

红土改革创新红利灵活配置混合型发起式 证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：红土创新基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告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及其更新。

本报告期自 2016 年 1 月 26 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 审计报告	13
6.1 审计报告基本信息.....	13
6.2 审计报告的基本内容.....	13
§7 年度财务报表	14
7.1 资产负债表.....	14
7.2 利润表.....	15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
7.4 报表附注.....	17
§8 投资组合报告	35
8.1 期末基金资产组合情况.....	35
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
8.6 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.....	53
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	53

8.8	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贵金属投资明细	53
8.9	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	53
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
8.12	投资组合报告附注	54
§9	基金份额持有人信息	54
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	55
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	55
§10	开放式基金份额变动	55
§11	重大事件揭示	55
11.1	基金份额持有人大会决议	55
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	56
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
11.4	基金投资策略的改变	56
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	56
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
11.8	其他重大事件	58
§12	影响投资者决策的其他重要信息	58
§13	备查文件目录	58
13.1	备查文件目录	58
13.2	存放地点	59
13.3	查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	红土创新改革红利混合
基金主代码	002250
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 26 日
基金管理人	红土创新基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	32,469,935.77 份

2.2 基金产品说明

投资目标	我国全面深化改革将对经济和资本市场产生深远影响，改革红利的释放有望带来超额投资收益。本基金主要投资受益于全面深化改革的行业股票，包括受益于国企改革、资源要素价格改革、人口制度、户籍制度、土地制度、医药卫生体制、生态文明制度、国防等领域改革的相关行业上市公司，追求超越业绩比较基准的长期回报。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势等因素对各个行业及上市公司的影响以及核心股票资产的估值水平，综合分析证券市场的走势，主动判断市场时机，通过稳健的资产配置，合理确定基金资产在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金是灵活配置混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		红土创新基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张洗尘	方韡
	联系电话	0755-33011878	4006800000
	电子邮箱	zhangxc@htcxfund.com	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		0755-33011866	95558

传真	0755-33011855	010-85230024
邮政编码	518048	100010
法定代表人	邵钢	李庆萍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.htcxfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
注册登记机构	红土创新基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	3,454,265.98
本期利润	3,040,700.10
加权平均基金份额本期利润	0.0546
本期加权平均净值利润率	5.35%
本期基金份额净值增长率	4.71%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末
期末可供分配利润	848,463.25
期末可供分配基金份额利润	0.0261
期末基金资产净值	33,318,399.02
期末基金份额净值	1.026
3.1.3 累计期末指标	2016 年末
基金份额累计净值增长率	4.71%

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. 期末可供分配利润, 采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额, 不是当期发生数)。

3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4. 本基金合同生效日为 2016 年 01 月 26 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。

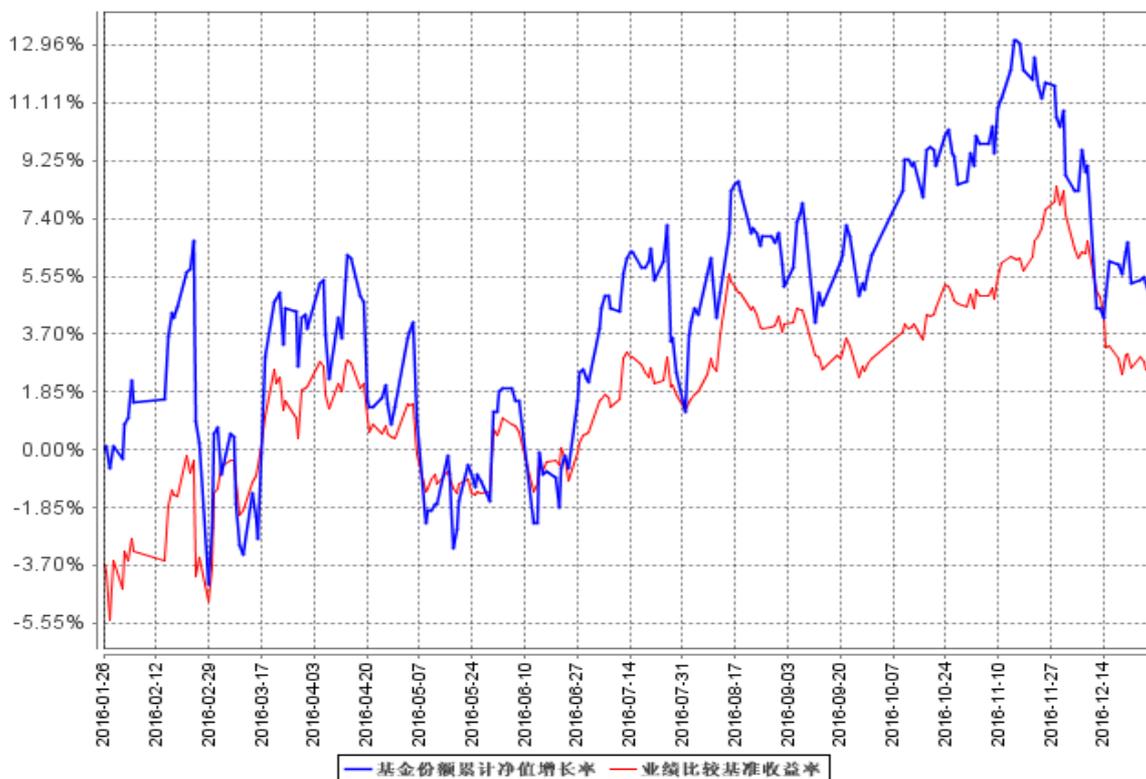
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-1.44%	0.87%	-0.08%	0.45%	-1.36%	0.42%
过去六个月	2.40%	0.92%	2.32%	0.47%	0.08%	0.45%
自基金合同生效起至今	4.71%	1.19%	2.86%	0.70%	1.85%	0.49%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

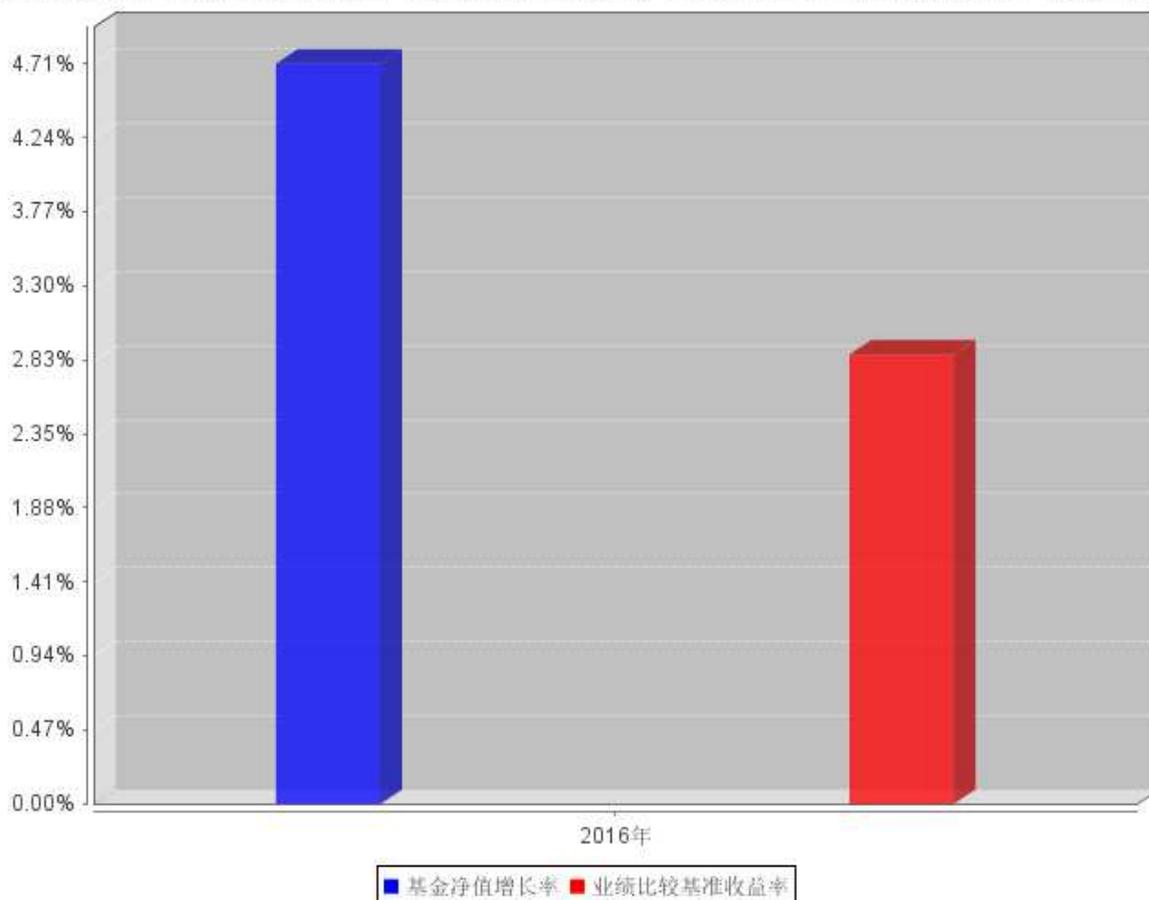


注：1. 基金合同生效日至本报告期末不满一年。

2. 本基金建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2016	0.2000	1,507,337.02	35,482.29	1,542,819.31	
合计	0.2000	1,507,337.02	35,482.29	1,542,819.31	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

红土创新基金管理有限公司（以下简称“红土创新基金”）经中国证监会证监许可【2014】562

号文批准设立。红土创新基金总部位于深圳，注册资本金为 1 亿元人民币，是国内首家创投系公募基金管理公司。公司股东为深圳市创新投资集团有限公司，持有股权 100%。

红土创新基金在公募基金业务的优良传承基础上，借力股东对创业投资行业的深入理解，外加国内独创的博士后工作站研究支持，充分利用一级市场优势向二级市场延伸，将红土创新基金打造成为以权益类投资为特色的创新型资产管理机构。截至 2016 年 12 月 31 日，红土创新基金共管理三只开放式基金，资产管理规模 3.6 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丁硕	基金经理	2016 年 1 月 26 日	-	12	清华大学工商管理硕士。先后在招商证券股份有限公司、兴凯投资公司工作；历任阳光保险集团交易主管、研究员、投资经理，东莞证券资产管理分公司权益投资负责人、投资经理。现任红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，

并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律、法规及基金合同的规定。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年市场经历了较大的波动，开年熔断，市场在短期经历了快速下跌，但从 2 月开始市场整体就进入到一个震荡上行的趋势中。本产品成立在市场底部，但由于正处于建仓期，因此未能够在第一时间市场最低的位置把仓位加到较高的水平，但基于当时对市场乐观的判断，在随后的时间里始终保持了相对较高的仓位。全年看市场在一个相对不大的区间震荡，这期间我们经历了人民币大幅贬值、通胀预期重启、大宗商品价格反弹、美联储加息反复、房地产销售回暖、一二线城市房价暴涨、国内经济短期企稳、权威人士对经济运行的讲话、美国大选、英国脱欧，在近年来最复杂的市场环境下市场重心逐渐上移，但其中阶段性的有表现明显突出的板块，比如白酒、新能源汽车、一带一路等等，本产品主要关注的国企改革主题在 2016 实际上未能表现出明显的超额收益。但我们仍然坚定看好改革受益的相关公司在 2017 年的机会。基于一直以来的逻辑框架，中国经济面临巨大挑战，无论是 PPP 还是债务置换都仅仅是努力维持，改革还是必须推进才有机会带来新的增长动力。近期我们看到国务院、国资委等相关部门对国企改革不断推进的表述，自下而上的改革也一直在进行，6+1 的混改第一批试点，以及即将出台的混改第二批试点企业名单，我们有理由相信，2017 年将是改革快速推进的元年。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日为止，本基金的单位净值为 1.026 元，累计单位净值为 1.046 元。报

报告期内本基金净值增长率为 4.71%，同期业绩基准增长率为 2.86%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，我们认为市场将以震荡为主，操作上保持谨慎乐观的态度。谨慎是因为通胀预期有所升温、货币政策收紧，金融部门去杠杆、降风险的工作仍要继续，地产销售下滑对经济的影响需要观察，估值整体仍偏高，美国 2-3 次加息、人民币贬值压力仍在；乐观是因为供给侧改革带来的商品价格上涨使得企业盈利会继续向好，19 大召开提供一个稳定的大环境，大类资产比较来看股票是较好选择。方向上，改革相关主题依然是我们配置的重点，我们依然看好混改试点企业，上海、广东、山东等地方国企改革，军工科研院所改制，教育体育体制改革，电改、盐改等方向；另外还关注滞涨相关行业包括有色、农业、化工；调整较充分的成长股龙头，例如传媒、计算机等。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。

报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值工作组，由投研部门、运营部门及监察稽核部门的相关人员组成。估值工作组负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理，特别是应当保证估值未被歪曲以免对基金份额持有人产生不利影响。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的基金管理人于 2016 年 3 月 3 日发布《红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金分红公告》，收益分配基准日为 2016 年 2 月 24 日，每 10 份基金份额派发红利 0.200 元。符合基金合同对收益分配的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，自本基金合同生效之日起至报告期末本基金合同生效未满三年，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》规定，基金管理人不对本基金持有人数及基金资产净值进行监控。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2016 年度基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，红土创新基金管理有限公司在红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，红土创新基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 20369 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金 全体基金份额持有人:
引言段	我们审计了后附的红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“红土创新改革红利混合型发起式基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是红土创新改革红利混合型发起式基金的基金管理人红土创新基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p>
审计意见段	我们认为,上述红土创新改革红利混合型发起式基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了红土创新改革红利混合型发

	起式基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 1 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	薛竞	曹阳
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国. 上海市	
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	5,514,636.99
结算备付金		479,608.09
存出保证金		92,413.38
交易性金融资产	7.4.7.2	24,897,922.98
其中：股票投资		24,897,922.98
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	3,000,000.00
应收证券清算款		394,541.98
应收利息	7.4.7.5	850.93
应收股利		-
应收申购款		689.65
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		34,380,664.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-

衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		718,646.66
应付管理人报酬		45,787.85
应付托管费		7,631.32
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	137,495.96
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	152,703.19
负债合计		1,062,264.98
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	32,469,935.77
未分配利润	7.4.7.10	848,463.25
所有者权益合计		33,318,399.02
负债和所有者权益总计		34,380,664.00

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.026 元，基金份额总额 32,469,935.77 份。

7.2 利润表

会计主体：红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		6,041,475.24
1. 利息收入		204,021.47
其中：存款利息收入	7.4.7.11	50,500.30
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		153,521.17
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,992,441.02
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,717,417.27
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-

股利收益	7.4.7.16	275,023.75
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-413,565.88
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	258,578.63
减：二、费用		3,000,775.14
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	799,564.15
2. 托管费	7.4.10.2.2	133,260.68
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,906,592.71
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	161,357.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,040,700.10
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,040,700.10

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	109,482,592.39	-	109,482,592.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,040,700.10	3,040,700.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-77,012,656.62	-649,417.54	-77,662,074.16
其中：1. 基金申购款	6,395,767.97	69,784.06	6,465,552.03
2. 基金赎回款	-83,408,424.59	-719,201.60	-84,127,626.19
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”	-	-1,542,819.31	-1,542,819.31

号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	32,469,935.77	848,463.25	33,318,399.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____	_____	_____
杨兵	范大鹏	张祥金
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2778号《关于准予红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由红土创新基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币109,451,740.60元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第093号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2016年1月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为109,482,592.39份基金份额,其中认购资金利息折合30,851.79份基金份额。本基金的基金管理人为红土创新基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购等)、货币市场工具、银行存款、权证、股指期货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)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的0%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当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%;权证、股指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。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人红土创新基金管理有限公司于2017年3月28日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 01 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利

润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行股票有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定

期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供，本基金本报告期内没有持有银行间同业市场交易的债券品种。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按

50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	5,514,636.99
合计：	5,514,636.99

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	25,311,488.86	24,897,922.98	-413,565.88
合计	25,311,488.86	24,897,922.98	-413,565.88

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	3,000,000.00	-
合计	3,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应收活期存款利息	507.79
应收结算备付金利息	237.38
应收买入返售证券利息	60.00
其他	45.76
合计	850.93

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	137,495.96
合计	137,495.96

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	0.00
应付赎回费	2,703.19
预提信息披露费用	90,000.00
预提审计费用	60,000.00
合计	152,703.19

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	109,482,592.39	109,482,592.39
本期申购	6,395,767.97	6,395,767.97
本期赎回（以“-”号填列）	-83,408,424.59	-83,408,424.59
本期末	32,469,935.77	32,469,935.77

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	3,454,265.98	-413,565.88	3,040,700.10
本期基金份额交易产生的变动数	-939,802.43	290,384.89	-649,417.54
其中：基金申购款	-47,912.31	117,696.37	69,784.06
基金赎回款	-891,890.12	172,688.52	-719,201.60
本期已分配利润	-1,542,819.31	-	-1,542,819.31
本期末	971,644.24	-123,180.99	848,463.25

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日
活期存款利息收入	23,544.20
结算备付金利息收入	24,786.18
其他	2,169.92
合计	50,500.30

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出股票成交总额	716,104,668.37
减：卖出股票成本总额	710,387,251.10
买卖股票差价收入	5,717,417.27

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	275,023.75
合计	275,023.75

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年1月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-413,565.88
——股票投资	-413,565.88
合计	-413,565.88

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日
基金赎回费收入	258,578.63
合计	258,578.63

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,906,592.71
合计	1,906,592.71

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00
信息披露费	90,000.00
银行汇划费	10,957.60
其他	400.00
合计	161,357.60

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
红土创新基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	基金托管人、基金销售机构

深圳市创新投资集团有限公司(“深创投”)	基金管理人的控股股东
----------------------	------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1 关联方报酬

7.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	799,564.15
其中：支付销售机构的客户维护费	242,268.85

注：支付基金管理人红土创新基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

7.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	133,260.68

注：支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.1.3 销售服务费

无。

7.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2016年1月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日
基金合同生效日持有的基金份额	10,004,400.00
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	10,004,400.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	30.81%

7.4.10.3.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

7.4.10.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2016年1月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行	5,514,636.99	23,544.20

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.6 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	-	2016年3月7日	2016年3月7日	0.2000	1,507,337.02	35,482.29	1,542,819.31	

合计	-	-	0.2000	1,507,337.02	35,482.29	1,542,819.31	
----	---	---	--------	--------------	-----------	--------------	--

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发-增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金截至2016年12月31日止无因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险监控工作，督察长负责组织指导监察稽核工作。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中信银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

至 2016 年 12 月 31 日，本基金未进行交易性债券投资。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末进行债券投资。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末进行债券投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，均能根据本基金的基金管理人的投资意图以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融资产和金融负债的合同约定到期日均为一个月以内。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,514,636.99	-	-	-	5,514,636.99
结算备付金	479,608.09	-	-	-	479,608.09
存出保证金	92,413.38	-	-	-	92,413.38
交易性金融资产	-	-	-	24,897,922.98	24,897,922.98
买入返售金融资产	3,000,000.00	-	-	-	3,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	394,541.98	394,541.98

应收利息	-	-	-	850.93	850.93
应收申购款	-	-	-	689.65	689.65
资产总计	9,086,658.46	-	-	25,294,005.54	34,380,664.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	718,646.66	718,646.66
应付管理人报酬	-	-	-	45,787.85	45,787.85
应付托管费	-	-	-	7,631.32	7,631.32
应付交易费用	-	-	-	137,495.96	137,495.96
其他负债	-	-	-	152,703.19	152,703.19
负债总计	-	-	-	1,062,264.98	1,062,264.98
利率敏感度缺口	9,086,658.46	-	-	24,231,740.56	33,318,399.02

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于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需缴纳的交易保证金后，应当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%；权证、股指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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	24,897,922.98	74.73
合计	24,897,922.98	74.73

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币万元)
		2016 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 136
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 136

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 24,897,922.98 元, 无属于第二层次以及第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	24,897,922.98	72.42
	其中: 股票	24,897,922.98	72.42
5	买入返售金融资产	3,000,000.00	8.73
6	银行存款和结算备付金合计	5,994,245.08	17.43
7	其他各项资产	488,495.94	1.42
8	合计	34,380,664.00	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
C	制造业	17,661,507.66	53.01
F	批发和零售业	2,411,900.08	7.24
G	交通运输、仓储和邮政业	1,033,582.00	3.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	315,800.00	0.95
J	金融业	409,200.00	1.23
K	房地产业	727,650.00	2.18
L	租赁和商务服务业	575,000.00	1.73
P	教育	769,543.24	2.31
R	文化、体育和娱乐业	993,740.00	2.98
	合计	24,897,922.98	74.73

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期无沪港通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300129	泰胜风能	160,000	1,400,000.00	4.20
2	600967	北方创业	103,000	1,397,710.00	4.20
3	002013	中航机电	69,950	1,279,385.50	3.84
4	000952	广济药业	60,000	1,182,000.00	3.55
5	000729	燕京啤酒	170,000	1,181,500.00	3.55
6	603123	翠微股份	103,400	1,085,700.00	3.26
7	600826	兰生股份	37,694	1,029,800.08	3.09
8	600362	江西铜业	60,000	1,003,800.00	3.01
9	002675	东诚药业	70,000	1,001,000.00	3.00
10	002343	慈文传媒	22,000	993,740.00	2.98
11	002674	兴业科技	55,941	993,512.16	2.98
12	600038	中直股份	20,000	968,400.00	2.91

13	000523	广州浪奇	85,000	965,600.00	2.90
14	600834	申通地铁	55,000	814,000.00	2.44
15	600517	置信电气	80,000	778,400.00	2.34
16	600661	新南洋	27,068	769,543.24	2.31
17	000014	沙河股份	35,000	727,650.00	2.18
18	002202	金风科技	40,000	684,400.00	2.05
19	000930	中粮生化	50,000	672,000.00	2.02
20	600737	中粮屯河	50,000	623,000.00	1.87
21	600057	象屿股份	50,000	575,000.00	1.73
22	000400	许继电气	30,000	544,500.00	1.63
23	600990	四创电子	7,400	537,980.00	1.61
24	002743	富煌钢构	30,000	470,400.00	1.41
25	002308	威创股份	30,000	442,200.00	1.33
26	600110	诺德股份	40,000	426,400.00	1.28
27	002229	鸿博股份	18,000	423,720.00	1.27
28	600160	巨化股份	40,000	423,200.00	1.27
29	000783	长江证券	40,000	409,200.00	1.23
30	600476	湘邮科技	10,000	315,800.00	0.95
31	002758	华通医药	10,000	296,400.00	0.89
32	002570	贝因美	20,000	262,400.00	0.79
33	600662	强生控股	19,800	219,582.00	0.66

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600787	中储股份	9,105,990.79	27.33
2	002172	澳洋科技	9,046,507.59	27.15
3	300342	天银机电	8,599,592.73	25.81
4	000523	广州浪奇	8,157,757.43	24.48
5	000860	顺鑫农业	8,126,808.30	24.39
6	002243	通产丽星	7,801,953.00	23.42
7	600562	国睿科技	7,728,662.00	23.20
8	600395	盘江股份	7,634,390.99	22.91
9	002268	卫士通	7,628,741.52	22.90
10	600730	中国高科	7,511,143.00	22.54

11	600073	上海梅林	7,459,528.20	22.39
12	600826	兰生股份	7,024,298.74	21.08
13	600476	湘邮科技	6,925,830.71	20.79
14	600155	宝硕股份	6,138,580.29	18.42
15	000801	四川九洲	6,036,819.76	18.12
16	600963	岳阳林纸	5,882,798.99	17.66
17	000567	海德股份	5,882,235.64	17.65
18	600257	大湖股份	5,673,658.64	17.03
19	000014	沙河股份	5,669,443.40	17.02
20	300148	天舟文化	5,638,119.85	16.92
21	000922	佳电股份	5,542,424.91	16.63
22	603869	北部湾旅	5,404,008.59	16.22
23	600661	新南洋	5,356,527.32	16.08
24	600307	酒钢宏兴	5,344,900.00	16.04
25	002308	威创股份	5,245,475.04	15.74
26	002299	圣农发展	5,230,768.42	15.70
27	000530	大冷股份	5,188,527.00	15.57
28	000890	法尔胜	5,163,486.95	15.50
29	002090	金智科技	5,161,651.00	15.49
30	600967	北方创业	4,965,021.86	14.90
31	600872	中炬高新	4,873,358.22	14.63
32	300188	美亚柏科	4,846,366.00	14.55
33	600986	科达股份	4,812,077.71	14.44
34	002347	泰尔重工	4,728,695.20	14.19
35	000563	陕国投A	4,683,683.00	14.06
36	000045	深纺织A	4,635,933.00	13.91
37	002224	三力士	4,552,139.00	13.66
38	300010	立思辰	4,545,666.45	13.64
39	600313	农发种业	4,487,818.98	13.47
40	002601	佰利联	4,460,902.80	13.39
41	600270	外运发展	4,441,692.99	13.33
42	000687	华讯方舟	4,377,778.69	13.14
43	300212	易华录	4,328,125.00	12.99
44	002467	二六三	4,316,683.98	12.96
45	600240	华业资本	4,048,385.73	12.15
46	300352	北信源	3,966,985.00	11.91

47	300046	台基股份	3,940,390.02	11.83
48	600997	开滦股份	3,924,710.10	11.78
49	002546	新联电子	3,789,069.00	11.37
50	600546	*ST 山煤	3,760,908.00	11.29
51	002205	国统股份	3,741,635.91	11.23
52	600662	强生控股	3,729,610.00	11.19
53	002305	南国置业	3,692,968.00	11.08
54	300161	华中数控	3,638,020.40	10.92
55	002686	亿利达	3,568,019.00	10.71
56	000070	特发信息	3,526,605.74	10.58
57	600498	烽火通信	3,522,722.72	10.57
58	600888	新疆众和	3,507,681.00	10.53
59	600622	嘉宝集团	3,478,363.00	10.44
60	002364	中恒电气	3,456,380.58	10.37
61	002519	银河电子	3,374,870.64	10.13
62	600433	冠豪高新	3,363,049.93	10.09
63	600552	凯盛科技	3,322,490.24	9.97
64	600038	中直股份	3,317,782.27	9.96
65	002013	中航机电	3,168,009.00	9.51
66	603555	贵人鸟	3,167,119.69	9.51
67	600328	兰太实业	3,134,392.00	9.41
68	000959	首钢股份	3,057,819.00	9.18
69	600058	五矿发展	2,946,455.00	8.84
70	000783	长江证券	2,932,200.00	8.80
71	002626	金达威	2,926,713.00	8.78
72	600085	同仁堂	2,887,576.00	8.67
73	600029	南方航空	2,879,600.00	8.64
74	000938	紫光股份	2,830,809.00	8.50
75	600728	佳都科技	2,826,558.40	8.48
76	000150	宜华健康	2,800,304.75	8.40
77	600716	凤凰股份	2,789,781.00	8.37
78	600782	新钢股份	2,784,208.00	8.36
79	000971	高升控股	2,779,770.50	8.34
80	000078	海王生物	2,738,820.00	8.22
81	002586	围海股份	2,738,426.00	8.22
82	000978	桂林旅游	2,716,630.76	8.15

83	600737	中粮屯河	2,714,586.00	8.15
84	600158	中体产业	2,681,558.11	8.05
85	002488	金固股份	2,668,633.69	8.01
86	002101	广东鸿图	2,629,948.80	7.89
87	000606	*ST 易桥	2,620,252.00	7.86
88	600184	光电股份	2,550,439.88	7.65
89	600594	益佰制药	2,545,586.00	7.64
90	603686	龙马环卫	2,538,735.00	7.62
91	002368	太极股份	2,538,395.00	7.62
92	000666	经纬纺机	2,532,629.89	7.60
93	300216	千山药机	2,531,403.31	7.60
94	000895	双汇发展	2,523,411.00	7.57
95	300181	佐力药业	2,489,119.00	7.47
96	601886	江河集团	2,445,638.00	7.34
97	300322	硕贝德	2,441,770.00	7.33
98	000949	新乡化纤	2,441,600.00	7.33
99	600096	云天化	2,431,752.45	7.30
100	002136	安纳达	2,424,987.34	7.28
101	600185	格力地产	2,413,828.25	7.24
102	002643	万润股份	2,405,986.00	7.22
103	600056	中国医药	2,357,028.00	7.07
104	000779	三毛派神	2,321,803.00	6.97
105	300334	津膜科技	2,284,186.68	6.86
106	002057	中钢天源	2,281,958.00	6.85
107	000728	国元证券	2,243,486.00	6.73
108	603123	翠微股份	2,239,110.00	6.72
109	600794	保税科技	2,233,833.86	6.70
110	600640	号百控股	2,230,919.92	6.70
111	300251	光线传媒	2,220,987.00	6.67
112	300263	隆华节能	2,220,121.12	6.66
113	603126	中材节能	2,190,925.52	6.58
114	002421	达实智能	2,157,023.04	6.47
115	002674	兴业科技	2,156,055.96	6.47
116	002387	黑牛食品	2,144,638.53	6.44
117	600486	扬农化工	2,141,484.00	6.43
118	002117	东港股份	2,118,595.54	6.36

119	002518	科士达	2,096,113.00	6.29
120	600754	锦江股份	2,086,313.00	6.26
121	600834	申通地铁	2,080,290.00	6.24
122	600756	浪潮软件	2,061,664.00	6.19
123	002537	海立美达	2,018,030.00	6.06
124	002454	松芝股份	1,997,075.94	5.99
125	600080	金花股份	1,991,800.00	5.98
126	002341	新纶科技	1,988,751.60	5.97
127	600306	*ST 商城	1,979,033.00	5.94
128	000011	深物业 A	1,964,735.00	5.90
129	002004	华邦健康	1,957,148.86	5.87
130	002732	燕塘乳业	1,950,966.00	5.86
131	600845	宝信软件	1,949,454.00	5.85
132	000695	滨海能源	1,947,593.00	5.85
133	600479	千金药业	1,925,085.00	5.78
134	002229	鸿博股份	1,876,089.00	5.63
135	002766	索菱股份	1,855,348.66	5.57
136	002100	天康生物	1,847,593.71	5.55
137	002036	联创电子	1,834,569.00	5.51
138	600889	南京化纤	1,816,493.50	5.45
139	300140	启源装备	1,812,352.00	5.44
140	600118	中国卫星	1,803,042.00	5.41
141	000032	深桑达 A	1,788,526.00	5.37
142	002343	慈文传媒	1,770,297.00	5.31
143	000697	炼石有色	1,754,856.00	5.27
144	002325	洪涛股份	1,725,893.63	5.18
145	002137	麦达数字	1,715,699.50	5.15
146	002073	软控股份	1,688,027.00	5.07
147	002366	台海核电	1,643,246.45	4.93
148	600658	电子城	1,642,974.80	4.93
149	600297	广汇汽车	1,642,600.00	4.93
150	300063	天龙集团	1,629,746.00	4.89
151	600372	中航电子	1,616,997.84	4.85
152	600637	东方明珠	1,615,533.63	4.85
153	300144	宋城演艺	1,614,824.00	4.85
154	002121	科陆电子	1,609,603.01	4.83

155	002714	牧原股份	1,608,842.55	4.83
156	002690	美亚光电	1,597,669.00	4.80
157	600650	锦江投资	1,587,400.00	4.76
158	601669	中国电建	1,586,898.00	4.76
159	002458	益生股份	1,583,916.85	4.75
160	002080	中材科技	1,577,126.00	4.73
161	300353	东土科技	1,562,162.00	4.69
162	002066	瑞泰科技	1,512,996.00	4.54
163	000498	山东路桥	1,505,000.00	4.52
164	000050	深天马A	1,496,250.00	4.49
165	600827	百联股份	1,489,335.50	4.47
166	300100	双林股份	1,478,443.80	4.44
167	600689	上海三毛	1,468,699.00	4.41
168	000810	创维数字	1,462,684.00	4.39
169	002055	得润电子	1,461,750.40	4.39
170	002385	大北农	1,461,363.00	4.39
171	000501	鄂武商A	1,459,779.00	4.38
172	000529	广弘控股	1,455,687.00	4.37
173	300013	新宁物流	1,452,000.00	4.36
174	600859	王府井	1,450,970.00	4.35
175	600057	象屿股份	1,449,879.39	4.35
176	002462	嘉事堂	1,443,592.00	4.33
177	601688	华泰证券	1,436,253.20	4.31
178	600171	上海贝岭	1,414,471.85	4.25
179	000722	湖南发展	1,413,485.50	4.24
180	600745	中茵股份	1,397,716.87	4.20
181	600999	招商证券	1,396,439.00	4.19
182	002123	梦网荣信	1,395,026.00	4.19
183	300198	纳川股份	1,383,296.00	4.15
184	002605	姚记扑克	1,374,138.00	4.12
185	300129	泰胜风能	1,365,380.00	4.10
186	601888	中国国旅	1,364,130.00	4.09
187	002507	涪陵榨菜	1,362,250.00	4.09
188	600063	皖维高新	1,353,000.00	4.06
189	000977	浪潮信息	1,345,456.00	4.04
190	000090	天健集团	1,335,876.00	4.01

191	002202	金风科技	1,331,540.00	4.00
192	600561	江西长运	1,322,881.00	3.97
193	002286	保龄宝	1,313,932.96	3.94
194	002020	京新药业	1,292,922.00	3.88
195	603939	益丰药房	1,289,826.00	3.87
196	600110	诺德股份	1,283,123.00	3.85
197	600683	京投发展	1,270,920.00	3.81
198	600773	西藏城投	1,258,571.00	3.78
199	000917	电广传媒	1,258,068.00	3.78
200	600612	老凤祥	1,247,934.00	3.75
201	000401	冀东水泥	1,221,043.06	3.66
202	002367	康力电梯	1,215,900.00	3.65
203	002414	高德红外	1,212,568.92	3.64
204	000729	燕京啤酒	1,202,500.00	3.61
205	002077	大港股份	1,184,158.00	3.55
206	002494	华斯股份	1,175,572.00	3.53
207	000952	广济药业	1,175,026.00	3.53
208	002418	康盛股份	1,171,944.14	3.52
209	002675	东诚药业	1,163,401.00	3.49
210	002461	珠江啤酒	1,161,180.00	3.49
211	002244	滨江集团	1,141,000.00	3.42
212	002575	群兴玩具	1,132,930.44	3.40
213	000877	天山股份	1,123,900.00	3.37
214	600705	中航资本	1,119,000.00	3.36
215	002245	澳洋顺昌	1,112,855.00	3.34
216	300235	方直科技	1,106,283.00	3.32
217	600517	置信电气	1,104,881.00	3.32
218	300463	迈克生物	1,099,738.00	3.30
219	600604	市北高新	1,096,701.50	3.29
220	600116	三峡水利	1,092,200.00	3.28
221	601007	金陵饭店	1,082,057.00	3.25
222	300206	理邦仪器	1,074,394.38	3.22
223	000800	一汽轿车	1,056,000.00	3.17
224	000650	仁和药业	1,054,996.16	3.17
225	300271	华宇软件	1,050,685.00	3.15
226	600207	安彩高科	1,048,764.00	3.15

227	600362	江西铜业	1,045,769.00	3.14
228	600598	北大荒	1,040,317.00	3.12
229	300378	鼎捷软件	1,034,133.00	3.10
230	000776	广发证券	1,028,400.00	3.09
231	000061	农产品	1,019,036.00	3.06
232	600203	福日电子	1,014,176.00	3.04
233	600305	恒顺醋业	1,005,369.50	3.02
234	000717	*ST 韶钢	1,003,633.00	3.01
235	002396	星网锐捷	1,002,070.00	3.01
236	600151	航天机电	990,398.50	2.97
237	002184	海得控制	987,302.00	2.96
238	002158	汉钟精机	953,963.00	2.86
239	300026	红日药业	948,000.00	2.85
240	000526	紫光学大	939,745.00	2.82
241	600525	长园集团	939,650.00	2.82
242	600755	厦门国贸	904,700.00	2.72
243	002775	文科园林	901,929.00	2.71
244	600990	四创电子	891,693.00	2.68
245	000928	中钢国际	877,595.00	2.63
246	000999	华润三九	874,018.00	2.62
247	000581	威孚高科	851,029.00	2.55
248	002196	方正电机	826,794.40	2.48
249	600748	上实发展	817,980.00	2.46
250	002657	中科金财	817,705.70	2.45
251	601377	兴业证券	808,858.00	2.43
252	300468	四方精创	801,775.00	2.41
253	300017	网宿科技	799,773.00	2.40
254	000058	深赛格	797,200.00	2.39
255	300070	碧水源	794,906.68	2.39
256	000786	北新建材	792,000.00	2.38
257	600775	南京熊猫	791,530.00	2.38
258	002153	石基信息	775,880.00	2.33
259	300096	易联众	768,238.67	2.31
260	300242	明家联合	766,950.00	2.30
261	000029	深深房A	764,910.00	2.30
262	600279	重庆港九	760,421.00	2.28

263	600969	郴电国际	759,712.00	2.28
264	600602	云赛智联	743,550.00	2.23
265	300347	泰格医药	740,125.00	2.22
266	300339	润和软件	739,611.00	2.22
267	600735	新华锦	739,414.00	2.22
268	601118	海南橡胶	733,200.00	2.20
269	002261	拓维信息	725,486.00	2.18
270	603901	永创智能	721,640.00	2.17
271	000615	京汉股份	717,717.50	2.15
272	000988	华工科技	715,000.00	2.15
273	601799	星宇股份	706,947.11	2.12
274	002008	大族激光	705,477.00	2.12
275	002074	国轩高科	693,799.00	2.08
276	000930	中粮生化	689,650.00	2.07
277	000028	国药一致	688,350.00	2.07
278	601918	*ST 新集	687,971.00	2.06
279	600855	航天长峰	687,106.53	2.06
280	002670	国盛金控	686,628.00	2.06
281	300458	全志科技	671,680.00	2.02
282	000036	华联控股	669,880.00	2.01
283	603993	洛阳钼业	668,623.78	2.01

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	300342	天银机电	9,851,592.46	29.57
2	600787	中储股份	9,141,791.27	27.44
3	002172	澳洋科技	8,642,146.89	25.94
4	600073	上海梅林	8,113,297.34	24.35
5	600562	国睿科技	8,019,218.98	24.07
6	600395	盘江股份	7,932,563.59	23.81
7	000860	顺鑫农业	7,882,000.20	23.66
8	002243	通产丽星	7,697,323.52	23.10
9	002268	卫士通	7,676,393.00	23.04

10	600730	中国高科	7,360,824.39	22.09
11	000523	广州浪奇	7,019,200.80	21.07
12	600476	湘邮科技	6,938,756.72	20.83
13	600155	宝硕股份	6,397,092.23	19.20
14	300148	天舟文化	6,184,779.93	18.56
15	600826	兰生股份	6,078,050.49	18.24
16	600963	岳阳林纸	6,000,321.00	18.01
17	000801	四川九洲	5,976,272.56	17.94
18	000567	海德股份	5,819,441.00	17.47
19	002299	圣农发展	5,584,253.70	16.76
20	603869	北部湾旅	5,555,526.28	16.67
21	600257	大湖股份	5,546,506.00	16.65
22	000890	法尔胜	5,344,969.13	16.04
23	000922	佳电股份	5,196,599.14	15.60
24	002308	威创股份	5,138,285.81	15.42
25	000530	大冷股份	5,135,118.00	15.41
26	002090	金智科技	5,123,872.29	15.38
27	000014	沙河股份	4,952,457.50	14.86
28	600307	酒钢宏兴	4,944,000.00	14.84
29	600872	中炬高新	4,901,512.01	14.71
30	002347	泰尔重工	4,880,411.30	14.65
31	000563	陕国投A	4,706,332.00	14.13
32	002601	佰利联	4,705,381.46	14.12
33	600986	科达股份	4,689,776.38	14.08
34	000045	深纺织A	4,686,112.65	14.06
35	002546	新联电子	4,644,357.00	13.94
36	002224	三力士	4,638,347.17	13.92
37	600661	新南洋	4,595,031.00	13.79
38	600270	外运发展	4,581,272.19	13.75
39	300010	立思辰	4,569,862.94	13.72
40	300188	美亚柏科	4,412,901.00	13.24
41	300046	台基股份	4,384,247.00	13.16
42	002467	二六三	4,380,452.06	13.15
43	600997	开滦股份	4,146,055.07	12.44
44	002205	国统股份	4,135,260.50	12.41
45	600240	华业资本	3,977,060.85	11.94
46	600313	农发种业	3,966,719.00	11.91
47	000687	华讯方舟	3,884,743.82	11.66

48	300212	易华录	3,855,840.00	11.57
49	002305	南国置业	3,853,450.01	11.57
50	300161	华中数控	3,774,829.28	11.33
51	002686	亿利达	3,698,821.31	11.10
52	600662	强生控股	3,698,789.90	11.10
53	002519	银河电子	3,679,574.68	11.04
54	600498	烽火通信	3,609,582.14	10.83
55	600888	新疆众和	3,545,713.50	10.64
56	600967	北方创业	3,535,099.00	10.61
57	600546	*ST 山煤	3,520,000.00	10.56
58	300352	北信源	3,459,674.00	10.38
59	002364	中恒电气	3,419,871.43	10.26
60	000070	特发信息	3,409,058.36	10.23
61	600622	嘉宝集团	3,393,062.00	10.18
62	600552	凯盛科技	3,327,677.71	9.99
63	600433	冠豪高新	3,218,024.00	9.66
64	603555	贵人鸟	3,189,840.10	9.57
65	600328	兰太实业	3,187,221.00	9.57
66	000959	首钢股份	3,100,359.00	9.31
67	600728	佳都科技	3,027,779.40	9.09
68	600782	新钢股份	2,979,258.00	8.94
69	000971	高升控股	2,930,595.16	8.80
70	002626	金达威	2,903,925.10	8.72
71	000150	宜华健康	2,897,641.00	8.70
72	600085	同仁堂	2,850,018.96	8.55
73	600029	南方航空	2,827,480.54	8.49
74	002488	金固股份	2,780,247.00	8.34
75	002586	围海股份	2,774,362.20	8.33
76	000078	海王生物	2,764,335.36	8.30
77	600058	五矿发展	2,750,927.32	8.26
78	000606	*ST 易桥	2,707,739.34	8.13
79	000978	桂林旅游	2,678,519.39	8.04
80	300216	千山药机	2,638,888.00	7.92
81	000895	双汇发展	2,591,416.50	7.78
82	600716	凤凰股份	2,560,910.00	7.69
83	600056	中国医药	2,537,968.37	7.62
84	300181	佐力药业	2,507,697.00	7.53
85	002643	万润股份	2,505,002.00	7.52

86	002136	安纳达	2,504,438.61	7.52
87	002057	中钢天源	2,501,712.85	7.51
88	000949	新乡化纤	2,500,637.00	7.51
89	600184	光电股份	2,499,184.24	7.50
90	002368	太极股份	2,496,210.47	7.49
91	300322	硕贝德	2,493,509.23	7.48
92	002101	广东鸿图	2,492,962.00	7.48
93	603686	龙马环卫	2,484,311.00	7.46
94	000666	经纬纺机	2,475,171.50	7.43
95	600158	中体产业	2,458,810.00	7.38
96	600594	益佰制药	2,454,789.60	7.37
97	000783	长江证券	2,434,658.00	7.31
98	000938	紫光股份	2,364,342.60	7.10
99	601886	江河集团	2,338,175.24	7.02
100	000779	三毛派神	2,330,383.00	6.99
101	600185	格力地产	2,323,618.00	6.97
102	600794	保税科技	2,313,590.00	6.94
103	002421	达实智能	2,311,024.00	6.94
104	600038	中直股份	2,308,199.07	6.93
105	600756	浪潮软件	2,306,012.68	6.92
106	600096	云天化	2,284,510.45	6.86
107	002732	燕塘乳业	2,267,314.00	6.80
108	000011	深物业 A	2,265,559.00	6.80
109	300263	隆华节能	2,259,862.00	6.78
110	300251	光线传媒	2,240,623.61	6.72
111	002537	海立美达	2,213,356.00	6.64
112	002387	黑牛食品	2,202,919.00	6.61
113	002341	新纶科技	2,170,311.00	6.51
114	000728	国元证券	2,127,041.34	6.38
115	600889	南京化纤	2,122,444.14	6.37
116	600845	宝信软件	2,117,350.00	6.35
117	002518	科士达	2,081,052.45	6.25
118	600754	锦江股份	2,076,854.04	6.23
119	600486	扬农化工	2,072,636.38	6.22
120	600080	金花股份	2,065,701.80	6.20
121	002004	华邦健康	2,025,025.67	6.08
122	300334	津膜科技	1,999,819.06	6.00
123	000695	滨海能源	1,994,736.00	5.99

124	600479	千金药业	1,975,048.00	5.93
125	600306	*ST 商城	1,970,638.00	5.91
126	002454	松芝股份	1,953,716.63	5.86
127	002117	东港股份	1,933,434.24	5.80
128	600640	号百控股	1,895,867.00	5.69
129	603126	中材节能	1,890,449.00	5.67
130	002766	索菱股份	1,860,022.60	5.58
131	002100	天康生物	1,859,903.93	5.58
132	600118	中国卫星	1,857,923.94	5.58
133	600737	中粮屯河	1,835,346.51	5.51
134	002325	洪涛股份	1,821,665.37	5.47
135	002137	麦达数字	1,818,516.50	5.46
136	002121	科陆电子	1,811,709.24	5.44
137	002073	软控股份	1,793,046.51	5.38
138	002036	联创电子	1,738,420.00	5.22
139	002013	中航机电	1,723,726.14	5.17
140	000032	深桑达 A	1,712,965.74	5.14
141	002458	益生股份	1,682,603.33	5.05
142	000050	深天马 A	1,678,573.08	5.04
143	000697	炼石有色	1,661,591.00	4.99
144	002714	牧原股份	1,658,850.00	4.98
145	300063	天龙集团	1,644,128.00	4.93
146	000498	山东路桥	1,638,943.78	4.92
147	002366	台海核电	1,629,654.00	4.89
148	601669	中国电建	1,623,284.95	4.87
149	002080	中材科技	1,612,702.43	4.84
150	600658	电子城	1,600,955.79	4.81
151	000501	鄂武商 A	1,589,320.34	4.77
152	300353	东土科技	1,589,042.92	4.77
153	002690	美亚光电	1,580,900.00	4.74
154	300144	宋城演艺	1,575,107.00	4.73
155	600637	东方明珠	1,561,042.22	4.69
156	600297	广汇汽车	1,559,810.00	4.68
157	000529	广弘控股	1,558,312.69	4.68
158	600689	上海三毛	1,554,912.00	4.67
159	002385	大北农	1,554,848.00	4.67
160	002066	瑞泰科技	1,525,592.13	4.58
161	002055	得润电子	1,521,404.00	4.57

162	600372	中航电子	1,503,169.52	4.51
163	300140	启源装备	1,501,587.30	4.51
164	600650	锦江投资	1,492,941.00	4.48
165	002229	鸿博股份	1,476,701.00	4.43
166	600171	上海贝岭	1,467,154.60	4.40
167	600745	中茵股份	1,440,944.88	4.32
168	002494	华斯股份	1,436,608.00	4.31
169	600827	百联股份	1,431,786.35	4.30
170	600859	王府井	1,426,597.12	4.28
171	000090	天健集团	1,422,535.00	4.27
172	002462	嘉事堂	1,398,363.00	4.20
173	600999	招商证券	1,396,788.40	4.19
174	300198	纳川股份	1,393,771.00	4.18
175	000810	创维数字	1,392,939.90	4.18
176	300100	双林股份	1,389,711.00	4.17
177	000977	浪潮信息	1,382,140.73	4.15
178	002123	梦网荣信	1,374,206.67	4.12
179	002507	涪陵榨菜	1,370,532.00	4.11
180	600063	皖维高新	1,365,000.00	4.10
181	601688	华泰证券	1,364,553.08	4.10
182	600561	江西长运	1,359,773.46	4.08
183	603123	翠微股份	1,358,359.50	4.08
184	300013	新宁物流	1,353,570.00	4.06
185	000722	湖南发展	1,341,224.50	4.03
186	000917	电广传媒	1,321,542.00	3.97
187	002605	姚记扑克	1,320,161.00	3.96
188	002674	兴业科技	1,316,135.70	3.95
189	601888	中国国旅	1,312,707.00	3.94
190	002414	高德红外	1,311,865.64	3.94
191	600683	京投发展	1,299,325.00	3.90
192	002367	康力电梯	1,284,342.84	3.85
193	002020	京新药业	1,274,000.00	3.82
194	600834	申通地铁	1,222,527.47	3.67
195	002418	康盛股份	1,219,473.16	3.66
196	600116	三峡水利	1,205,091.00	3.62
197	603939	益丰药房	1,203,624.00	3.61
198	000877	天山股份	1,194,843.28	3.59
199	002077	大港股份	1,194,434.00	3.58

200	600604	市北高新	1,182,440.90	3.55
201	002286	保龄宝	1,181,485.38	3.55
202	600773	西藏城投	1,170,750.00	3.51
203	000401	冀东水泥	1,162,190.00	3.49
204	002244	滨江集团	1,153,659.47	3.46
205	600612	老凤祥	1,145,113.08	3.44
206	601007	金陵饭店	1,144,730.00	3.44
207	300271	华宇软件	1,140,844.73	3.42
208	002245	澳洋顺昌	1,117,074.00	3.35
209	002575	群兴玩具	1,116,432.48	3.35
210	600705	中航资本	1,108,000.00	3.33
211	600207	安彩高科	1,101,476.00	3.31
212	002461	珠江啤酒	1,096,817.00	3.29
213	300378	鼎捷软件	1,089,708.00	3.27
214	600151	航天机电	1,088,153.00	3.27
215	300235	方直科技	1,080,100.00	3.24
216	600203	福日电子	1,076,447.00	3.23
217	300206	理邦仪器	1,049,297.92	3.15
218	300463	迈克生物	1,048,792.00	3.15
219	000061	农产品	1,038,476.00	3.12
220	000776	广发证券	1,031,650.00	3.10
221	000800	一汽轿车	1,024,714.00	3.08
222	000650	仁和药业	1,004,629.06	3.02
223	002396	星网锐捷	987,645.00	2.96
224	600755	厦门国贸	969,200.00	2.91
225	600057	象屿股份	966,533.57	2.90
226	600598	北大荒	960,154.00	2.88
227	300026	红日药业	953,381.00	2.86
228	000526	紫光学大	929,079.00	2.79
229	002158	汉钟精机	921,459.36	2.77
230	600748	上实发展	918,750.00	2.76
231	600525	长园集团	914,100.00	2.74
232	002184	海得控制	904,347.00	2.71
233	002775	文科园林	890,892.00	2.67
234	002343	慈文传媒	880,816.00	2.64
235	600305	恒顺醋业	868,169.00	2.61
236	600110	诺德股份	867,549.00	2.60
237	300017	网宿科技	866,400.00	2.60

238	300339	润和软件	857,247.00	2.57
239	601377	兴业证券	853,000.00	2.56
240	600775	南京熊猫	852,700.00	2.56
241	000581	威孚高科	848,281.50	2.55
242	000928	中钢国际	828,754.00	2.49
243	300096	易联众	828,745.00	2.49
244	000988	华工科技	815,480.94	2.45
245	000999	华润三九	812,047.00	2.44
246	002657	中科金财	810,556.00	2.43
247	600969	郴电国际	796,990.00	2.39
248	300347	泰格医药	794,336.78	2.38
249	000058	深赛格	783,704.00	2.35
250	300242	明家联合	778,092.00	2.34
251	000786	北新建材	774,479.00	2.32
252	002153	石基信息	766,519.00	2.30
253	600735	新华锦	756,014.00	2.27
254	002261	拓维信息	755,614.00	2.27
255	002196	方正电机	745,860.12	2.24
256	002273	水晶光电	742,895.00	2.23
257	600602	云赛智联	741,380.15	2.23
258	601118	海南橡胶	722,250.00	2.17
259	603901	永创智能	721,843.84	2.17
260	603993	洛阳钼业	720,000.00	2.16
261	000717	*ST 韶钢	709,123.00	2.13
262	000029	深深房 A	707,058.00	2.12
263	600702	沱牌舍得	703,021.33	2.11
264	000615	京汉股份	698,333.00	2.10
265	300468	四方精创	696,715.00	2.09
266	002042	华孚色纺	692,022.00	2.08
267	600279	重庆港九	691,563.00	2.08
268	002202	金风科技	690,600.00	2.07
269	601799	星宇股份	689,165.00	2.07
270	002481	双塔食品	688,010.00	2.06
271	300070	碧水源	682,382.00	2.05
272	300458	全志科技	681,600.00	2.05
273	002223	鱼跃医疗	676,627.00	2.03
274	000036	华联控股	674,131.00	2.02
275	300445	康斯特	667,894.90	2.00

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	735,698,739.96
卖出股票收入（成交）总额	716,104,668.37

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险，如预期大额申购赎回、大量分红等。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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。

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	92,413.38
2	应收证券清算款	394,541.98
4	应收利息	850.93
5	应收申购款	689.65
9	合计	488,495.94

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
413	78,619.70	12,084,543.00	37.22%	20,385,392.77	62.78%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员	5,889.92	0.0181%

持有本基金		
-------	--	--

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.4 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	10,004,400.00	30.81	10,004,400.00	30.81	三年
其他	5,889.92	0.02	5,889.92	0.02	三年
合计	10,010,289.92	30.83	10,010,289.92	30.83	-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年1月26日）基金份额总额	109,482,592.39
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	6,395,767.97
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	83,408,424.59
本报告期期末基金份额总额	32,469,935.77

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、陈东先生于 2016 年 7 月 10 日因个人原因离任，自 2016 年 7 月 10 日后不再担任红土创新基金管理有限公司副总经理。

2、2016 年 8 月 25 日，经红土创新基金管理有限公司第一届董事会第十二次会议审议通过，免除陈文正先生公司董事长、董事、法定代表人的职务，由邵钢先生接任董事长（代行总经理职务）、法定代表人；同时免除邵钢先生原担任的总经理职务。

3、本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司经董事会会议审议通过以下事项：任命李庆萍女士为本行董事长，任命孙德顺先生为本行行长，以上任职资格于 2016 年 7 月 20 日获中国银监会批复核准。

4、2016 年 8 月 6 日，基金托管人中信银行股份有限公司发布变更法定代表人的公告：“中信银行股份有限公司（“本行”）收到北京市工商行政管理局重新核发的《营业执照》，本行已完成法定代表人变更的工商登记手续，自 2016 年 8 月 1 日起，本行法定代表人由常振明先生变更为李庆萍女士。”

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
中信证券	4	564,910,837.97	38.91%	413,119.65	38.91%	-
中银国际证券	2	154,038,274.32	10.61%	112,648.38	10.61%	-
民族证券	2	732,845,786.04	50.48%	535,930.73	50.48%	-

注：1、为节约交易单元资源，我公司在交易所交易系统升级的基础上，对同一银行托管基金进行了席位整合。

2、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- a、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- b、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- c、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- d、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择交易单元：

- a、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- b、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- c、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	807,000,000.00	41.42%	-	-
中银国际证券	-	-	98,500,000.00	5.06%	-	-
民族证券	-	-	1,042,600,000.00	53.52%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	红土创新基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	证券时报、公司网站	2016年7月7日
2	红土创新基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、公司网站	2016年7月12日
3	红土创新基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、公司网站	2016年7月15日
4	红土创新基金管理有限公司关于董事长变更的公告	证券时报、公司网站	2016年8月27日
5	红土创新基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、公司网站	2016年8月27日
6	红土创新基金管理有限公司关于旗下基金新增中信建投证券等为销售机构的公告	上海证券报、公司网站	2016年12月12日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2016 年 1 月 13 日认购本基金金额 10,000,000.00 元，认购费用为 1,000 元，折合本基金为 10,004,400.00 份（含募集期利息结转的份额）。以上固有资金作为本基金的发起资金，自本基金基金合同生效之日起，所认购的基金份额持有期限不少于三年。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金设立的文件；
- (2) 《红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- (3) 《红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》；

- (4) 《红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》;
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;
- (6) 报告期内红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

13.2 存放地点

深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 楼

13.3 查阅方式

公司网站: www.htcxfund.com