中科沃土货币市场基金

2017年第三季度报告

基金管理人:中科沃土基金管理有限公司
基金托管人:广州农村商业银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月26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。

基金托管人广州农村商业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月19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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中科沃土货币	
基金主代码	002646	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年6月6日	
报告期末基金份额总额	503,444,784.54份	
投资目标	在综合考虑基金资产收益性、安全性和流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争获取超越业绩比较基准的稳定收益。	
投资策略	本基金将在深入研究国内外宏观经济、货币政策、通货膨胀、信用状态等因素的基础上,分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势,并综合考虑各类投资品种的流动性、风险性和收益性,决定基金资产在银行存款及同业存单、债券回购、利率债、信用债、资产支持证券等各类资产的配置比例以及投资组合的平均剩余期限,并适时进行动态调整,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。具体投资策略包括资产配置策略、久期策略、流动性管理策略、银行存款及同业存单投资策略、债券回购投资策略、利率债品种的投资策略、信用债品种的投资策略等投资管理策略。	
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、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	广州农村商业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中科沃土货币A	中科沃土货币B
下属分级基金的交易代码	002646	002647
报告期末下属分级基金的份额总额	36,266,673.27份	467,178,111.27份

§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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)	
	中科沃土货币A	中科沃土货币B
1. 本期已实现收益	336,614.27	4,800,331.83
2. 本期利润	336,614.27	4,800,331.83
3. 期末基金资产净值	36,266,673.27	467,178,111.27

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中科沃土货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9573%	0.0002%	0.3450%	0.0000%	0.6123%	0.0002%

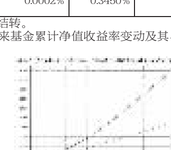
注:本基金收益分配按日结转。

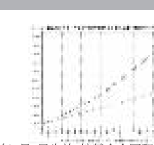
中科沃土货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0183%	0.0002%	0.3450%	0.0000%	0.6733%	0.0002%

注:本基金收益分配按日结转。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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2016年6月6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		
马洪娟	固定收益部副总经理、基金经理	2016年6月6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。

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

本季度内货币政策仍维持稳健中性状态,资金价格较二季度略有抬升。临近季末,受超储率处于历史低位的影响,叠加MPA考核及缴税的影响,资金价格大幅上行,然而各银行的同业存单发行价格单边上行,整体来看,三季度市场利率维持相对平稳的状态。随着《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的发布,各大公募机构纷纷提前实行新规,私募类证券资管产品的融资成本进一步提高,市场分层更为明显。

报告期内,本基金在资产配置上以高等级的同业存单、存款和回购为主,抓住资金利率较高的时点提升组合收益率。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期中科沃土货币A的基金份额净值收益率为0.9573%,本报告期中科沃土货币B的基金份额净值收益率为1.0183%,同期业绩比较基准收益率为0.3450%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日以上基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	固定收益投资	228,171,964.03	45.28
	其中:债券	228,171,964.03	45.28
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	98,031,627.05	19.45
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	176,374,939.04	35.00
4	其他资产	1,366,004.16	0.27
5	合计	503,944,534.28	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.78	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	74
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	78
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	37

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本基金未出现投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	30.99	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	2.38	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	55.02	-
4	90天(含)-120天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	11.13	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.52	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本基金未出现投资组合平均剩余期限超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,017,330.20	5.96
	其中:政策性金融债	30,017,330.20	5.96
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	198,154,633.83	39.36
8	其他	-	-
9	合计	228,171,964.03	45.32
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111707239	17招商银行CD239	500,000	49,564,452.18	9.85
2	111708299	17中信银行CD299	500,000	49,555,223.43	9.84
3	111709259	17浦发银行CD259	500,000	49,520,520.46	9.84
4	111711268	17平安银行CD268	500,000	49,514,437.76	9.84
5	170308	17进口08	300,000	30,017,330.20	5.96

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0495%
报告期内偏离度的最低值	-0.0150%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0202%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本基金不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金采用"摊余成本法"计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。

5.9.2

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。

5.9.3 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	应收利息	1,365,564.09
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	440.07
7	其他	-
8	合计	1,366,004.16

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	中科沃土货币A	中科沃土货币B
报告期期初基金份额总额	32,808,031.03	410,770,128.39
报告期期间基金总申购份额	20,513,444.46	271,863,029.26
报告期期间基金总赎回份额	17,054,802.22	215,455,046.38
报告期期末基金份额总额	36,266,673.27	467,178,111.27

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2017年7月7日	4,000,000.00	4,000,000.00	0.00%
2	赎回	2017年8月10日	-3,000,000.00	-3,000,000.00	0.00%
3	赎回	2017年9月8日	-2,000,000.00	-2,000,000.00	0.00%
4	红利再投资	2017年7月3日	4,061.91	4,061.91	0.00%
5	红利再投资	2017年7月4日	1,362.06	1,362.06	0.00%
6	红利再投资	2017年7月5日	1,360.32	1,360.32	0.00%
7	红利再投资	2017年7月6日	1,322.18	1,322.18	0.00%
8	红利再投资	2017年7月7日	1,322.36	1,322.36	0.00%
9	红利再投资	2017年7月10日	5,290.72	5,290.72	0.00%
10	红利再投资	2017年7月11日	1,756.65	1,756.65	0.00%
11	红利再投资	2017年7月12日	1,752.57	1,752.57	0.00%
12	红利再投资	2017年7月13日	1,758.75	1,758.75	0.00%
13	红利再投资	2017年7月14日	1,750.63	1,750.63	0.00%
14	红利再投资	2017年7月17日	5,320.91	5,320.91	0.00%
15	红利再投资	2017年7月18日	1,764.96	1,764.96	0.00%
16	红利再投资	2017年7月19日	1,750.07	1,750.07	0.00%
17	红利再投资	2017年7月20日	1,777.69	1,777.69	0.00%
18	红利再投资	2017年7月21日	1,778.50	1,778.50	0.00%
19	红利再投资	2017年7月24日	5,270.67	5,270.67	0.00%
20	红利再投资	2017年7月25日	1,744.36	1,744.36	0.00%
21	红利再投资	2017年7月26日	1,739.92	1,739.92	0.00%
22	红利再投资	2017年7月27日	1,751.57	1,751.57	0.00%
23	红利再投资	2017年7月28日	1,820.40	1,820.40	0.00%
24	红利再投资	2017年7月31日	5,472.74	5,472.74	0.00%
25	红利再投资	2017年8月1日	1,834.32	1,834.32	0.00%
26	红利再投资	2017年8月2日	1,818.35	1,818.35	0.00%
27	红利再投资	2017年8月3日	1,818.39	1,818.39	0.00%
28	红利再投资	2017年8月4日	1,796.74	1,796.74	0.00%
29	红利再投资	2017年8月7日	5,336.81	5,336.81	0.00%
30	红利再投资	2017年8月8日	1,747.87	1,747.87	0.00%
31	红利再投资	2017年8月9日	1,738.79	1,738.79	0.00%
32	红利再投资	2017年8月10日	1,749.72	1,749.72	0.00%
33	红利再投资	2017年8月11日	1,419.94	1,419.94	0.00%
34	红利再投资	2017年8月14日	4,193.62	4,193.62	0.00%
35	红利再投资	2017年8月15日	1,401.13	1,401.13	0.00%
36	红利再投资	2017年8月16日	1,412.05	1,412.05	0.00%
37	红利再投资	2017年8月17日	1,413.10	1,413.10	0.00%
38	红利再投资	2017年8月18日	1,448.30	1,448.30	0.00%
39	红利再投资	2017年8月21日	4,368.96	4,368.96	0.00%
40	红利再投资	2017年8月22日	1,465.68	1,465.68	0.00%
41	红利再投资	2017年8月23日	1,472.12	1,472.12	0.00%
42	红利再投资	2017年8月24日	1,475.16	1,475.16	0.00%
43	红利再投资	2017年8月25日	1,489.68	1,489.68	0.00%
44	红利再投资	2017年8月28日	4,356.53	4,356.53	0.00%
45	红利再投资	2017年8月29日	1,443.55	1,443.55	0.00%
46	红利再投资	2017年8月30日	1,465.66	1,465.66	0.00%
47	红利再投资	2017年8月31日	1,485.85	1,485.85	0.00%
48	红利再投资	2017年9月1日	1,486.13	1,486.13	0.00%
49	红利再投资	2017年9月4日	4,457.27	4,457.27	0.00%
50	红利再投资	2017年9月5日	1,485.83	1,485.83	0.00%
51	红利再投资	2017年9月6日	1,468.38	1,468.38	0.00%
52	红利再投资	2017年9月7日	1,468.31	1,468.31	0.00%
53	红利再投资	2017年9月8日	1,413.63	1,413.63	0.00%
54	红利再投资	2017年9月11日	3,611.68	3,611.68	0.00%
55	红利再投资	2017年9月12日	1,209.39	1,209.39	0.00%
56	红利再投资	2017年9月13日	1,247.06	1,247.06	0.00%
57	红利再投资	2017年9月14日	1,275.31	1,275.31	0.00%
58	红利再投资	2017年9月15日	1,247.31	1,247.31	0.00%
59	红利再投资	2017年9月18日	3,717.84	3,717.84	0.00%
60	红利再投资	2017年9月19日	1,239.37	1,239.37	0.00%
61	红利再投资	2017年9月20日	1,245.91	1,245.91	0.00%
62	红利再投资	2017年9月21日	1,227.32	1,227.32	0.00%
63	红利再投资	2017年9月22日	1,236.05	1,236.05	0.00%
64	红利再投资	2017年9月25日	3,685.00	3,685.00	0.00%
65	红利再投资	2017年9月26日	1,229.25	1,229.25	0.00%
66	红利再投资	2017年9月27日	1,222.59	1,222.59	0.00%
67	红利再投资	2017年9月28日	1,222.00	1,222.00	0.00%
68	红利再投资	2017年9月29日	1,272.83	1,272.83	0.00%
合计			-862,249.28	-862,249.28	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	1	2017年7月1日至2017年8月25日	132,728,774.85份	1,158,858.41份	50,000,000.00份	83,843,082.01份	16.65%
产品特有风险							
中科沃土货币基金因市场波动、基金规模变动影响,导致该名机构投资者在本报告期间出现持有份额比例被动超过20%的情况。该名投资者本报告期内由于持有份额变化,截止本报告期末其持有份额比例已降至20%以下,故本基金产品实质上未发现特有风险。							

注:上述申购份额为红利再投资份额。

-

§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货币市场基金注册的文件;

2、《中科沃土货币市场基金基金合同》;

3、《中科沃土货币市场基金托管协议》;

4、《中科沃土基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

5、法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

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

2017年10月26日

中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金

2017年第三季度报告

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:2017年10月26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2017年10月23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2017年7月1日起至2017年9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
基金主代码	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	166,302,241.74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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	861,108.78
2.本期利润	128,138.16
3.加权平均基金份额本期利润	0.0007
4.期末基金资产净值	166,380,450.49
5.期末基金份额净值	1.0005

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。

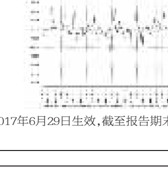
(2)本报告所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后的实际收益水平要低于所列数字。

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	0.04%	0.07%	0.33%	0.06%	-0.29%	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:1、本基金合同于2017年6月29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		
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。
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。
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

2017年三季度债券市场收益率呈现小幅震荡上行的态势。从7、8两个月的经济数据来看,社会销费品零售总额和工业增加值乏力,进出口增速高位回落,经济增速放缓态势初显。但是,金融严监管仍在继续,随着去年成立的委外产品在三季度陆续到期,以及机构投资者对监管政策的担忧,债市新增资金较少。整体而言,7-8月利率债上行10-20bp,信用债上行20-30bp,9月上旬开始,收益率小幅回落,但三季度收益率整体小幅上行,信用利差走阔。报告期内本基金债券持仓以中短期债券为主。

2017年三季度大盘处于震荡上行的趋势中。三季度,上证50上涨幅度4.8%、沪深300上涨幅度4.6%、创业板指上涨幅度2.7%。本报告期内,鉴于对本基金封闭期内保守操作的原则,权益类运作上以谨慎稳健为原则,优选受益于政策变化业绩改善的周期类个股,以及增量空间大、受国家政策鼓励的行业个股。

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1.0005元;本报告期基金份额净值增长率为0.04%,业绩比较基准收益率为0.33%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日以上基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	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

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	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

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	000933	神火股份	20,000	227,400.00	0.14

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	7,996,000.00	4.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	102,724,150.00	61.74
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	110,720,150.00	66.55

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	112424	16文化01	150,000	14,769,000.00	8.88
2	136591	16西经发	140,000	13,721,400.00	8.25
3	112447	16顺发债	100,000	9,808,000.00	5.89
4	136419	16国华01	100,000	9,773,000.00	5.87
5	112416	16奥燃02	100,000	9,710,000.00	5.84

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

本报告期无任何公募基金投资国债期货。

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	16,056.82
2	应收证券清算款	617,054.79
3	应收股利	-
4	应收利息	1,315,337.59
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,948,449.20

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	183,824,290.09
报告期期间基金总申购份额	4,982,560.23
减:报告期期间基金总赎回份额	22,504,608.58
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	166,302,241.74

§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(%)	6.01

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	6.01	10,000,000.00	6.01	3年
基金管理人高级管理人员	228,962.98	0.14	228,962.98	0.14	3年
基金经理等人员	198,859.63	0.12	198,859.63	0.12	3年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,427,822.61	6.27	10,427,822.61	6.27	3年

§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。

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

2017年10月26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

2017年第三季度报告

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:2017年10月26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2017年10月23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2017年7月1日起至2017年9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
基金主代码	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	77,756,135.38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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	3,946,708.01
2.本期利润	2,731,093.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0286
4.期末基金资产净值	81,474,482.32
5.期末基金份额净值	1.0478

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。

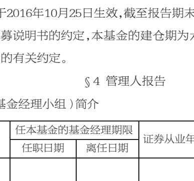
(2)本报告所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后的实际收益水平要低于所列数字。

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	2.64%	0.91%	2.24%	0.29%	0.40%	0.62%

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,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,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。

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,在政策的引导下,市场走出震荡向上的小幅上涨行情,因为较好地抓住了新能源车行业的变化,本基金在三季度有所收益。展望四季度,将密切关注欧美经济复苏的进程,关注国内的宏观经济走势及政策上的变化,积极参与政策鼓励的行业个股,同时为明年的操作贮备投资品种。

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1.0478元;本报告期基金份额净值增长率为2.64%,业绩比较基准收益率为2.24%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日以上基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	75,487,464.72	91.34
	其中:股票	75,487,464.72	91.34
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	5,226,180.98	6.32
8	其他资产	1,932,969.93	2.34
9	合计	82,646,615.63	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	3,526,840.21	4.33
C	制造业	54,291,673.69	66.64
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	6,270.76	0.01
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	8,979,522.75	11.02
J	金融业	6,454,216.42	7.92
K	房地产业	1,248,765.00	1.53
L	租赁和商务服务业	957,340.89	1.18
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	22,835.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	75,487,464.72	92.65

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	601318	中国平安	84,232	4,562,005.12	5.60
2	603986	兆易创新	32,328	4,211,045.28	5.17
3	300383	光环新网	200,000	2,788,000.00	3.42
4	600966	博汇纸业	376,900	2,724,987.00	3.34
5	000063	中兴通讯	95,661	2,707,206.30	3.32
6	000488	晨鸣纸业	125,961	2,470,095.21	3.03
7	600809	山西汾酒	44,741	2,462,992.05	3.02
8	300408	三环集团	100,000	2,459,000.00	3.02
9	000725	京东方A	550,000	2,420,000.00	2.97
10	600567	山鹰纸业	420,628	2,305,041.44	2.83

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。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

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权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期本基金未投资股指期货。

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

本报告期无任何公募基金投资国债期货。

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	256,742.06
2	应收证券清算款	1,671,006.96
3	应收股利	-
4	应收利息	3,230.55
5	应收申购款	1,990.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,932,969.93

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	114,405,438.85
报告期期间基金总申购份额	2,144,690.63
减:报告期期间基金总赎回份额	38,793,994.10
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	77,756,135.38

§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(%)	6.40

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	6.40	4,975,124.38	6.40	3年
基金管理人高级管理人员	1,931,683.70	2.48	1,931,683.70	2.48	3年
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	4,173,935.99	5.37	4,173,935.99	5.37	3年
其他	-	-	-	-	-
合计	11,080,744.07	14.25	11,080,744.07	14.25	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

2017年10月26日