润增速、毛利率变动幅度、ROIC变动情况，依此来判断各行业的景气度，再根据行业整体的估值情况，市场的预期，目前机构配置的比例来综合考虑各行业在组合中的配置比例。

（3）个股选择

本基金将主要采用“自下而上”的方法，在备选行业内部通过定量与定性相结合的分析方法，综合分析上市公司的业绩质量、成长性和估值水平等，精选具有良好成长性、估值合理的个股。本基金将首先采用定量的方法分析公司的财务指标，考察上市公司的盈利能力、盈利质量、成长能力、运营能力以及负债水平等方面，初步筛选出财务健康、成长性良好的优质股票。此外，本基金将从公司所处行业的投资价值、核心竞争力、主营业务成长性、公司治理结构、经营管理能力、商业模式、受益于经济转型的程度等多角度对股票进行定性分析。

1）个股定量分析

公司的成长性最终体现为利润的增长。因此，本基金将预期主营业务收入增长率和预期主营业务利润率作为企业成长性考察的主指标，并结合税后利润增长率、净资产收益率等指标，筛选出盈利能力超过市场平均水平的上市公司。

①主营业务收入增长率。主营业务收入的增长往往意味着公司市场份额的扩大，是把握公司成长性的主要指标。本基金在考察主营业务收入增长率时，将在考察历史主营业务收入增长率的基础上，结合分析公司的产能扩张、主导产品的市场供求变化趋势、行业竞争格局、以及产品的差异性或替代性等因素，参考上市公司的存货周转率、应收账款周转率指标，从而准确把握预期主营业务收入增长的质量和有效性。

②主营业务利润率。主营业务利润率反映了公司主营业务获利能力的强弱，是企业核心竞争能力之所在。

2）个股定性分析

在定性分析方面，本基金主要挑选全部或部分具备以下特征的上市公司：

①经济新常态下受益于改革，分享改革红利的优质企业；

②公司所处的行业符合国家的战略发展方向，并且公司在行业中具有竞争优势；

③具备一定竞争壁垒的核心竞争力；

④公司具有良好的治理结构，有良好的激励机制，并且企业的信息披露公开透明；

⑤公司具有良好的创新能力。

3）个股估值分析

为了避免投资估值过高的股票，本基金将根据上市公司所处行业、业务模式以及公司发展中所处的不同阶段等特征，综合利用市盈率法（P/E）、市净率法（P/B）、市盈率-长期成长法（PEG）、折现现金流法（DCF）等估值方法对公司的估值水平进行分析比较，筛选出估值合理或具有吸引力的公司进行投资。

3、债券投资策略

本基金采用的债券投资策略包括：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。

（1）期限结构策略

通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对各类型债券进行久期配置。具体策略又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。

（2）信用策略

信用债收益率等于基准收益率加信用利差，信用利差收益主要受两个方面的影响，一是该信用债对应信用水平的市场平均信用利差曲线走势；二是该信用债本身的信用变化。基于这两方面的因素，本基金管理人分别采用基于信用利差曲线变化策略和基于信用债信用变化策略。

（3）互换策略

不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面存在差别，投资管理人可以同时买入和卖出具有相近特性的两个或两个以上券种，赚取收益级差。

（4）息差策略

通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，从而获得杠杆放大收益。

（5）可转换债券投资策略

本基金利用宏观经济变化和上市公司的盈利变化，判断市场的变化趋势，选择不同的行业，再根据可转换债券的特性选择各行业不同的转债券种。本基金利用可转换债券的债券底价和到期收益率来判断转债的债性，增强本金投资的相对安全性；利用可转换债券溢价率来判断转债的股性，在市场出现投资机会时，优先选择股性强的品种，获取超额收益。

（6）中小企业私募债券投资策略

针对中小企业私募债券，本基金以持有到期、获得本金和票息收入为主要投资策略，同时，密切关注债券的信用风险变化，力争在控制风险的前提下，获得较高收益。

4、金融衍生品投资策略

（1）权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。本基金将主要投资满足成长和价值优选条件的公司发行的权证。

（2）股指期货的投资策略

在股指期货的投资方面，本基金以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。

1）避险保值：利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，避免市场的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

2）有效管理：利用股指期货流动性好，交易成本低等特点，对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。

（3）国债期货投资策略