

红土创新增强收益债券型证券投资基金2018年4季度报告

2018-12-31

基金管理人：红土创新基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2019-01-19

重要提示

基金管理人的董事会及董事对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏... 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...

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Includes 基金简称 (Red Earth Innovation Enhanced Return Bond Fund), 基金代码 (000061), 基金管理人 (Red Earth Innovation Fund Management Co., Ltd.), etc.

主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators), 主基金(CNY) (Main Fund CNY), 红土创新增强收益债券A(CNY) (Red Earth Innovation Enhanced Return Bond A CNY), 红土创新增强收益债券C(CNY) (Red Earth Innovation Enhanced Return Bond C CNY).

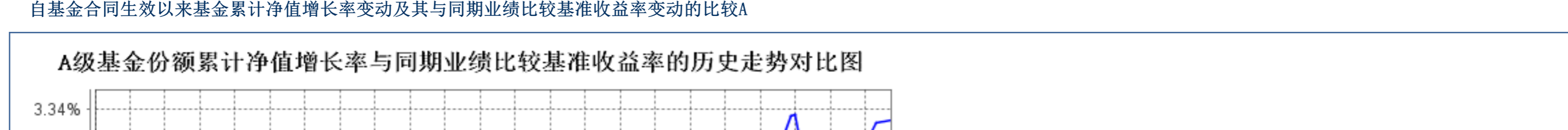
基金净值表现

Table showing 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 (Comparison of fund net value growth rate and benchmark return).

自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



其他指标

Table with columns: 其他指标 (Other Indicators), 报告期 (Reporting Period).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理任期 (Tenure as Fund Manager), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (Resignation Date), 证券从业年限 (Years of Securities Experience), 说明 (Remarks).

注：注：1. 对基金的历任基金经理，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...

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守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规的规定...

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况 报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度...

异常交易行为的专项说明 报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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%。

报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，国内经济下行压力开始显现，宽信用传导受阻，金融条件未出现明显的改善... 报告期内银行间市场流动性较为宽松，资金价格持续处于低位...

报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末红土创新增强收益债券基金基金份额净值为1.0324元，本报告期基金份额净值增长率为2.55%...

报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

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。

投资组合报告

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with columns: 序号 (No.), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

注：注：本基金本报告期末无股票投资

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with columns: 序号 (No.), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity in Shares), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

注：注：本基金本报告期末无股票投资

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号 (No.), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with columns: 序号 (No.), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (张) (Quantity in Tens of Thousand), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：注：本基金本报告期末无资产支持证券投资。

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

Table with columns: 序号 (No.), 贵金属代码 (Precious Metal Code), 贵金属名称 (Precious Metal Name), 数量 (克) (Quantity in Grams), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

注：注：本基金本报告期末无贵金属投资。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：注：本基金本报告期末无权证投资。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：注：本基金本报告期末无股指期货投资。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Quantity Buy/Sell), 合约市值 (元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in Yuan), 风险指标说明 (Risk Indicator Description).

注：注：本基金本报告期末无国债期货投资。

本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

其他资产构成 单位：人民币元

Table with columns: 序号 (No.), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount in Yuan).

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 注：注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 注：注：本基金本报告期末未持有受限股票。

投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五入的原因，分项之和与合计可能有尾差。

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目 (Item), 红土创新增强收益债券 (Red Earth Innovation Enhanced Return Bond), 红土创新增强收益债券A (Red Earth Innovation Enhanced Return Bond A), 红土创新增强收益债券C (Red Earth Innovation Enhanced Return Bond C).

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

Table with columns: 项目 (Item), 红土创新增强收益债券 (Red Earth Innovation Enhanced Return Bond), 红土创新增强收益债券A (Red Earth Innovation Enhanced Return Bond A), 红土创新增强收益债券C (Red Earth Innovation Enhanced Return Bond C).

注：注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with columns: 基金管理人 交易方式 (Fund Manager Transaction Method), 交易日期 (Transaction Date), 交易份额 (份) (Transaction Shares), 交易金额 (元) (Transaction Amount in Yuan), 适用费率 (Applicable Rate).

注：注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

报告期末发起式基金发起资金持有基金份额情况

Table with columns: 项目 (Item), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Held), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage of Issued Shares Held), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Period for Issued Shares).

注：注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

Table with columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (No.), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval for Holding 20% or More Shares), 期初份额 (Initial Shares), 申购份额 (Subscription Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (Holding Shares), 价格占比 (Percentage of Price).

1. 巨额赎回风险 (1) 本基金单一投资者大额赎回可能导致基金份额持有人赎回款项的现金需求，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响...

(2) 本基金单一投资者大额赎回可能导致基金份额持有人赎回款项的现金需求，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响...

(3) 本基金单一投资者大额赎回可能导致基金份额持有人赎回款项的现金需求，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响...

(4) 本基金单一投资者大额赎回可能导致基金份额持有人赎回款项的现金需求，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响...

(5) 本基金单一投资者大额赎回可能导致基金份额持有人赎回款项的现金需求，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响...

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- (1) 中国证监会批准红土创新增强收益债券型证券投资基金设立的文件 (2) 红土创新增强收益债券型证券投资基金合同 (3) 红土创新增强收益债券型证券投资基金托管协议 (4) 基金管理人业务资格批复、营业执照和公司章程 (5) 报告期内红土创新增强收益债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

存放地点

基金管理人、基金托管人处

查询方式

- (1) 投资者可在营业时间内免费查询，也可按本工本费查阅 (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人红土创新基金管理有限公司，客户服务电话：4006003333 (免长途费)