

中科沃土沃瑞灵活配置混合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：交通银行股份有限公司

二〇一九年八月

【重要提示】

本基金根据 2018 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瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可[2018]590 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，由投资者自行承担。

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和债券型基金，低于股票型基金。

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)、股指期货、国债期货、权证、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、货币市场工具、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(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：股票占基金资产的比例为 0% - 95%；权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%；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。

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 2019 年 7 月 19 日，与有关财务数据截止日为 2019 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：程文卫

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 1.42 亿元

存续期限：持续经营

联系电话：020-37128628

联系人：古琳花

2、股权结构：

股东名称 持股比例

广东中科科创创业投资管理有限责任公司 49.711%

广东省粤科金融集团有限公司 14.085%

广东普瑞投资发展合伙企业(有限合伙) 4.577%

珠海横琴沃智投资合伙企业(有限合伙) 4.486%

珠海横琴沃富投资合伙企业(有限合伙) 4.486%

珠海横琴西拓投资合伙企业(有限合伙) 4.486%

珠海横琴沃泽投资合伙企业(有限合伙) 4.225%

珠海横琴沃信投资合伙企业(有限合伙) 3.873%

珠海横琴沃土创业投资有限公司 3.451%

珠海横琴沃海投资合伙企业(有限合伙) 3.451%

广东中广投资管理有限公司 3.169%

合计 100.000%

(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

胡冬辉女士，管理学博士，董事长。曾任湖南省机械化施工公司财务主管，中国华建审计事务所审计部经理，中国华星集团公司财务部经理，中国乐凯集团公司总会计师，中央汇金投资有限责任公司专职董事(人保集团派出董事)，中央汇金投资有限责任公司证券机构管理部、保险机构管理部副主任。现任中科沃土基金管理有限公司董事长。

朱为绎先生，中国注册会计师，会计学硕士，副董事长。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，广东中科科创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，中科沃土基金管理有限公司董事长。现任中科招商投资管理集团股份有限公司常务副总裁，广东中科科创创业投资管理有限责任公司副总裁，中科沃土基金管理有限公司副董事长，兼任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，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，副董事长。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，中科沃土基金管理有限公司总经理。现任中科沃土基金管理有限公司副董事长，广东普瑞投资发展合伙企业(有限合伙)执行事务合伙人，珠海横琴中科招商投资管理有限公司专家委员会副总裁。

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、金管科科长，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总经理。兼任广东省粤科科技小额贷款股份有限公司董事长，广东省粤科融资租赁有限公司董事长，广东省小额贷款协会协会会长。

甘雨女士，学士，董事。曾任广州农商银行番禺支行财务会计部副经理，广州正虹科技发展有限公司财务总监，现任广州融晟投资发展有限公司办公室主任，兼任珠海横琴西拓投资合伙企业(有限合伙)执行事务合伙人，广州凯豪投资咨询有限公司监事。

程文卫先生，管理学博士，博士后，董事、总经理、法定代表人。曾任南开大学军事教研室讲师，中国科技国际信托投资公司证券投资经理、研究所所长，宏源证券股份有限公司研究所所长，渤海证券股份有限公司研究所所长，国开证券有限责任公司研究中心总经理，亿利资源集团有限公司金融集团副总裁、上市公司常务副总兼董秘，信达澳银基金管理有限公司副总经理、信达新兴财富资产管理有限公司总经理，现任中科沃土基金管理有限公司董事、总经理、法定代表人。

张志坚先生，金融硕士，独立董事。曾任北京市国家安全局科员、北京国际信托投资公司证券部客户经理、中国投资银行交易员，国家开发银行交易员、副处长、处长，国开证券有限责任公司固定收益总部总经理(正处级)、副总裁(副局级)。现任深圳市亚信鑫理资产管理有限公司董事长。

刘强先生，金融学硕士，独立董事。曾任中国进出口银行总行党委秘书、总行办公室主任

科员、副处长、中国加拿大自然资源投资合作基金 MEC 顾问公司首席运营官兼董事会秘书。

朱桂龙先生，管理学博士，独立董事。曾任合肥工业大学预测与发展研究所助理研究员、副研究员、研究员，华南理工大学工商管理学院副院长、院长、教授、博士生导师。现任华南理工大学工商管理学院教授、博士生导师，获国务院“政府特殊津贴”。兼任江西九丰能源股份有限公司独立董事，广州银行股份有限公司独立董事，中国南玻股份有限公司(上市公司)独立董事，广州金域医学股份有限公司(上市公司)独立董事，广州广电运通股份有限公司(上市公司)独立董事，广州银行股份有限公司独立董事。

(2)监事会成员

胡玮先生，工商管理和信息化技术学士，监事会主席。曾任广东中科科创创业投资管理有限责任公司总经理助理，现任广东中广投资管理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。

袁成龙先生，工学学士，信息技术部副总经理、职工代表监事。曾任明高资讯科技(广州)有限公司软件开发部软件工程师、明基逐鹿(苏州)软件有限公司软件实施部软件实施顾问、金鹰基金管理有限公司运作保障部系统管理员、富荣基金管理有限公司信息技术部副总监。2016年4月入司，现任信息技术部副总经理、职工代表监事。

李文女士，金融学学士，综合管理部总经理助理，职工代表监事。曾任金鹰基金管理有限公司市场部销售经理、投研部投研秘书，现任综合管理部总经理助理、职工代表监事。

(3)高级管理人员

胡冬辉女士，管理学博士，董事长，简历同上。

程文卫先生，管理学博士，总经理、法定代表人、董事，简历同上。

曹萍女士，经济学硕士，律师，督察长、合规负责人兼监察风控部总经理。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、合规负责人兼监察风控部总经理。

陶安虎先生，哲学硕士，副总经理。曾任汤森路透北方区经理，长安基金管理有限公司拟任总经理助理、市场副总监、华北营销中心总经理，现任中科沃土基金管理有限公司副总经理。

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

黄艺明先生，经济学硕士，权益投资部副总经理、基金经理。曾任广东粤财信托有限公司研究员，金鹰基金管理有限公司基金经理助理、研究总监助理，七匹狼控股集团有限公司投资经理助理，广东富业盛德资产管理有限公司投资部执行董事兼总经理、投资经理，中科沃土基金管理有限公司专户投资部副总经理、投资经理，现任权益投资部副总经理、中科沃土沃祥债券型发起式证券投资基金和中科沃土沃瑞灵活配置混合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。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，现任中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金和中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

3、投资决策委员会成员

本公司投资决策委员会成员包括：程文卫先生、乐瑞祺先生、马洪娟女士、邱阳女士和徐力先生。

程文卫先生，管理学博士，董事、总经理，简历同上。

乐瑞祺先生，经济学硕士，总经理助理兼权益投资部总经理、基金经理，曾任衡泰软件定量研究部定量分析师，博时基金管理有限公司基金经理助理，民生加银基金管理有限公司投资部总监、基金经理，第一创业证券股份有限公司资产管理部投资总监。现任中科沃土基金管理有限公司总经理助理兼权益投资部总经理、中科沃土沃安中短期利率债债券型证券投资基金基金经理、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基金经理和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。

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、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安中短期利率债债券型证券投资基金基金经理。

邱阳女士，经济学学士，专户投资部总经理。曾任北京金美林投资顾问有限公司研究员，中国国际金融有限公司财富管理部新业务协调，亿利资源集团金融事业部业务总监，信达新兴财富(北京)资产管理有限公司投资总监，现任中科沃土基金管理有限公司专户投资部总经理。

徐力先生，MBA，工学硕士，专户投资部专户投资总监、投资经理，兼任研究部总经理。曾任方正证券研究所所长助理、TMT 组长，中信建投研究所通信行业 VP，海通证券研究所通信行业首席分析师，东吴证券研究所通信行业首席分析师，赛伯乐投资高级合伙人，江信基金研究总监，现任中科沃土基金管理有限公司研究部总经理。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

基金托管人基本情况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司(简称：交通银行)

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

法定代表人：彭纯

住 所：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：中国(上海)长宁区仙霞路 18 号

邮政编码：200336

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.63 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

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：程文卫

联系人：古琳花

联系电话：020-37128628

网址：www.richlandasm.com.cn

2、非直销销售机构

(1)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

联系人：王青

电话：021-58781234

客服电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(2)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：021-20315125

网址：www.zts.com.cn

(3)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

(4)平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层

办公地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层

法定代表人：何之江

联系人：王阳

电话：021-38632136

客服电话：95511-8

传真：0755-82435367

网址：<http://stock.pingan.com>

(5)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

(6)中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

办公地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

法定代表人：林炳城

联系人：罗艺琳

电话：0755-82943755

客服电话：95329

传真：0755-82960582

网址：www.zszq.com

(7)西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：陈宏

联系人：付佳

电话：021-23586603

客服电话：95357

传真：021-23586860

网站：<http://www.18.cn>

(8)深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

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：徐丽平

电话：0755-33227950

客服电话：400-678-8887

传真：0755-33227951

网址：www.zlfund.cn

(9)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：95021/400-1818-188

传真：021-64385308

网址：www.1234567.com.cn/

(10)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：王锋

联系人：赵耶

电话：18551602256

客服电话：95177

传真：025-66996699-884131

网址: www.snjijin.com

(11)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: 北京市大兴区科创十一街京东集团总部 15 层

法定代表人: 江卉

联系人: 韩锦星

电话: 13810801527

客服电话: 95118

传真: 58956600

网址: fund.jd.com

(12)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: 赵媛媛

电话: 18501377331

客服电话: 010-62675369

传真: 010-62675369

网址: <https://fund.sina.com.cn/fund/web/index>

(13)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: 王诗珩

电话: 13482256958

客服电话: 400-700-9665

传真: 021-68596916

网址: www.ehowbuy.com

(14)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

(15)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: 孙琦

电话: 021-50810673

客服电话: 400-711-8718

传真: 021-50810687

网址: www.wacaijijin.com

(16)万家财富基金销售(天津)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 5 层

法定代表人: 李修辞

联系人: 王芳芳

电话: 010-59013842

客服电话: 010-59013842

传真: 010-59013828

网址: www.wanjiawealth.com

(17)上海基煜基金销售有限公司

注册地址: 上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发展区)

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人: 王翔

联系人: 吴鸿飞

电话: 021-65370077-268

传真: 021-55085991

客服电话: 400-820-5369

网址: www.jiyufund.com.cn

(18)泰诚财富基金销售(大连)有限公司

注册地址: 辽宁省大连市沙河口区星海中路 3 号

办公地址: 辽宁省大连市沙河口区星海中路 3 号

法定代表人: 李春光

联系人: 徐江

电话: 0411-88891212

客服电话: 400-0411-001

传真: 0411-84396536

网址: www.haojiyoujijin.com

(19)深圳前海财厚基金销售有限公司

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: 深圳市南山区深圳湾科技生态园三区 11 栋 A 座 3608 室

法定代表人: 杨艳平

联系人: 叶见云

电话: 15999517027

客服电话: 4001286800

传真: 0755-26640652

网站: www.caiho.cn

(20)北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址: 北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址: 北京市朝阳区建国门外大街 19 号 A 座 1505 室

法定代表人: 张冠宇

联系人：王丽敏

电话：010-85932810

客服电话：400-819-9868

网站：<https://www.tdyhfund.com>

(21)上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 18 层

法定代表人：李兴春

联系人：叶雪飞

电话：021-60195121

客服电话：95733

传真：021-61101630

网站：www.leadfund.com.cn

(22)诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼

法定代表人：汪静波

联系人：李娟

电话：021-80358236

客服电话：4008-215-399

传真：021-80358749

网站：www.noah-fund.com

(23)阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层

法定代表人：李科

电话：010-85632771

传真：010-85632773

联系人：王超

客服热线：95510

网站：<http://fund.sinosig.com/>

(二)基金注册登记机构

名称：中科沃土基金管理有限公司

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：程文卫

联系电话：020-37128624

传真：020-23388994

联系人：高寅初

(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、8、9 层

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：瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)

主要经营场所：北京市海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层

执行事务合伙人：杨剑涛、顾仁荣

电话：(010)-88095588

传真：(010)-88091190

经办注册会计师：闫靖

联系人：闫靖

电话：18038097687

四、基金的名称

中科沃土沃瑞灵活配置混合型发起式证券投资基金

五、基金的类型

混合型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金通过系统化的方法精选环境、财务可持续的上市公司，通过精选个股和风险控制，力争为投资者创造超越业绩比较基准的回报。

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)、股指期货、国债期货、权证、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、货币市场工具、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(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：股票占基金资产的比例为 0% - 95%；权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%；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。

八、基金的投资策略

(一)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。

(二)股票投资策略

本基金基于环境、财务可持续的投资理念，通过定性和定量的方法，筛选出在环境、财务可持续性表现突出的股票，进行重点投资。

1、环境、财务可持续的投资理念内涵

本基金认为投资于环境、财务可持续的优秀企业，在获得良好回报的同时，也能维护或改善生态环境，推动整个社会的可持续发展。

环境、财务可持续的投资理念内涵包含以下两个方面的内容：

(1)环境可持续性

环境可持续的公司有以下特征之一：

1)公司提供相关产品和服务用来满足包括但不限于以下解决环境挑战的需求。

i.可再生能源以及能源效率技术的需求；

ii.由于气候变化和污染对全球水供给的威胁，从而对洁净水全球性的需求增加；

iii.由于商品稀缺问题，相应对资源效率和储存的需求；

iv.对健康、自然和有机食品以及消费品的需求；

v.对满足新的环境管制专业化服务日益增加的需求。

2)公司进行清洁、高效和对环境负责的商业活动，以及尽力降低对环境的影响。

一个公司对环境可持续性的执行水平对公司的财务表现有重大的影响。环境可持续性的商业活动可以形成成本优势、质量以及提升企业盈利。另外，良好的环境行为记录能够帮助公司建立良好的品牌，提升消费者和员工的忠诚度。

最后，公司对环境可持续性的执行也降低了一些意外风险，比如诉讼，监管处罚，以及其他对股东价值造成伤害的其他违法违规行为。

(2)财务可持续性增长

长期可持续的财务增长是企业各方面核心竞争优势的综合体现。本基金认为，技术优势和技术创新、商业模式和市场创新、资源禀赋、公司治理等四方面因素相互联系、相互影响，共同形成了企业财务可持续性增长的核心动力。

2、股票选择

本基金通过定量和定性相结合的方法定期分析和评估上市公司环境、财务可持续性，从而确定本基金重点投资的股票，并根据定期分析和评估结果动态调整。

(1)定量分析

本基金运用静态与动态数据相结合的方式考察股票的成长质量和可持续性，选择那些被低估且有稳定持续增长潜力的股票。

在考察个股的估值水平时，本基金考察企业贴现现金流以及内在价值贴现，结合市盈率(PE)、市净率(PB)、市销率(PS)等指标考察股票的价值是否被低估。

本基金采用年复合营业收入增长率、盈利增长率、息税前利润增长率、净资产收益率、以及现金流量增长率等指标综合考察上市公司的成长性。

在盈利水平方面，本基金对盈利速度和盈利质量并重，而不单纯追求上市公司盈利的速度。

本基金重点考察主营业务收入、经营现金流、盈利波动程度三个关键指标，以衡量具有高质量持续增长的公司。具体而言，营业收入增长率/应收账款增长率(GAR/GSales)、核心营业利润与净资产比例(CE/Equity)、经营性现金流与核心营业利润比例(CFFO/CE)等核心指标都将被运用到盈利水平的度量上。

(2)定性分析

本基金认为，企业的持续成长性需要从环境可持续性、资源禀赋、商业模式、技术创新与技术优势、公司治理等方面定性分析评估。本基金对企业是否具有可持续性有如下标准：

1)环境是否具有可持续性：以牺牲环境为代价谋取利益的企业不具备可持续性发展的前提。本基金主要考察企业的环境保护及社会责任实际履行情况。这不但要求企业要遵守国家及所在地方政府的环境政策和条例，具有专门为保护环境及提高资源利用效率的方案及措施，同时要求企业满足社会准则和规范，具有回报社会的责任意识。本基金将关注在该方面表现突出的企业。

2)企业是否具有资源禀赋：企业的资源禀赋是指由于企业所处的地理位置、气候条件、自然资源蕴藏等方面的不同所导致的企业专门从事某项业务的天然优势。本基金认为，如果企业没有所处行业所需的核心资源优势，企业发展就不具备可持续性，将不予投资。

3)企业是否具有技术优势和技术创新：技术优势和技术创新是企业实现科学技术成果向现实生产力转化的根本途径，也是形成企业可持续发展所需核心竞争力的关键和源泉。具体地，本基金需要考察公司的主营产品是否符合产业升级趋势；企业是否采取了不易被模仿或专利保护的技术优势，确保企业在较长一段时间内独享技术领先带来的超额利润率；企业是否制定并有效执行了鼓励技术创新的激励机制。本基金将重点关注在上述方面表现突出的企业。

4)企业的商业模式和市场创新能力：商业模式和市场创新能力是指企业通过不断创造新盈利模式和开拓新市场，将创新成果转化为商业价值和企业实力，并决定和影响着企业创新活动的规模、内容及发展方向。本基金主要考察公司管理层是否具有不断创造全新商业模式和市场创新的理念和能力，并重点关注表现优异的企业。

5)企业是否具有好的公司治理：企业内部管理涵盖了多个方面，本基金的评估范围包括但不限于：企业董事会是否具有独立性；公司是否具有健全、可操作性强的、责权利明确的公司管理治理规则，能保证内控的贯彻实施；是否具有完善的风险管理和内部人监督体系；是否注重培养健康、有道德的公司文化、保障员工的利益、注重员工发展；是否实施股权激励制度；是否有完善的信息披露制度、保证公司的透明度。对那些管理结构较差，委托-代理制度混乱、以及在大股东操纵、内部人控制、担保欺骗、行受贿等方面存在可疑或违法行为的公司，本基金将不予投资。

(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。

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。

(四)资产支持证券投资策略

本基金将通过分析宏观经济、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×60%+中债综合全价(总值)指数收益率×40%

十、基金的风险收益特征

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,具有中高等风险/收益的特征。

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。

基金托管人交通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 2019 年 4 月 1 日至 2019 年 6 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	10,638,864.00	85.51
---	------	---------------	-------

其中: 股票	10,638,864.00	85.51
--------	---------------	-------

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	300,000.00	2.41
---	----------	------------	------

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	1,458,073.41	11.72
---	--------------	--------------	-------

8	其他资产	44,252.77	0.36
---	------	-----------	------

9	合计	12,441,190.18	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	3,550.00	0.03
---	-----	----------	------

C	制造业	3,686,142.00	30.77
---	-----	--------------	-------

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 3,246,221.00 27.09

J 金融业 2,674,961.00 22.33

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 494,340.00 4.13

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 533,650.00 4.45

S 综合 --

合计 10,638,864.00 88.79

(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	601688	华泰证券	27,000	602,640.00	5.03
2	603737	三棵树	13,700	596,498.00	4.98
3	300413	芒果超媒	13,000	533,650.00	4.45
4	002677	浙江美大	40,000	526,400.00	4.39
5	002398	建研集团	77,000	494,340.00	4.13
6	002405	四维图新	30,000	483,000.00	4.03
7	600030	中信证券	20,000	476,200.00	3.97
8	300253	卫宁健康	33,300	472,194.00	3.94
9	600588	用友网络	17,000	456,960.00	3.81
10	300365	恒华科技	27,700	449,017.00	3.75

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、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。

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。

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。

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。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本报告期末本基金未持有国债期货。

(2)本报告期内本基金未进行国债期货交易。

10、投资组合报告附注

(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。

(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。

(3)其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 43,735.88

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 416.89

5 应收申购款 100.00

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 44,252.77

(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)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。

十二、基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、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，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。

投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。本基金合同生效日为 2019 年 1 月 14 日，基金合同生效以来(截至 2019 年 6 月 30 日)的投资业绩及同期业绩比较基准的比较如下表所示：

(一)(1)中科沃土沃瑞混合发起 A 类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

基金合同生效至 2019 年 6 月 30 日 4.47% 0.87% 14.03% 0.94% -9.56% -0.07%

(2)中科沃土沃瑞混合发起 C 类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

基金合同生效至 2019 年 6 月 30 日 4.09% 0.86% 14.03% 0.94% -9.94% -0.08%

(二)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

十三、费用概览

(一)与基金运作相关的费用

1、基金费用的种类

- (1)基金管理人的管理费；
- (2)基金托管人的托管费；
- (3)C类基金份额的销售服务费；
- (4)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- (5)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- (6)基金份额持有人大会费用；
- (7)基金的证券、期货交易费用；
- (8)基金的银行汇划费用；
- (9)基金相关账户的开户费用及账户维护费用；
- (10)按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

(2)基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初三个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

(3)C类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.80%的年费率计提。C 类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人自动于次月首日起三个工作日内从基金财产中一次性支付至注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。销售服务费主要用于本基金 C 类基金份额持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。上述“一、基金费用的种类中第 4—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用

实际支出金额列入当期费用，由基金托管人根据基金管理人指令并参照行业惯例从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况，履行适当程序后，调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率等相关费率。

基金管理人必须于新的费率实施日前在至少一种指定媒介上公告。

5、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费

(1)申购费率

本基金 A 类基金份额在申购时收取基金申购费用。本基金 C 类基金份额不收取申购费用。

本基金 A 类和 C 类基金份额的申购费率见下表：

申购金额(M) A 类份额申购费率 C 类份额申购费率

M<100 万元 1.50% 0%

100 万元≤M<200 万元 1.00%

200 万元≤M<500 万元 0.80%

M≥500 万元 1000 元/笔

(2)申购费的收取方式和用途

投资者如果有多笔 A 类基金份额的申购，适用费率按单笔分别计算。本基金 A 类基金份额的申购费用由投资者承担，不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

(3)申购份额的计算方式

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后，以申请当日该类基金份额净值为基准计算。

A 类申购份额

申购本基金 A 类份额的申购费用采用前端收费模式(即申购基金时缴纳申购费)，投资者的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购 A 类份额的计算方式如下：

1)若适用比例费率时，A 类申购份额的计算方法如下：

净申购金额=申购金额 / (1+申购费率)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额 / 申购当日 A 类基金份额净值

2)若适用固定费用时，A 类申购份额的计算方法如下：

净申购金额=申购金额-固定费用

申购费用=固定费用

申购份额=净申购金额 / 申购当日 A 类基金份额净值

上述计算结果均保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者投资 5 万元申购 A 类份额，对应费率为 1.5%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0160 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率) = 50,000 / (1 + 1.5%) = 49,261.08 元

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额 = 50,000 - 49,261.08 = 738.92 元

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类基金份额净值 = 49,261.08 / 1.0160 = 48,485.32 份

即：投资者投资 5 万元申购基金，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0160 元，则可得到 48,485.32 份 A 类基金份额。

C 类申购份额

C 类申购份额的计算方法如下：

申购份额 = 申购金额 / 申购当日 C 类基金份额净值

上述计算结果均保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者投资 5 万元申购 C 类份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0160 元，则其可得到的申购份额为：

申购份额 = 申购金额 / 申购当日 C 类基金份额净值 = 50,000 / 1.0160 = 49,212.60 份

即：投资者投资 5 万元申购基金，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0160 元，则可得到 49,212.60 份 C 类基金份额。

2、赎回费

(1) 赎回费率

本基金两类份额的赎回费率详见下表：

A 类持有基金份额期限(Y) 赎回费率(%)

Y < 7 日 1.50%

7 日 ≤ Y < 30 日 0.75%

30 日 ≤ Y < 1 年 0.50%

1 年 ≤ Y < 2 年 0.25%

Y ≥ 2 年 0.00%

C 类持有基金份额期限(D) 赎回费率(%)

D < 7 日 1.50%

7 日 ≤ D < 30 日 0.50%

D ≥ 30 日 0.00%

(2) 赎回费的收取方式和用途

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担。对持续持有期少于 30 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于 30 日但持续持有期少于 3 个月的 A 类份额投资者收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的 A 类份额投资者收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期不少于 6 个月的 A 类份额投资者，将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

(3)赎回金额的计算方式:

某一类别基金份额赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日该类基金份额净值的金额,净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额。本基金 A 类基金份额与 C 类基金份额设置不同的赎回费率。

赎回金额=赎回份数×T 日该类基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额-赎回费用

计算结果均按照四舍五入方法,保留小数点后两位,由此误差产生的收益或损失归基金财产承担。

例:某投资者赎回本基金 A 类基金份额 1 万份,持有时间为一年,假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.1200 元,则其可得到的赎回金额为:

赎回金额=10,000×1.1200=11,200.00 元

赎回费用=11,200×0.25%=28.00 元

净赎回金额=11,200-28.00=11,172.00 元

即:投资者赎回 A 类基金份额 1 万份,持有期限为一年,假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.1200 元,则其可得到的赎回金额为 11,172.00 元。

例:某投资者持有本基金 C 类基金份额不满 30 天,在 T 日赎回其持有的 C 类基金份额 10,000 份,T 日的 C 类基金份额净值为 1.2000 元,则投资者获得的赎回金额计算如下:

赎回总金额=10,000×1.2000=12,000.00 元

赎回费用=12,000×0.5%=60.00 元

净赎回金额=12,000-60.00=11,940.00 元

即投资者持有本基金 C 类基金份额不满 30 天,在 T 日赎回其持有的 C 类基金份额 10,000.00 份,T 日的 C 类基金份额净值为 1.2000 元,则其可得到赎回金额为 11,940.00 元。

3、转换费率

基金转换费由基金份额持有人承担,由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成,其中赎回费用按照基金合同、更新的招募说明书及最新的相关公告约定的比例归入基金财产,其余部分用于支付注册登记费等相关手续费,具体实施办法和转换费率详见相关公告。转换费用以人民币元为单位,计算结果按照四舍五入方法,保留小数点后两位。

4、基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整上述费率。上述费率如发生变更,基金管理人应按照《信息披露办法》或其他相关规定于新的费率实施前在至少一种指定媒体公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划,针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以适当调低基金销售费率。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及《中科沃土转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金合同》,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对 2018 年 9 月 25 日刊登的本基金的招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

- 1.在“第三部分基金管理人”,根据最新资料更新了主要人员情况信息。
- 2.在“第四部分基金托管人”部分,根据最新资料更新了托管人的相关信息。
- 3.在“第五部分相关服务机构”部分,根据相关公告补充了基金份额销售机构的信息。

- 4.将“第六部分基金份额的发售”改为“第六部分基金的募集”，概述了基金的募集情况。
- 5.将“第七部分基金合同的生效”改为“第七部分基金合同的生效与存续”，概述了基金合同生效的相关情况，并根据相关公告更新了部分内容。
- 6.增加了“第九部分基金的转换”部分，并根据相关公告的内容进行了更新。
- 7.在“第十部分基金的投资”部分，根据定期报告补充了本基金 2019 年第 2 季度投资组合报告的内容。
- 8.增加了“第十一部分基金的业绩”部分，根据定期报告补充了自基金合同生效以来的投资业绩数据，并相应调整其他章节的序号。
- 9.增加了“第二十四部分其他应披露事项”部分，根据相关公告补充了部分内容。

中科沃土基金管理有限公司

2019 年 8 月 9 日