

# 红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资 基金 2017 年年度报告

2017 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 23 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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	53
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息.....</b>	<b>55</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动.....</b>	<b>56</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示.....</b>	<b>57</b>
11.1	基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
11.4	基金投资策略的改变.....	57
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
11.8	其他重大事件.....	59
<b>§12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>61</b>
12.1	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.....	61
12.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	61
<b>§13</b>	<b>备查文件目录.....</b>	<b>62</b>
13.1	备查文件目录.....	62
13.2	存放地点.....	62
13.3	查阅方式.....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	红土创新新兴产业混合
基金主代码	001753
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 9 月 23 日
基金管理人	红土创新基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	104,245,484.09 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过灵活的资产配置和对新兴产业的投资管理，拓展大类资产配置空间，在精选处于新兴产业中个股的基础上适度集中投资，在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期增值。
投资策略	本基金的资产配置主要是基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。在股票投资策略方面，本基金将从新兴产业中优选预期成长性较好的公司的股票进行投资。本基金所指的预期成长性较好的公司是指公司所在行业景气度较高且具有可持续性、公司所在行业竞争格局良好以及公司管理层素质较高等标准的公司。在债券投资策略方面，本基金主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。同时，本基金将根据对现货和期货市场的分析，采取多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60% + 中证全债指数收益率×40%
风险收益特征	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。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张洗尘
	联系电话	0755-33011878
	电子邮箱	zhangxc@htxfund.com
客户服务电话	0755-33011866	010-67596096
传真	0755-33011855	010-66275853
注册地址	广东省深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室	北京市西城区金融大街25号
办公地址	深圳市福田区深南大道	北京市西城区闹市口大街1号

	4011 号港中旅大厦 6 楼	院 1 号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	邵钢	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.htcxfund.com">http://www.htcxfund.com</a>
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	2017 年	2016 年	2015 年 9 月 23 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	9,167,091.32	-26,036,274.70	1,005,428.18
本期利润	13,532,243.58	-27,962,081.94	3,263,562.44
加权平均基金份额本期利润	0.1103	-0.1766	0.0151
本期加权平均净值利润率	12.13%	-20.48%	1.48%
本期基金份额净值增长率	11.90%	-16.67%	0.80%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-8,339,735.60	-21,123,000.80	432,286.58
期末可供分配基金份额利润	-0.0800	-0.1597	0.0024
期末基金资产净值	97,998,042.67	111,175,119.62	182,330,402.62
期末基金份额净值	0.940	0.840	1.008
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-6.00%	-16.00%	0.80%

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。

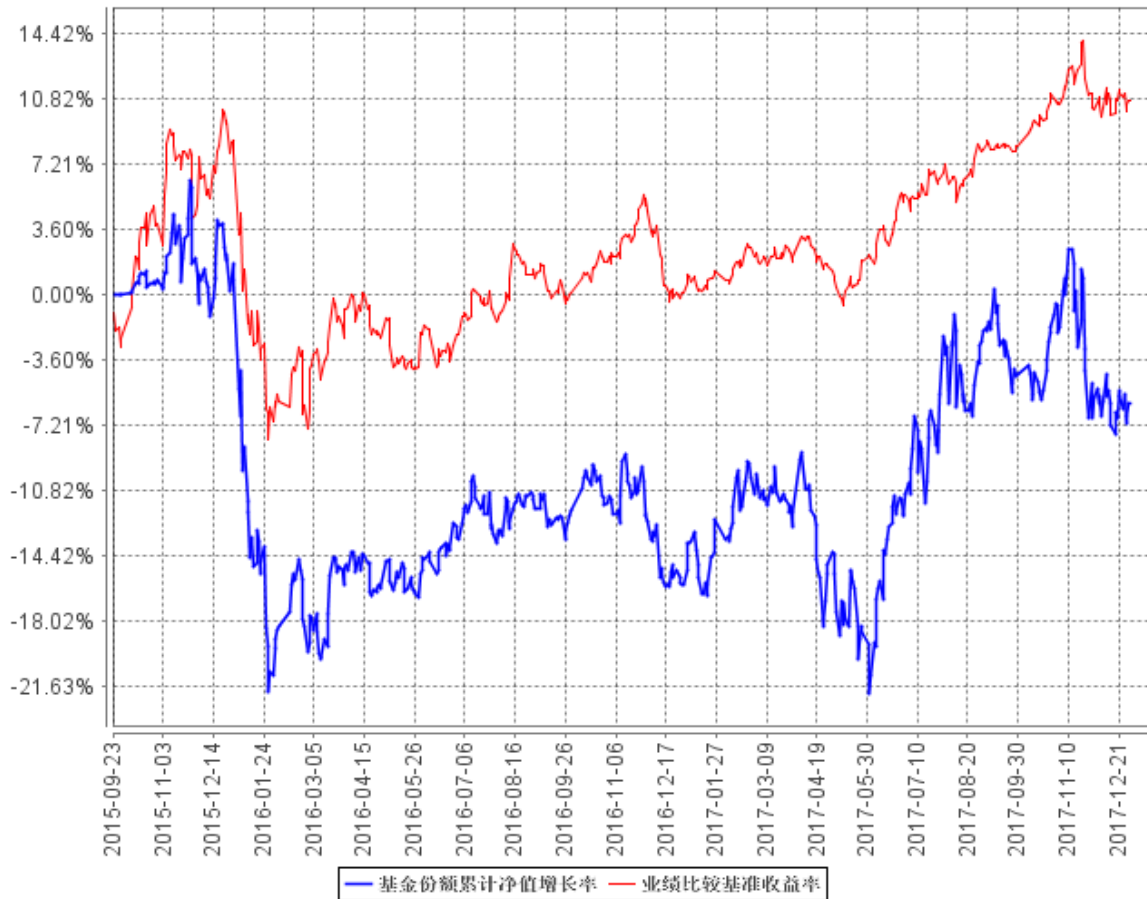
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-1.67%	1.29%	2.33%	0.48%	-4.00%	0.81%
过去六个月	5.62%	1.40%	4.96%	0.42%	0.66%	0.98%
过去一年	11.90%	1.33%	10.63%	0.38%	1.27%	0.95%
自基金合同生效起至今	-6.00%	1.21%	10.73%	0.70%	-16.73%	0.51%

### 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

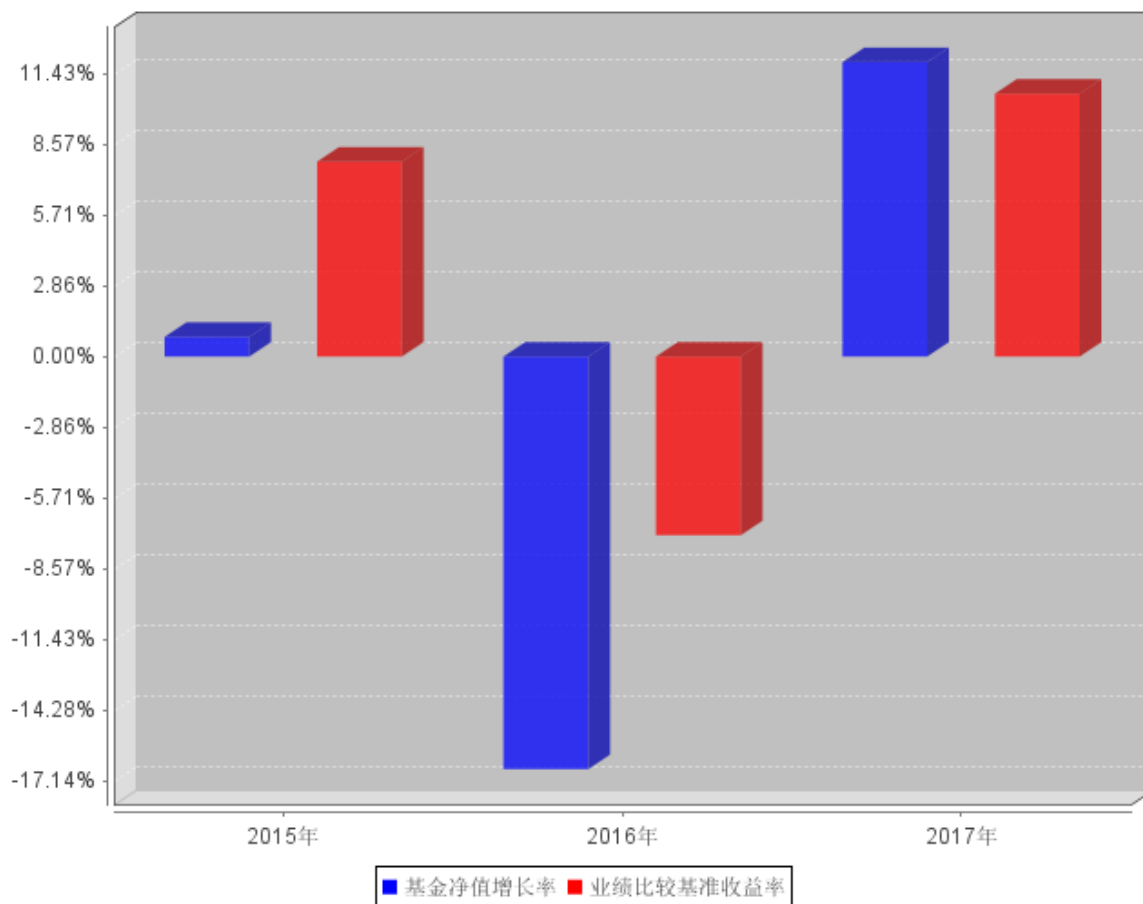
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





### 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

注：过往三年本基金未有利润分配事项。

## § 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，注册资本为 1.5 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 2017 年 12 月 31 日，红土创新基金共管理五只公募基金，资产管理规模 40.78 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		
侯世霞	基金经理	2015 年 9 月 23 日	-	8	兰州大学 MBA。历任平安证券有限责任公司新能源汽车行业研究员；日信证券有限责任公司化工行业首席分析师、证券投资部投资经理、投资部总经理助理、公司投资决策委员会委员。现任红土创新新兴产业混合证券投资基金、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遵规守信情况的说明

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 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

2017 年，上证综指上涨 6.56%，沪深 300 指数上涨 21.77%，创业板指数下跌 10.67%，代表全市场的 Wind 全 A 指数上涨 4.93%，指数之间涨跌幅严重分化。板块方面，中信 29 个一级行业中，15 个行业实现不同程度的上涨，14 个行业下跌。食品饮料、家电、煤炭涨幅居前；服装纺织、传媒、计算机和军工大幅下跌。

本基金严格遵循了优选长期成长价值的投资思路，坚信在中国漫长的经济转型期中，战略新兴产业将是未来牛股的主要产地。虽然 2017 年代表新兴产业的创业板指数全年下跌，但是我们优先配置了电子、新能源汽车和通信方向，做出了独立正确的配置选择。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日为止，本基金的单位净值为 0.940 元，累计单位净值为 0.940 元。报告期内本基金净值增长率为 11.90%，同期业绩基准增长率为 10.63%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年全年，A 股市场受企业盈利增长的支撑，同时受到流动性紧缩的制约，一部分业绩确定性强的行业和公司获得了较高的溢价，而既往增速较快，但是估值较高的行业和公司遭遇了估值的下调，最终表现出来的就是板块间的极度分化。

对于 2018 年全年来看，经济增速相对于 2017 年大概率下行，通胀压力渐显，叠加去杠杆，整体投资环境更加严峻。但是由于全球经济的同步复苏，外需支撑了出口的不断超预期，以及国内三四线城市货币化棚改的持续推进，经济向下的支撑强劲。随着行业结构在落后产能出清后好转，企业盈利逐步改善，企业再投资意愿增强，制造业 ROE 将持续改善，中国制造从求数量阶段进入求质量阶段，必将涌现大批的世界级的优秀公司。当全社会收入水平达到一定程度之后，人对于自身的消费的需求也更加重视品质的提升，伴随消费升级崛起的优质公司值得我们高度关注。新能源汽车在逐步走上市场化发展的道路，供应链经过长期的竞争优胜劣汰之后，优质公司会进入份额扩张期，带来盈利和估值的双升。

#### 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**

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### **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**

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人、基金资产净值低于 5000 万的情形。

## § 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

本报告期内，中国建设银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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(2018)第 20361 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	红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金 全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“红土创新新兴产业混合基金”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年度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。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附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,公允反映了红土创新新兴产业混合基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于红土创新新兴产业混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>红土创新新兴产业混合基金的基金管理人红土创新基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、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> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估红土创新新兴产业混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持</p>

	<p>续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算红土创新新兴产业混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督红土创新新兴产业混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,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。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对红土创新新兴产业混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致红土创新新兴产业混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>薛竞   陈熹</p>



会计师事务所的地址	中国. 上海市
审计报告日期	2018 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	10,182,241.07	5,986,101.00
结算备付金		706,790.94	2,045,093.18
存出保证金		149,696.70	210,015.34
交易性金融资产	7.4.7.2	87,790,851.02	87,597,223.50
其中：股票投资		87,790,851.02	87,597,223.50
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	-	15,000,000.00
应收证券清算款		-	1,192,182.96
应收利息	7.4.7.5	2,694.61	4,239.63
应收股利		-	-
应收申购款		4,092.52	789.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		98,836,366.86	112,035,645.11
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		32,950.78	-
应付管理人报酬		125,013.34	143,840.84
应付托管费		20,835.54	23,973.47
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	7.4.7.7	374,465.87	507,711.18
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	285,058.66	185,000.00
负债合计		838,324.19	860,525.49
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	104,245,484.09	132,298,120.42
未分配利润	7.4.7.10	-6,247,441.42	-21,123,000.80
所有者权益合计		97,998,042.67	111,175,119.62
负债和所有者权益总计		98,836,366.86	112,035,645.11

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.940 元，基金份额总额 104,245,484.09 份。

## 7.2 利润表

会计主体：红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		18,510,314.46	-21,927,141.65
1. 利息收入		227,246.96	907,996.60
其中：存款利息收入	7.4.7.11	127,835.66	270,833.79
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		99,411.30	637,162.81
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		13,806,644.13	-20,972,485.99
其中：股票投资收益	7.4.7.12	13,296,282.07	-21,272,973.07
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		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	510,362.06	300,487.08
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	4,365,152.26	-1,925,807.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	111,271.11	63,154.98
<b>减：二、费用</b>		4,978,070.88	6,034,940.29
1. 管理人报酬	7.4.10.1.1	1,674,185.31	2,052,292.42

2. 托管费	7.4.10.1.2	279,030.81	342,048.67
3. 销售服务费	7.4.10.1.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	2,844,500.96	3,464,777.86
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	180,353.80	175,821.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		13,532,243.58	-27,962,081.94
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		13,532,243.58	-27,962,081.94

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	132,298,120.42	-21,123,000.80	111,175,119.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,532,243.58	13,532,243.58
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）	-28,052,636.33	1,343,315.80	-26,709,320.53
其中：1. 基金申购款	20,028,130.62	-1,016,151.93	19,011,978.69
2. 基金赎回款	-48,080,766.95	2,359,467.73	-45,721,299.22
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“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	104,245,484.09	-6,247,441.42	97,998,042.67
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 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）	180,897,544.39	1,432,858.23	182,330,402.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-27,962,081.94	-27,962,081.94
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）	-48,599,423.97	5,406,222.91	-43,193,201.06
其中：1. 基金申购款	1,899,208.89	-250,678.32	1,648,530.57
2. 基金赎回款	-50,498,632.86	5,656,901.23	-44,841,731.63
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“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	132,298,120.42	-21,123,000.80	111,175,119.62

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：

<u>          杨兵          </u>	<u>          杨兵          </u>	<u>          焦小川          </u>
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

红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金(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]1625号《关于准予红土创新新兴产业灵活配置混合型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《红土创新新兴产业灵活配置混合型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244,770,309.73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(2015)第1099号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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》于2015年9月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为244,976,374.41份基金份额,其中认购资金利息折合206,064.68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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新新兴产业灵活配置混合型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%，投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-100%，其中权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%，任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。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 2018 年 3 月 27 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》、《红土创新新兴产业灵活配置混合型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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度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。

##### 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。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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **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，其处置价格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的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，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[2017]13号《中国证监会关于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。

## 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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	10,182,241.07	5,986,101.00
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	10,182,241.07	5,986,101.00

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	83,093,371.74	87,790,851.02	4,697,479.28
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	83,093,371.74	87,790,851.02	4,697,479.28
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	87,264,896.48	87,597,223.50	332,327.02
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	87,264,896.48	87,597,223.50	332,327.02

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：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 2017 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券-交易所	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券-交易所	15,000,000.00	-
合计	15,000,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,270.56	2,727.52
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	349.91	1,012.33
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	395.83
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	74.14	103.95
合计	2,694.61	4,239.63

### 7.4.7.6 其他资产

注：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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	374,465.87	507,711.18
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	374,465.87	507,711.18

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	58.66	-
预提费用	285,000.00	185,000.00
合计	285,058.66	185,000.00

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	132,298,120.42	132,298,120.42
本期申购	20,028,130.62	20,028,130.62
本期赎回（以“-”号填列）	-48,080,766.95	-48,080,766.95
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	104,245,484.09	104,245,484.09

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

### 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
上年度末	-20,285,693.67	-837,307.13	-21,123,000.80
本期利润	9,167,091.32	4,365,152.26	13,532,243.58
本期基金份额交易产生的变动数	2,778,866.75	-1,435,550.95	1,343,315.80

其中：基金申购款	-1,889,914.22	873,762.29	-1,016,151.93
基金赎回款	4,668,780.97	-2,309,313.24	2,359,467.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,339,735.60	2,092,294.18	-6,247,441.42

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	104,259.54	192,144.12
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	21,171.85	75,487.39
其他	2,404.27	3,202.28
合计	127,835.66	270,833.79

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	1,082,880,272.30	1,312,623,570.57
减：卖出股票成本总额	1,069,583,990.23	1,333,896,543.64
买卖股票差价收入	13,296,282.07	-21,272,973.07

#### 7.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期末及上年度末无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	510,362.06	300,487.08
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	510,362.06	300,487.08

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	4,365,152.26	-1,925,807.24
——股票投资	4,365,152.26	-1,925,807.24
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	4,365,152.26	-1,925,807.24

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	111,271.11	63,154.98
合计	111,271.11	63,154.98

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。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	2,844,500.96	3,464,777.86
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,844,500.96	3,464,777.86

### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
银行汇划费	8,353.80	15,821.34
账户维护费	12,000.00	-
合计	180,353.80	175,821.34

### 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

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 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(“红土创新”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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

本基金本报告期内及上年度可比期间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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,674,185.31	2,052,292.42
其中：支付销售机构的客户维护费	437,987.73	798,479.29

注：支付基金管理人红土创新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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	279,030.81	342,048.67

注：支付基金托管人中国建设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

注：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

注：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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总份 额的比例
深创投	50,060,750.00	48.0200%	50,060,750.00	37.8400%

#### 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	10,182,241.07	104,259.54	5,986,101.00	192,144.12

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.6 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内无利润分配。

#### 7.4.12 期末（2017 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

注：本基金本期末无因认购新发/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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002507	涪陵榨菜	2017 年 12 月 4 日	重大事项	17.94	-	-	290,150	4,519,898.64	5,205,291.00	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上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，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 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，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、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董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，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分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 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国建设银行，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。

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。

于 2017 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2016 年 12 月 31 日：同)。

### 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。

于 2017 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 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

#### **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 2017 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	10,182,241.07	-	-	-	10,182,241.07
结算备付金	706,790.94	-	-	-	706,790.94
存出保证金	149,696.70	-	-	-	149,696.70
交易性金融资产	-	-	-	87,790,851.02	87,790,851.02
应收利息	-	-	-	2,694.61	2,694.61
应收申购款	-	-	-	4,092.52	4,092.52
资产总计	11,038,728.71	-	-	87,797,638.15	98,836,366.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	32,950.78	32,950.78
应付管理人报酬	-	-	-	125,013.34	125,013.34
应付托管费	-	-	-	20,835.54	20,835.54
应付交易费用	-	-	-	374,465.87	374,465.87
其他负债	-	-	-	285,058.66	285,058.66
负债总计	-	-	-	838,324.19	838,324.19
利率敏感度缺口	11,038,728.71	-	-	86,959,313.96	97,998,042.67
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	5,986,101.00	-	-	-	5,986,101.00
结算备付金	2,045,093.18	-	-	-	2,045,093.18
存出保证金	210,015.34	-	-	-	210,015.34
交易性金融资产	-	-	-	87,597,223.50	87,597,223.50
买入返售金融资产	15,000,000.00	-	-	-	15,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,192,182.96	1,192,182.96

应收利息	-	-	-	4,239.63	4,239.63
应收申购款	-	-	-	789.50	789.50
资产总计	23,241,209.52	-	-	88,794,435.59	112,035,645.11
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	143,840.84	143,840.84
应付托管费	-	-	-	23,973.47	23,973.47
应付交易费用	-	-	-	507,711.18	507,711.18
其他负债	-	-	-	185,000.00	185,000.00
负债总计	-	-	-	860,525.49	860,525.49
利率敏感度缺口	23,241,209.52	-	-	87,933,910.10	111,175,119.62

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

注：于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2016 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2016 年 12 月 31 日：同）。

#### 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股票和债券，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。本基金股票资产占基金资产的 0%-95%，投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-100%，其中权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%，任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。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 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	87,790,851.02	89.58	87,597,223.50	78.79
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	87,790,851.02	89.58	87,597,223.50	78.79

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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)	
		本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	1. 沪深 300 指数上升 5%	增加约 504	增加约 436
	2. 沪深 300 指数下降 5%	减少约 504	减少约 436

#### 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 2017 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 82,585,560.02 元，属于第二层次的余额为 5,205,291.00 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 86,926,267.50 元，第二层次 670,956.00 元，无属于第三层次的余额)。

##### (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，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 2017 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(2016 年 12 月 31 日：同)。

##### (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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，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	87,790,851.02	88.82
	其中：股票	87,790,851.02	88.82
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	10,889,032.01	11.02
7	其他各项资产	156,483.83	0.16
8	合计	98,836,366.86	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 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,562,728.00	4.66
B	采矿业	-	-
C	制造业	59,308,953.60	60.52
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	9,113,035.00	9.30
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	9,875,133.00	10.08
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	4,931,001.42	5.03

0	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	87,790,851.02	89.58

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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	002024	苏宁易购	741,500	9,113,035.00	9.30
2	002456	欧菲科技	364,500	7,505,055.00	7.66
3	000725	京东方A	1,244,800	7,207,392.00	7.35
4	300136	信维通信	116,558	5,909,490.60	6.03
5	002507	涪陵榨菜	290,150	5,205,291.00	5.31
6	002475	立讯精密	216,100	5,065,384.00	5.17
7	600048	保利地产	355,900	5,035,985.00	5.14
8	000888	峨眉山A	457,846	4,931,001.42	5.03
9	000002	万科A	155,800	4,839,148.00	4.94
10	603517	绝味食品	117,700	4,639,734.00	4.73
11	000998	隆平高科	177,400	4,562,728.00	4.66
12	300700	岱勒新材	67,700	4,393,730.00	4.48
13	300616	尚品宅配	26,700	4,219,134.00	4.31
14	300433	蓝思科技	132,400	3,952,140.00	4.03
15	600872	中炬高新	151,200	3,743,712.00	3.82
16	603799	华友钴业	45,000	3,610,350.00	3.68
17	300554	三超新材	46,100	2,737,879.00	2.79
18	300577	开润股份	16,900	1,040,533.00	1.06
19	000538	云南白药	600	61,074.00	0.06
20	002460	赣锋锂业	100	7,175.00	0.01
21	603305	旭升股份	100	3,805.00	0.00
22	002384	东山精密	100	2,846.00	0.00
23	000895	双汇发展	100	2,650.00	0.00
24	002557	洽洽食品	100	1,579.00	0.00

## 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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603993	洛阳钼业	49,963,122.00	44.94
2	603799	华友钴业	45,196,124.00	40.65
3	002340	格林美	18,336,219.10	16.49
4	600366	宁波韵升	17,075,695.00	15.36
5	600362	江西铜业	16,209,330.78	14.58
6	002456	欧菲科技	16,163,309.72	14.54
7	002466	天齐锂业	15,889,858.00	14.29
8	002460	赣锋锂业	15,356,309.40	13.81
9	600383	金地集团	14,985,888.03	13.48
10	600048	保利地产	14,925,679.88	13.43
11	000059	华锦股份	13,777,336.00	12.39
12	601233	桐昆股份	13,759,696.03	12.38
13	600183	生益科技	13,601,531.62	12.23
14	600110	诺德股份	11,968,195.67	10.77
15	000823	超声电子	11,851,536.65	10.66
16	300037	新宙邦	11,818,843.90	10.63
17	600109	国金证券	11,595,665.00	10.43
18	002024	苏宁云商	11,014,250.00	9.91
19	600019	宝钢股份	10,713,637.20	9.64
20	000725	京东方 A	10,694,741.00	9.62
21	000970	中科三环	10,654,299.00	9.58
22	000807	云铝股份	10,403,816.20	9.36
23	603808	歌力思	10,362,080.90	9.32
24	300700	岱勒新材	10,083,169.15	9.07
25	000333	美的集团	9,880,370.00	8.89
26	000651	格力电器	9,874,016.00	8.88
27	600029	南方航空	9,520,856.00	8.56
28	601111	中国国航	9,502,020.00	8.55
29	601669	中国电建	9,338,818.00	8.40

30	600115	东方航空	9,247,066.00	8.32
31	603186	华正新材	9,241,658.00	8.31
32	002051	中工国际	9,228,778.38	8.30
33	600685	中船防务	9,097,935.44	8.18
34	600967	内蒙一机	9,040,526.00	8.13
35	002074	国轩高科	8,731,025.00	7.85
36	002555	三七互娱	8,566,964.00	7.71
37	300461	田中精机	8,350,820.00	7.51
38	600392	盛和资源	8,283,624.00	7.45
39	300115	长盈精密	8,004,489.83	7.20
40	000831	五矿稀土	7,689,368.00	6.92
41	600111	北方稀土	7,671,301.00	6.90
42	600068	葛洲坝	7,516,180.00	6.76
43	000002	万科A	7,388,394.00	6.65
44	300554	三超新材	7,233,669.00	6.51
45	300577	开润股份	7,008,578.40	6.30
46	000878	云南铜业	6,878,383.00	6.19
47	600745	闻泰科技	6,693,581.00	6.02
48	000933	神火股份	6,675,435.00	6.00
49	603305	旭升股份	6,192,740.00	5.57
50	002867	周大生	6,110,500.00	5.50
51	600585	海螺水泥	6,090,003.00	5.48
52	000065	北方国际	5,985,731.00	5.38
53	600801	华新水泥	5,980,847.31	5.38
54	601668	中国建筑	5,974,549.00	5.37
55	600426	华鲁恒升	5,912,618.00	5.32
56	000060	中金岭南	5,862,713.00	5.27
57	300059	东方财富	5,851,379.52	5.26
58	600872	中炬高新	5,844,543.00	5.26
59	603228	景旺电子	5,843,217.00	5.26
60	000538	云南白药	5,732,109.00	5.16
61	300618	寒锐钴业	5,703,794.46	5.13
62	600887	伊利股份	5,664,584.47	5.10
63	600259	广晟有色	5,647,555.00	5.08
64	601628	中国人寿	5,620,355.00	5.06
65	600398	海澜之家	5,434,194.00	4.89

66	002507	涪陵榨菜	5,317,482.00	4.78
67	000338	潍柴动力	5,258,066.00	4.73
68	002539	云图控股	5,126,160.00	4.61
69	002475	立讯精密	5,043,026.00	4.54
70	300136	信维通信	5,029,125.64	4.52
71	002304	洋河股份	4,860,890.00	4.37
72	600808	马钢股份	4,845,916.00	4.36
73	002142	宁波银行	4,787,950.00	4.31
74	300602	飞荣达	4,776,601.00	4.30
75	600076	康欣新材	4,735,605.00	4.26
76	601996	丰林集团	4,735,102.00	4.26
77	000910	大亚圣象	4,734,574.00	4.26
78	600172	黄河旋风	4,717,785.00	4.24
79	000761	本钢板材	4,701,861.00	4.23
80	300199	翰宇药业	4,698,801.60	4.23
81	600495	晋西车轴	4,698,108.92	4.23
82	601800	中国交建	4,692,041.00	4.22
83	300203	聚光科技	4,691,714.00	4.22
84	600072	中船科技	4,690,921.00	4.22
85	002458	益生股份	4,688,131.64	4.22
86	002635	安洁科技	4,687,543.00	4.22
87	002048	宁波华翔	4,685,879.00	4.21
88	600277	亿利洁能	4,685,328.00	4.21
89	600535	天士力	4,684,836.70	4.21
90	600221	海航控股	4,684,592.00	4.21
91	600446	金证股份	4,684,236.86	4.21
92	002234	民和股份	4,676,602.80	4.21
93	600089	特变电工	4,676,112.98	4.21
94	000888	峨眉山A	4,675,727.97	4.21
95	300511	雪榕生物	4,672,402.00	4.20
96	000401	冀东水泥	4,663,662.00	4.19
97	601899	紫金矿业	4,663,417.00	4.19
98	600885	宏发股份	4,660,673.00	4.19
99	300003	乐普医疗	4,640,775.00	4.17
100	000998	隆平高科	4,624,888.00	4.16
101	603179	新泉股份	4,621,773.18	4.16

102	600690	青岛海尔	4,613,796.24	4.15
103	000980	众泰汽车	4,609,229.22	4.15
104	600477	杭萧钢构	4,599,540.00	4.14
105	002155	湖南黄金	4,587,378.00	4.13
106	002594	比亚迪	4,585,373.18	4.12
107	600963	岳阳林纸	4,583,905.34	4.12
108	603517	绝味食品	4,563,365.00	4.10
109	000063	中兴通讯	4,527,920.00	4.07
110	600028	中国石化	4,521,753.00	4.07
111	600150	中国船舶	4,503,848.00	4.05
112	600691	阳煤化工	4,503,223.90	4.05
113	600703	三安光电	4,501,447.00	4.05
114	601600	中国铝业	4,497,319.00	4.05
115	002497	雅化集团	4,492,065.00	4.04
116	603938	三孚股份	4,442,167.00	4.00
117	601169	北京银行	4,422,418.00	3.98
118	603626	科森科技	4,419,279.00	3.98
119	600884	杉杉股份	4,404,285.00	3.96
120	600688	上海石化	4,400,603.00	3.96
121	600827	百联股份	4,385,385.00	3.94
122	000683	远兴能源	4,372,898.80	3.93
123	601688	华泰证券	4,365,003.00	3.93
124	002230	科大讯飞	4,304,792.56	3.87
125	002174	游族网络	4,302,549.79	3.87
126	002624	完美世界	4,284,854.54	3.85
127	002643	万润股份	4,282,590.50	3.85
128	603986	兆易创新	4,135,337.00	3.72
129	002769	普路通	4,110,017.57	3.70
130	603288	海天味业	4,092,101.00	3.68
131	300616	尚品宅配	4,078,006.00	3.67
132	300433	蓝思科技	3,888,541.00	3.50
133	000551	创元科技	3,558,619.00	3.20
134	600036	招商银行	3,537,955.60	3.18
135	601997	贵阳银行	3,531,028.96	3.18
136	601009	南京银行	3,511,912.00	3.16
137	601939	建设银行	3,495,044.00	3.14

138	601398	工商银行	3,491,254.00	3.14
139	000090	天健集团	3,426,593.00	3.08
140	600549	厦门钨业	3,384,017.35	3.04
141	300408	三环集团	3,104,163.12	2.79
142	002281	光迅科技	2,977,309.00	2.68
143	600498	烽火通信	2,971,862.70	2.67
144	600499	科达洁能	2,468,779.00	2.22
145	002876	三利谱	2,407,851.00	2.17
146	601166	兴业银行	2,397,082.00	2.16
147	000001	平安银行	2,396,059.60	2.16
148	000630	铜陵有色	2,286,484.00	2.06
149	002108	沧州明珠	2,272,766.90	2.04
150	300477	合纵科技	2,265,610.98	2.04
151	300284	苏交科	2,246,225.00	2.02
152	300545	联得装备	2,243,941.00	2.02

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603993	洛阳钼业	51,926,785.27	46.71
2	603799	华友钴业	42,984,178.21	38.66
3	002340	格林美	18,839,543.00	16.95
4	600110	诺德股份	18,550,878.41	16.69
5	000059	华锦股份	18,509,844.58	16.65
6	002466	天齐锂业	17,080,577.00	15.36
7	600366	宁波韵升	16,748,446.00	15.06
8	002460	赣锋锂业	16,747,458.75	15.06
9	600383	金地集团	14,926,858.86	13.43
10	600362	江西铜业	14,876,601.00	13.38
11	601233	桐昆股份	14,146,736.76	12.72
12	600183	生益科技	14,066,820.00	12.65
13	300037	新宙邦	11,766,307.88	10.58
14	000823	超声电子	11,448,790.85	10.30
15	600048	保利地产	10,751,447.14	9.67



16	002555	三七互娱	10,640,836.99	9.57
17	600109	国金证券	10,578,872.00	9.52
18	600392	盛和资源	10,545,701.00	9.49
19	603808	歌力思	10,514,565.08	9.46
20	600029	南方航空	10,010,002.00	9.00
21	600019	宝钢股份	9,956,437.01	8.96
22	000970	中科三环	9,953,316.00	8.95
23	002051	中工国际	9,946,855.68	8.95
24	603186	华正新材	9,858,891.26	8.87
25	600111	北方稀土	9,789,010.00	8.81
26	601800	中国交建	9,682,501.41	8.71
27	601111	中国国航	9,535,277.00	8.58
28	000333	美的集团	9,398,695.20	8.45
29	000651	格力电器	9,368,152.42	8.43
30	000807	云铝股份	9,297,595.20	8.36
31	600115	东方航空	9,210,584.00	8.28
32	601669	中国电建	9,200,756.00	8.28
33	002456	欧菲科技	9,190,409.35	8.27
34	000498	山东路桥	9,054,852.19	8.14
35	601668	中国建筑	9,036,779.00	8.13
36	300203	聚光科技	9,036,466.87	8.13
37	002074	国轩高科	9,010,895.60	8.11
38	600967	内蒙一机	8,860,461.00	7.97
39	600685	中船防务	8,709,235.48	7.83
40	300461	田中精机	7,986,932.00	7.18
41	000831	五矿稀土	7,522,171.00	6.77
42	300115	长盈精密	7,522,170.67	6.77
43	600068	葛洲坝	7,458,295.44	6.71
44	000630	铜陵有色	7,314,772.00	6.58
45	600745	闻泰科技	7,287,900.00	6.56
46	600691	阳煤化工	6,950,849.36	6.25
47	000878	云南铜业	6,907,459.00	6.21
48	300700	岱勒新材	6,664,377.88	5.99
49	300577	开润股份	6,637,671.00	5.97
50	300602	飞荣达	6,630,148.08	5.96
51	600426	华鲁恒升	6,521,067.00	5.87
52	600585	海螺水泥	6,187,971.00	5.57
53	000063	中兴通讯	5,946,186.00	5.35

54	600801	华新水泥	5,945,045.55	5.35
55	002867	周大生	5,880,804.68	5.29
56	000065	北方国际	5,866,634.00	5.28
57	601628	中国人寿	5,856,403.12	5.27
58	600259	广晟有色	5,745,824.06	5.17
59	603228	景旺电子	5,742,951.02	5.17
60	600477	杭萧钢构	5,734,762.00	5.16
61	600887	伊利股份	5,721,961.18	5.15
62	000538	云南白药	5,698,074.32	5.13
63	300059	东方财富	5,629,624.33	5.06
64	000060	中金岭南	5,580,939.50	5.02
65	000725	京东方 A	5,550,298.00	4.99
66	000338	潍柴动力	5,458,365.00	4.91
67	300284	苏交科	5,398,897.75	4.86
68	603305	旭升股份	5,386,103.00	4.84
69	600398	海澜之家	5,284,960.00	4.75
70	002573	清新环境	5,135,018.24	4.62
71	000933	神火股份	5,112,743.68	4.60
72	002539	云图控股	5,102,365.14	4.59
73	600089	特变电工	4,947,925.00	4.45
74	600076	康欣新材	4,934,522.00	4.44
75	600172	黄河旋风	4,907,544.00	4.41
76	002624	完美世界	4,895,603.64	4.40
77	002142	宁波银行	4,857,451.76	4.37
78	600884	杉杉股份	4,820,343.00	4.34
79	600072	中船科技	4,808,957.00	4.33
80	002048	宁波华翔	4,803,746.98	4.32
81	000826	启迪桑德	4,759,393.51	4.28
82	600323	瀚蓝环境	4,749,684.30	4.27
83	600495	晋西车轴	4,732,350.00	4.26
84	300618	寒锐钴业	4,718,457.57	4.24
85	600535	天士力	4,714,656.00	4.24
86	600690	青岛海尔	4,680,088.35	4.21
87	600446	金证股份	4,675,286.83	4.21
88	300554	三超新材	4,666,382.00	4.20
89	000910	大亚圣象	4,648,553.00	4.18
90	600221	海航控股	4,643,738.00	4.18
91	603938	三孚股份	4,637,683.00	4.17

92	002458	益生股份	4,626,818.57	4.16
93	600885	宏发股份	4,625,950.04	4.16
94	002304	洋河股份	4,624,274.00	4.16
95	601996	丰林集团	4,612,886.00	4.15
96	300003	乐普医疗	4,602,729.00	4.14
97	000401	冀东水泥	4,597,889.00	4.14
98	000980	众泰汽车	4,591,338.25	4.13
99	600028	中国石化	4,575,492.00	4.12
100	002234	民和股份	4,544,025.90	4.09
101	601899	紫金矿业	4,529,516.00	4.07
102	002594	比亚迪	4,516,086.99	4.06
103	002230	科大讯飞	4,500,611.77	4.05
104	300199	翰宇药业	4,478,741.02	4.03
105	600688	上海石化	4,470,361.00	4.02
106	300511	雪榕生物	4,462,126.00	4.01
107	002174	游族网络	4,450,644.25	4.00
108	000669	金鸿控股	4,449,755.60	4.00
109	601169	北京银行	4,445,926.00	4.00
110	601688	华泰证券	4,441,597.00	4.00
111	000683	远兴能源	4,422,063.20	3.98
112	600963	岳阳林纸	4,416,652.08	3.97
113	600827	百联股份	4,407,642.38	3.96
114	002635	安洁科技	4,397,241.00	3.96
115	600703	三安光电	4,353,168.00	3.92
116	603179	新泉股份	4,300,433.00	3.87
117	600150	中国船舶	4,230,828.00	3.81
118	300070	碧水源	4,229,767.15	3.80
119	600277	亿利洁能	4,229,104.90	3.80
120	600808	马钢股份	4,228,774.00	3.80
121	600617	国新能源	4,217,937.85	3.79
122	002497	雅化集团	4,202,054.00	3.78
123	601600	中国铝业	4,195,225.00	3.77
124	002643	万润股份	4,189,473.00	3.77
125	000002	万科A	4,127,338.00	3.71
126	000761	本钢板材	4,080,879.00	3.67
127	002155	湖南黄金	4,021,914.00	3.62
128	002769	普路通	4,016,105.03	3.61
129	603626	科森科技	3,993,664.00	3.59

130	603288	海天味业	3,885,900.32	3.50
131	600549	厦门钨业	3,824,454.12	3.44
132	600036	招商银行	3,778,904.86	3.40
133	600166	福田汽车	3,707,206.00	3.33
134	601009	南京银行	3,702,008.00	3.33
135	601997	贵阳银行	3,653,494.08	3.29
136	601398	工商银行	3,596,390.00	3.23
137	601939	建设银行	3,531,109.89	3.18
138	000551	创元科技	3,459,454.00	3.11
139	002570	贝因美	3,423,355.56	3.08
140	300137	先河环保	3,384,081.00	3.04
141	603986	兆易创新	3,351,692.00	3.01
142	000090	天健集团	3,339,581.00	3.00
143	300262	巴安水务	3,183,740.39	2.86
144	300408	三环集团	3,104,173.58	2.79
145	002281	光迅科技	3,024,691.00	2.72
146	600498	烽火通信	2,867,904.87	2.58
147	000001	平安银行	2,580,093.60	2.32
148	600499	科达洁能	2,491,465.00	2.24
149	601166	兴业银行	2,432,364.00	2.19
150	300172	中电环保	2,396,511.00	2.16
151	300477	合纵科技	2,365,743.95	2.13
152	002876	三利谱	2,358,246.98	2.12
153	000707	双环科技	2,250,624.71	2.02
154	300190	维尔利	2,243,285.97	2.02

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	1,065,412,465.49
卖出股票收入（成交）总额	1,082,880,272.30

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

注：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**

注：无。

**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**

注：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**

注：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**

注：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**

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

**8.10.1 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**

注：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	149,696.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,694.61
5	应收申购款	4,092.52

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	156,483.83

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002507	涪陵榨菜	5,205,291.00	5.31	临时停牌

## § 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
1,124	92,745.09	52,052,990.74	49.93%	52,192,493.35	50.07%

### 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持有本基金	260,580.53	0.2500%

### 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2015年9月23日）基金份额总额	244,976,374.41
本报告期期初基金份额总额	132,298,120.42
本报告期基金总申购份额	20,028,130.62
减:本报告期基金总赎回份额	48,080,766.95
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	104,245,484.09



## § 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、2017 年 1 月 23 日，经红土创新基金管理有限公司第一届董事会第十三次会议审议通过，免去杨兵先生公司副总经理的职务，由杨兵先生转任公司总经理、公司董事。

2、阮菲女士于 2017 年 10 月 12 日因个人原因离任，自 2017 年 10 月 12 日后不再担任红土创新基金管理有限公司副总经理。

3、2017 年 9 月 1 日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

### 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。本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 60,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 3 年。

### 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 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
银河证券		2746,906,452.09	34.77%	546,212.80	34.77%	-
申万宏源		2680,577,940.21	31.68%	497,705.37	31.68%	-
中信证券		4566,290,575.87	26.36%	414,127.13	26.36%	-
中信证券（山 东）		2154,517,769.62	7.19%	112,999.02	7.19%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-

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
银河证券	-	-	115,000,000.00	17.97%	-	-
申万宏源	-	-	204,000,000.00	31.88%	-	-
中信证券	-	-	307,000,000.00	47.97%	-	-
中信证券(山东)	-	-	14,000,000.00	2.19%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

## 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关于高级管理人员变更的公告	证券时报、公司网站	2017年1月25日
2	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	2017年4月25日
3	红土创新基金管理有限公司关于增加公司注册资本的公告	证券时报、中国证券报、公司网站	2017年6月10日
4	红土创新基金管理有限公司关于开通旗下基金转换业务及直销网上交易转换费率优惠的公告	证券时报、公司网站	2017年8月17日
5	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	2017年9月27日
6	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	2017年10月14日

7	红土创新基金管理有限公司关于旗下基金新增上海万得投资顾问有限公司为销售机构的公告	证券时报、公司网站	2017 年 11 月 4 日
8	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	2017 年 12 月 14 日
9	红土创新基金管理有限公司调整流通受限股票估值方法的公告	证券时报、公司网站	2017 年 12 月 16 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20170103-20171231	50,060,750.00	0.00	0.00	50,060,750.00	48.02%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

##### 1. 巨额赎回风险

(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；

(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

##### 2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

单一投资者巨额赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；

##### 3. 流动性风险

单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

在本基金募集期，本基金管理人唯一股东深圳市创新投资集团有限公司出资 5000 万元认购本基金，截止本报告期末，深创投集团持有的本基金份额未发生变化。

## § 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新兴产业灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- (2) 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；
- (3) 红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金托管协议；
- (4) 红土创新新兴产业灵活配置混合型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) 报告期内红土创新新兴产业灵活配置混合型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](http://www.htcxfund.com)