

红土改革创新红利灵活配置混合型发起式证券投资基金清算报告

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

清算报告出具日：2019年2月28日

清算报告公告日：2019年4月3日

一、重要提示

红土改革创新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”）由红土创新基金管理有限公司担任基金管理人，由中信银行股份有限公司担任基金托管人，本基金的发售已于2015年11月30日获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予红土改革创新红利灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]2778号文）准予进行募集，基金合同于2016年1月26日生效。

根据《红土改革创新红利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）“第五部分基金备案”“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”及“第十九部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算”“二、《基金合同》的终止事由”的约定：基金合同生效之日起三年后的对应自然日（2019年01月26日），本基金资产规模低于2亿元，已出现触发基金合同终止的情形。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等规定和基金合同约定，不需召开基金份额持有人大会，基金管理人终止本基金基金合同并依法履行基金财产清算程序。基金管理人已于2019年1月5日、2019年1月12日、2019年1月26日在《中国证券报》及本公司网站就本基金基金合同终止及进行基金财产清算的事宜进行了公告和提示性公告，详见《关于红土改革创新红利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》、《关于红土改革创新红利灵活配置混合型发起式证券投资基金可能触发基金合同终止情形的第一次提示性公告》和《关于红土改革创新红利灵活配置混合型发起式证券投资基金可能触发基金合同终止情形的第二次提示性公告》。

本基金自2019年1月28日起进入清算期，由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、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和广东岭南律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，广东岭南律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

1、基金基本情况

基金名称：红土改革创新红利灵活配置混合型发起式证券投资基金

基金简称：红土改革创新红利混合

基金交易代码：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

基金管理人名称：红土创新基金管理有限公司

基金托管人名称：中信银行股份有限公司

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，包括受益于国企制度改革、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 $60\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+40\% \times$ 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。

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

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

最后运作日：2019 年 1 月 26 日

单位：人民币元

资 产 最后运作日 负债和所有者权益 最后运作日

2019 年 1 月 26 日 2019 年 1 月 26 日

资 产： 负债：

银行存款 10,342,994.98 短期借款 -

结算备付金 100,103.69 交易性金融负债 -

存出保证金 74,131.45 衍生金融负债 -

交易性金融资产 - 卖出回购金融资产款 -

其中：股票投资 - 应付证券清算款 -

债券投资 - 应付赎回款 1,031,584.49

资产支持证券投资 - 应付管理人报酬 13,939.85

基金投资 - 应付托管费 2,323.32

衍生金融资产 - 应付销售服务费 -

买入返售金融资产 - 应付交易费用 -

应收证券清算款 - 应付税费 -

应收利息 4,014.44 应付利息 -

应收股利 - 应付利润 -

应收申购款 - 其他负债 40,982.23

其他资产 - 负债合计 1,088,829.89

所有者权益：

实收基金 14,212,409.20

未分配利润 -4,779,994.53

所有者权益合计 9,432,414.67

资产合计：10,521,244.56 负债与持有人权益总计： 10,521,244.56

四、清算报表附注

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”）于 2015 年 11 月 30 日由中国证监会《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》（证监许可[2015]2778 号文）准予募集注册，由红土创新基金管理有限公司根据《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法律法规的规定和《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》、《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》的有关约定，于 2016 年 1 月 4 日

至 2016 年 1 月 22 日公开募集。募集结束后，经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）“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验资报告”验证，并由中国证监会证券基金机构监管部《关于红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金备案确认的函》（机构部函【2016】152 号）予以备案，本基金基金合同于 2016 年 1 月 26 日生效。本基金募集期间扣除认购费的实收基金（本金）人民币 109,451,740.60 元，折合 109,451,740.60 份基金份额；有效认购资金在初始销售期内产生的利息为人民币 30,851.79 元，折 30,851.79 份基金份额，本基金在基金合同生效日的基金份额总额 109,482,592.39 份。本基金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》等相关法律法规的规定和《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》的约定，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、超短期融资券、地方政府债、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)。

根据《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》及红土创新基金管理有限公司于 2019 年 1 月 26 日发布的《关于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终止及基金财产清算的公告》，2019 年 1 月 26 日未赎回的基金份额，于 2019 年 1 月 28 日全部进入清算程序。

2、清算原因

根据《基金合同》“第五部分基金备案”“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”及“第十九部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算”“二、《基金合同》的终止事由”的约定：基金合同生效之日起三年后的对应自然日（2019 年 01 月 26 日），本基金资产规模低于 2 亿元，已出现触发基金合同终止的情形。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等规定和基金合同约定，不需召开基金份额持有人大会，基金管理人终止本基金基金合同并依法履行基金财产清算程序。

3、清算起始日

根据《红土创新基金管理有限公司关于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触发终止情形及进入基金财产清算程序的公告》，自 2019 年 1 月 28 日起，本基金进入清算程序。故本基金清算起始日为 2019 年 1 月 28 日。

4、清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

五、清算情况

自 2019 年 1 月 28 日至 2019 年 2 月 28 日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《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》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日最低备付金为人民币 100,103.69 元，其中 100,103.69 元于 2019 年 2 月 11 日划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 74,131.45 元，其中 74,131.45 元于 2019 年 2 月 11 日划

入托管账户。

(3) 本基金最后运作日应收申购款为人民币 0 元。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日其他负债为人民币 40,293.10 元，具体为应付审计费人民币 20,000.00 元、应付律师费人民币 20,000.00 元，应付汇划费人民币 293.10 元，其中应付汇划费已于 2019 年 2 月 1 日支付人民币 293.10 元，应付审计费已于 2019 年 2 月 12 日支付人民币 20,000.00 元；应付信息披露费已于 2019 年 2 月 12 日支付人民币 20,000.00 元。

4、清算期间的损益情况

自 2019 年 1 月 28 日至 2019 年 2 月 28 日止清算期间

项目 金额（单位：人民币元）

一、清算收益

利息收入（注 1） 2,667.63

投资收益（损失以“-”填列） -

公允价值变动损益（损失以“-”填列） -

清算收入小计（1） 2,667.63

二、清算费用

银行划款手续费 80.00

交易费用 -

其他费用 -

清算费用小计（2） 80.00

三、清算净收益（1）-（2） 2,587.63

注 1：利息收入系计提的自 2019 年 1 月 28 日至 2019 年 2 月 28 日止清算期间的银行存款利息、最低备付金利息和存出保证金利息。

5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

项目 金额（单位：人民币元）

一、最后运作日 2019 年 1 月 26 日基金净资产 9,432,414.67

加：清算期间净收益 2,587.63

减：2019 年 1 月 28 日确认的净赎回款 180,006.12

二、2019 年 2 月 28 日基金净资产 9,254,996.18

资产处置及负债清偿后，2019 年 2 月 28 日本基金剩余财产为人民币 9,254,996.18 元，根据本基金的基金合同约定，依据基金从财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、缴纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算起始日 2019 年 1 月 28 日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有。截至 2019 年 2 月 28 日止的应收利息共计人民币 2,667.63 元（以当前适用的利率预估）。2019 年 2 月 28 日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦由基金管理人以自有资金垫付。实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

6、基金财产清算报告的告知安排

清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

(1) 《红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金清算审计报告》；

(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清算报告》的法律意见。

2、存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所，投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（<http://http://www.htcxfund.cn>）查阅。

3、查阅方式

本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

2019年2月28日