红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金2016年半年度报告 摘要

2016年6月30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：2016年8月26日

§1 重要提示

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。本半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 2016 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	163,026,057.32 份
基金合同存续期	不定期

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	田青
	联系电话	0755-33011878	010-67596096

	电子邮箱	zhangxc@htcxfund.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		0755-33011866	010-67596096
传真		0755-33011855	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.htcxfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-24,418,016.17
本期利润	-25,492,901.59
加权平均基金份额本期利润	-0.1506
本期基金份额净值增长率	-14.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1360
期末基金资产净值	141,126,554.09
期末基金份额净值	0.866

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。

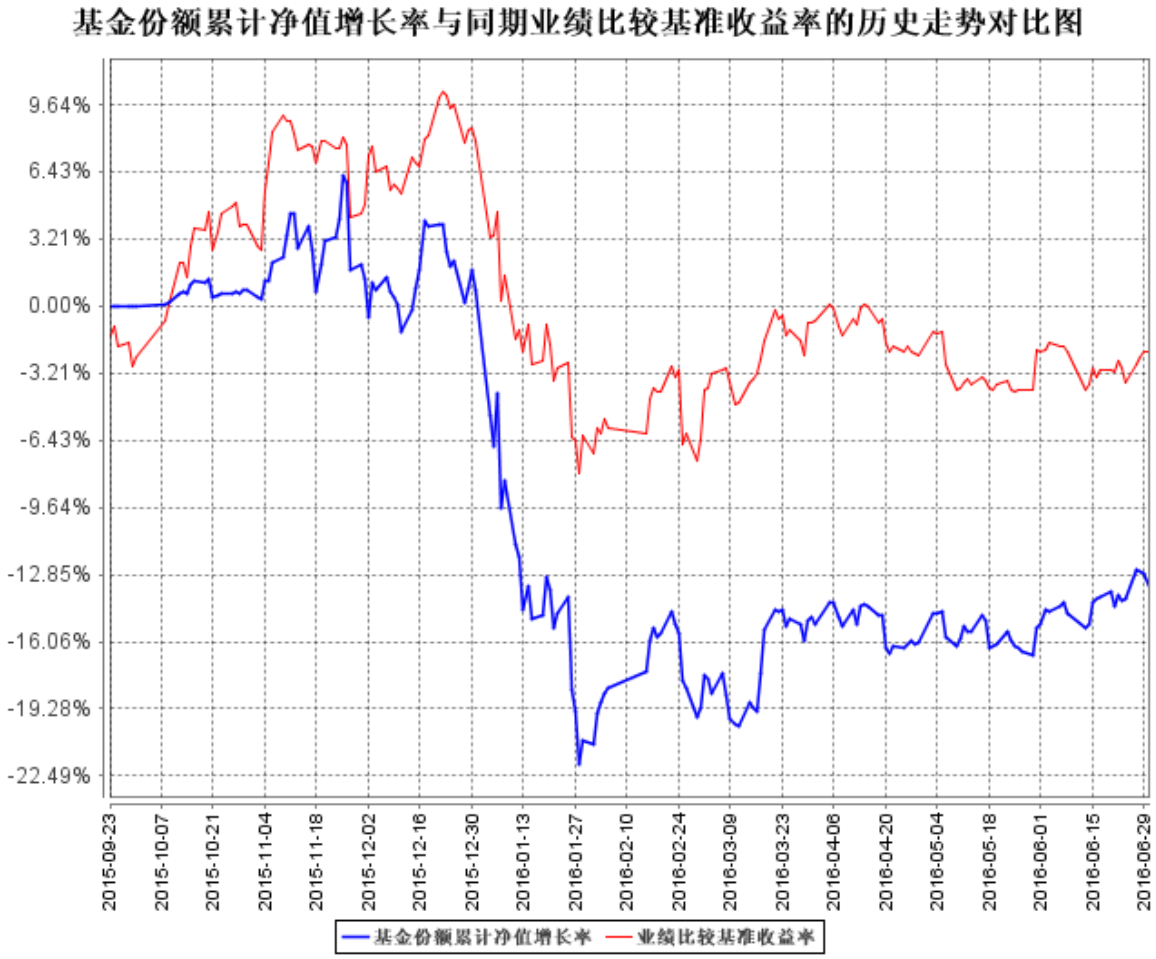
4.本基金合同生效日为 2015 年 09 月 23 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。

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
过去一个月	2.36%	0.63%	-0.12%	0.59%	2.48%	0.04%
过去三个月	1.76%	0.70%	-1.41%	0.61%	3.17%	0.09%
过去六个月	-14.09%	1.40%	-9.33%	1.11%	-4.76%	0.29%
自基金合同生效起至今	-13.40%	1.26%	-2.18%	1.07%	-11.22%	0.19%

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



注：基金合同生效日至本报告期末不满一年。本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月内，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

§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 6 月 30 日，红土创新基金共管理两只开放式基金，资产管理规模 1.96 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	-	6	兰州大学 MBA。6 年证券行业投研经验，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。

4.3.2 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 年上半年，上证综指下跌 17.22%，沪深 300 指数下跌 15.47%，创业板指数下跌 17.92%，全市场普跌。板块方面，仅食品饮料板块取得正收益。涨幅最大的一级行业包括：食品饮料、有色、银行、煤炭；涨幅最小的行业包括传媒、交运、计算机等。

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。2016 年上半年，市场波动较为剧烈，本基金根据市场变化，在股票仓位和行业配置上做出了调整应对，基金收益水平优于同期大盘指数。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日为止，本基金的份额净值为 0.866 元，累计份额净值为 0.866 元。报告期内本基金净值增长率为-14.09%，同期业绩基准增长率为-9.33%.

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场在上半年窄幅波动，经济在底部区域徘徊。预计中央政府会继续针对部分领域的改革与定向刺激，持续通过各种方法消灭过剩产能，激发经济活力，调整产业结构。由于英国脱欧，全球流动性保持持续宽松，美国加息概率再降低，国内预计将保持较为宽松的货币环境。综合上述

宏观经济局面、财政货币政策以及市场估值环境，我们认为在 2016 年下半年市场存在结构性上涨机会。但需留意的是国内经济的超预期下滑风险。

放眼中长期，伴随供给侧改革带来的传统产业的产能出清，以及需求侧刺激带来的需求的局部改善，中国经济有望在 2016 年筑底，传统的煤炭、有色等行业将迎来盈利和估值的双重改善，不断崛起的新兴产业将在经济增长中贡献越来越多的力量。随着人类走进移动互联时代，工业 4.0 为代表的智能制造将在生产中承担重要作用；芯片国产化趋势有望改写全球芯片格局，带来长期投资机会；当全社会收入水平达到一定程度之后，人对于自身的需求必将更加重视，娱乐、医疗、环保、教育、体育产业必将迎来黄金发展时期。其中，电子产品的升级换代，将迅速而深刻地改变行业结构，值得我们高度关注。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

遵照本基金合同约定，本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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： 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末	上年度末

	2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	5,598,221.57	59,579,727.88
结算备付金	5,056,001.30	7,851,135.67
存出保证金	193,332.01	92,194.60
交易性金融资产	59,903,525.57	111,489,784.49
其中：股票投资	59,903,525.57	111,489,784.49
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	-	-
买入返售金融资产	70,000,000.00	-
应收证券清算款	3,955,991.11	4,092,443.41
应收利息	4,514.14	17,644.93
应收股利	-	-
应收申购款	99.85	9,940.89
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	144,711,685.55	183,132,871.87
负债和所有者权益	**本期末 2016 年 6 月 30 日**	**上年度末 2015 年 12 月 31 日**
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	2,831,169.00	-
应付赎回款	47,587.45	21,999.13
应付管理人报酬	172,561.79	244,441.65
应付托管费	28,760.28	40,740.27
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	400,328.05	416,232.94
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	104,724.89	79,055.26
负债合计	3,585,131.46	802,469.25
所有者权益：		
实收基金	163,026,057.32	180,897,544.39
未分配利润	-21,899,503.23	1,432,858.23
所有者权益合计	141,126,554.09	182,330,402.62

负债和所有者权益总计	144,711,685.55	183,132,871.87

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.866 元，基金份额总额 163,026,057.32 份。

2、本基金自基金合同生效日（2015 年 9 月 23 日）至报告期末不满一年，无上年度同期对比数据。

6.2 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： 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入	-22,376,999.94
1.利息收入	539,076.88
其中：存款利息收入	156,392.48
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	382,684.40
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-21,877,222.28
其中：股票投资收益	-22,184,279.92
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	307,057.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,074,885.42
4. 汇兑收益 （损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	36,030.88
减：二、费用	3,115,901.65
1．管理人报酬	1,070,774.07
2．托管费	178,462.34
3．销售服务费	-
4．交易费用	1,778,536.76
5．利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6．其他费用	88,128.48

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-25,492,901.59
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-25,492,901.59

注：1、本基金自基金合同生效日（2015 年 9 月 23 日）至报告期末不满一年，无上年度同期对比数据。

6.3 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：2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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（本期净利润）	-	-25,492,901.59	-25,492,901.59
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）	-17,871,487.07	2,160,540.13	-15,710,946.94
其中：1.基金申购款	1,288,911.50	-179,199.69	1,109,711.81
2.基金赎回款	-19,160,398.57	2,339,739.82	-16,820,658.75
五、期末所有者权益（基金净值）	163,026,057.32	-21,899,503.23	141,126,554.09

注：1、本基金自基金合同生效日（2015 年 9 月 23 日）至报告期末不满一年，无上年度同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邵钢	杨兵	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

6.4 报表附注

6.4.1 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%；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 2016 年 8 月 26 批准报出。

6.4.2 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 6.4.4 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。

6.4.3 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 1 日至 2016 年 6 月 30 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 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。基金买卖股票的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股权的股息、红利收入及其他收入，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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,070,774.07
其中：支付销售机构的客户维护费	455,185.61

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 X1.50% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	178,462.34

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。

6.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期间未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	30.7100%	50,060,750.00	27.6700%

6.4.8.5 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 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	5,598,221.57	115,524.85

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.9 期末（ 2016 年 6 月 30 日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002314	南山控股	2016 年 3 月	重大事项	6.80	2016 年 7 月 19 日	7.51	651,200	4,259,284.00	4,428,160.00	-

		7 日								
002347	泰尔重工	2016 年 4 月 5 日	重大事项	19.45	2016 年 7 月 18 日	21.40	160,900	2,889,359.40	3,129,505.00	-
000401	冀东水泥	2016 年 4 月 6 日	重大事项	10.60	2016 年 7 月 15 日	10.50	278,700	2,904,779.00	2,954,220.00	-
600330	天通股份	2016 年 5 月 23 日	重大事项	13.93	-	-	49,300	689,214.00	686,749.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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 投资组合报告

7.1 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	59,903,525.57	41.40
	其中：股票	59,903,525.57	41.40
5	买入返售金融资产	70,000,000.00	48.37
6	银行存款和结算备付金合计	10,654,222.87	7.36
7	其他各项资产	4,153,937.11	2.87
8	合计	144,711,685.55	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	46,998,322.57	33.30
F	批发和零售业	2,624,323.00	1.86
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,852,720.00	4.15
K	房地产业	4,428,160.00	3.14
	合计	59,903,525.57	42.45

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期无沪港通股票。

7.3 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

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	600110	诺德股份	596,200	5,866,608.00	4.16
2	002674	兴业科技	377,463	5,786,507.79	4.10
3	002288	超华科技	572,300	5,665,770.00	4.01
4	000801	四川九洲	458,300	5,646,256.00	4.00
5	002371	七星电子	122,800	5,135,496.00	3.64
6	002314	南山控股	651,200	4,428,160.00	3.14
7	002421	达实智能	200,000	3,494,000.00	2.48
8	002347	泰尔重工	160,900	3,129,505.00	2.22
9	000401	冀东水泥	278,700	2,954,220.00	2.09
10	002308	威创股份	171,600	2,819,388.00	2.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	002714	牧原股份	11,316,248.88	6.21
2	000709	河钢股份	10,892,672.00	5.97
3	601699	潞安环能	10,660,283.99	5.85
4	002456	欧菲光	9,884,573.25	5.42
5	002421	达实智能	9,837,429.37	5.40
6	001979	招商蛇口	9,815,848.79	5.38
7	002699	美盛文化	9,765,347.00	5.36
8	600489	中金黄金	9,604,828.00	5.27
9	000050	深天马A	9,052,809.48	4.97
10	600546	*ST 山煤	8,812,039.00	4.83
11	300456	耐威科技	8,578,893.00	4.71
12	600395	盘江股份	8,382,246.90	4.60
13	600338	西藏珠峰	8,371,924.43	4.59
14	002001	新 和 成	8,024,893.50	4.40
15	600882	华联矿业	8,020,149.64	4.40
16	300339	润和软件	7,991,934.30	4.38
17	600547	山东黄金	7,749,895.00	4.25
18	600872	中炬高新	7,741,589.00	4.25
19	002156	通富微电	7,721,586.83	4.23
20	300242	明家联合	7,620,465.00	4.18
21	300498	温氏股份	7,546,309.50	4.14
22	300166	东方国信	7,247,990.48	3.98
23	600519	贵州茅台	7,137,838.99	3.91
24	300016	北陆药业	7,082,667.13	3.88
25	002371	七星电子	7,024,743.00	3.85
26	000807	云铝股份	7,012,357.00	3.85
27	300236	上海新阳	6,433,409.12	3.53
28	000933	*ST 神火	6,225,853.00	3.41
29	000606	*ST 易桥	6,212,337.68	3.41
30	600987	航民股份	6,198,056.36	3.40
31	002434	万里扬	6,197,867.16	3.40
32	300059	东方财富	5,779,140.00	3.17
33	000801	四川九洲	5,698,939.00	3.13

34	002288	超华科技	5,674,941.00	3.11
35	002131	利欧股份	5,664,824.67	3.11
36	002674	兴业科技	5,615,938.93	3.08
37	002494	华斯股份	5,604,108.00	3.07
38	600110	诺德股份	5,603,583.96	3.07
39	600884	杉杉股份	5,600,599.59	3.07
40	002182	云海金属	5,586,782.21	3.06
41	002326	永太科技	5,580,312.00	3.06
42	300017	网宿科技	5,575,751.47	3.06
43	300068	南都电源	5,554,321.39	3.05
44	002707	众信旅游	5,506,010.16	3.02
45	600633	浙报传媒	5,439,492.48	2.98
46	600584	长电科技	5,100,339.00	2.80
47	002366	台海核电	4,935,009.84	2.71
48	600104	上汽集团	4,878,280.00	2.68
49	600699	均胜电子	4,799,377.90	2.63
50	002343	慈文传媒	4,499,961.82	2.47
51	300347	泰格医药	4,475,886.23	2.45
52	000957	中通客车	4,474,847.00	2.45
53	002180	艾派克	4,462,119.55	2.45
54	600172	黄河旋风	4,404,890.12	2.42
55	600031	三一重工	4,366,216.00	2.39
56	300493	润欣科技	4,358,102.00	2.39
57	600029	南方航空	4,337,845.69	2.38
58	300467	迅游科技	4,332,135.17	2.38
59	002458	益生股份	4,325,001.64	2.37
60	600782	新钢股份	4,265,286.00	2.34
61	002314	南山控股	4,259,284.00	2.34
62	002241	歌尔股份	4,249,317.00	2.33
63	002185	华天科技	4,224,152.30	2.32
64	002121	科陆电子	4,220,400.00	2.31
65	002470	金正大	4,220,388.24	2.31
66	000902	新洋丰	4,219,356.91	2.31
67	600418	江淮汽车	4,215,973.50	2.31
68	002405	四维图新	4,210,484.22	2.31
69	000581	威孚高科	4,208,249.37	2.31

70	600006	东风汽车	4,204,949.20	2.31
71	600497	驰宏锌锗	4,156,353.00	2.28
72	002671	龙泉股份	4,147,517.00	2.27
73	002773	康弘药业	4,117,197.67	2.26
74	600166	福田汽车	3,816,783.00	2.09
75	000708	大冶特钢	3,814,719.35	2.09
76	600622	嘉宝集团	3,749,732.00	2.06
77	002547	春兴精工	3,718,083.56	2.04

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。

7.4.2 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	002699	美盛文化	14,120,930.74	7.74
2	002519	银河电子	12,393,128.16	6.80
3	000709	河钢股份	11,473,941.00	6.29
4	002714	牧原股份	10,622,416.46	5.83
5	002456	欧菲光	10,524,522.62	5.77
6	601699	潞安环能	10,240,001.27	5.62
7	600489	中金黄金	9,343,814.32	5.12
8	000050	深天马 A	9,231,770.00	5.06
9	001979	招商蛇口	9,186,236.22	5.04
10	600546	*ST 山煤	8,850,180.79	4.85
11	300160	秀强股份	8,703,881.13	4.77
12	002343	慈文传媒	8,694,435.75	4.77
13	300339	润和软件	8,598,304.59	4.72
14	600882	华联矿业	8,166,561.64	4.48
15	300242	明家联合	8,019,417.59	4.40
16	002654	万润科技	7,995,625.00	4.39
17	600395	盘江股份	7,986,582.00	4.38
18	002001	新 和 成	7,948,029.82	4.36
19	300456	耐威科技	7,774,935.00	4.26
20	002156	通富微电	7,729,482.40	4.24
21	600547	山东黄金	7,690,041.00	4.22
22	600519	贵州茅台	7,486,258.90	4.11

23	600872	中炬高新	7,384,711.16	4.05
24	600338	西藏珠峰	7,384,673.07	4.05
25	300016	北陆药业	7,271,503.00	3.99
26	600622	嘉宝集团	7,196,095.30	3.95
27	300166	东方国信	7,082,448.88	3.88
28	002434	万里扬	7,031,046.85	3.86
29	300498	温氏股份	6,982,169.00	3.83
30	002421	达实智能	6,731,534.00	3.69
31	600987	航民股份	6,722,778.68	3.69
32	000933	*ST 神火	6,605,438.90	3.62
33	002183	怡 亚 通	6,570,368.00	3.60
34	600633	浙报传媒	6,464,479.70	3.55
35	000807	云铝股份	6,305,388.90	3.46
36	300199	翰宇药业	6,072,607.97	3.33
37	000606	*ST 易桥	6,052,595.00	3.32
38	002131	利欧股份	5,933,418.60	3.25
39	300059	东方财富	5,882,206.47	3.23
40	002707	众信旅游	5,842,168.00	3.20
41	300236	上海新阳	5,781,516.00	3.17
42	002182	云海金属	5,508,298.00	3.02
43	600884	杉杉股份	5,504,628.00	3.02
44	002494	华斯股份	5,419,594.00	2.97
45	600699	均胜电子	5,395,914.00	2.96
46	300068	南都电源	5,376,709.73	2.95
47	600006	东风汽车	5,180,846.26	2.84
48	600584	长电科技	5,140,589.00	2.82
49	002180	艾派克	5,063,403.06	2.78
50	600104	上汽集团	5,010,920.00	2.75
51	002366	台海核电	4,817,843.25	2.64
52	600172	黄河旋风	4,727,229.66	2.59
53	002458	益生股份	4,606,861.00	2.53
54	002326	永太科技	4,514,138.00	2.48
55	002547	春兴精工	4,464,354.83	2.45
56	002185	华天科技	4,457,277.40	2.44
57	002241	歌尔股份	4,403,271.00	2.41
58	000902	新洋丰	4,381,321.00	2.40
59	002345	潮宏基	4,335,969.00	2.38
60	600497	驰宏锌锗	4,318,265.00	2.37

61	002671	龙泉股份	4,307,047.73	2.36
62	600031	三一重工	4,293,440.00	2.35
63	600029	南方航空	4,277,362.40	2.35
64	600782	新钢股份	4,236,287.50	2.32
65	002773	康弘药业	4,233,685.00	2.32
66	002470	金正大	4,229,413.00	2.32
67	000581	威孚高科	4,138,122.20	2.27
68	603869	北部湾旅	4,108,880.50	2.25
69	002405	四维图新	4,105,171.50	2.25
70	000957	中通客车	4,052,696.00	2.22
71	600418	江淮汽车	4,005,512.00	2.20
72	300467	迅游科技	3,949,009.89	2.17
73	300347	泰格医药	3,914,880.05	2.15
74	300493	润欣科技	3,870,920.00	2.12
75	300133	华策影视	3,778,158.82	2.07
76	600166	福田汽车	3,704,908.98	2.03
77	002548	金新农	3,678,400.00	2.02
78	300017	网宿科技	3,671,528.00	2.01

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。

7.4.3 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	654,153,078.70
卖出股票收入（成交）总额	682,480,172.28

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。

7.5 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.

7.6 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：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

7.10.2 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	193,332.01
2	应收证券清算款	3,955,991.11
4	应收利息	4,514.14
5	应收申购款	99.85
9	合计	4,153,937.11

7.12.4 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。

7.12.5 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	002314	南山控股	4,428,160.00	3.14	重大事项
2	002347	泰尔重工	3,129,505.00	2.22	重大事项
3	000401	冀东水泥	2,954,220.00	2.09	重大事项

§8 基金份额持有人信息

8.1 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
1,001	162,863.19	52,052,871.87	31.93%	110,973,185.45	68.07%

8.2 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	688,749.46	0.4225%

8.3 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	10-50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 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	180,897,544.39
本报告期基金总申购份额	1,288,911.50
减:本报告期基金总赎回份额	19,160,398.57
本报告期期末基金份额总额	163,026,057.32

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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、经红土创新基金管理有限公司第一届董事会第九次会议决议审议通过，任命陈东先生为公司副总经理，2016 年 3 月 1 日公告。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
中信证券	2	235,743,642.52	17.64%	172,399.13	17.64%	-
银河证券	2	364,959,313.37	27.30%	266,895.05	27.30%	-
申万宏源	2	735,930,295.09	55.06%	538,185.06	55.06%	-

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。

10.7.2 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	-	-	760,000,000.00	14.30%	-	-
银河证券	-	-	1,638,000,000.00	30.83%	-	-
申万宏源	-	-	2,915,000,000.00	54.87%	-	-

§11 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。