

# 红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 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。

本报告期自 2016 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>6</b>
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
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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.....	10
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.....	11
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
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
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>12</b>
6.1 审计报告基本信息.....	12
6.2 审计报告的基本内容.....	12
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>14</b>
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
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	36
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	37
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46

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 .....	46
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 .....	46
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	47
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
8.12 投资组合报告附注 .....	47
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
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 .....	48
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
11.4 基金投资策略的改变 .....	49
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
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 .....	49
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
11.8 其他重大事件 .....	51
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</b>
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>51</b>
13.1 备查文件目录 .....	51
13.2 存放地点 .....	52
13.3 查阅方式 .....	52

## § 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	132,298,120.42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	田青
	联系电话	0755-33011878	010-67596096
	电子邮箱	zhangxc@htxfund.com	tianqingl.zh@ccb.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	北京市西城区金融大街 25 号

	区前湾一路 1 号 A 栋 201 室	
办公地址	深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	邵钢	王洪章

## 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	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	-26,036,274.70	1,005,428.18
本期利润	-27,962,081.94	3,263,562.44
加权平均基金份额本期利润	-0.1766	0.0151
本期加权平均净值利润率	-20.48%	1.48%
本期基金份额净值增长率	-16.67%	0.80%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-21,123,000.80	432,286.58
期末可供分配基金份额利润	-0.1597	0.0024
期末基金资产净值	111,175,119.62	182,330,402.62
期末基金份额净值	0.840	1.008
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-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。

4. 本基金合同生效日为 2015 年 09 月 23 日。

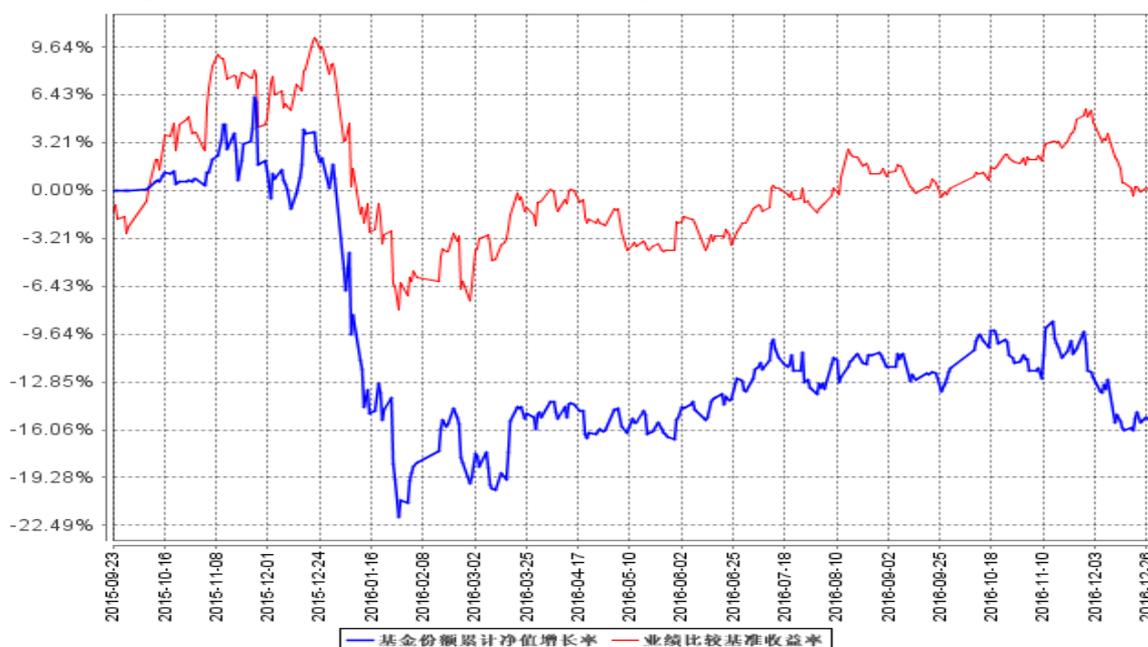
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-4.65%	0.84%	-0.08%	0.45%	-4.57%	0.39%
过去六个月	-3.00%	0.78%	2.32%	0.47%	-5.32%	0.31%
过去一年	-16.67%	1.13%	-7.23%	0.84%	-9.44%	0.29%
自基金合同生效起至今	-16.00%	1.09%	0.09%	0.88%	-16.09%	0.21%

#### 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

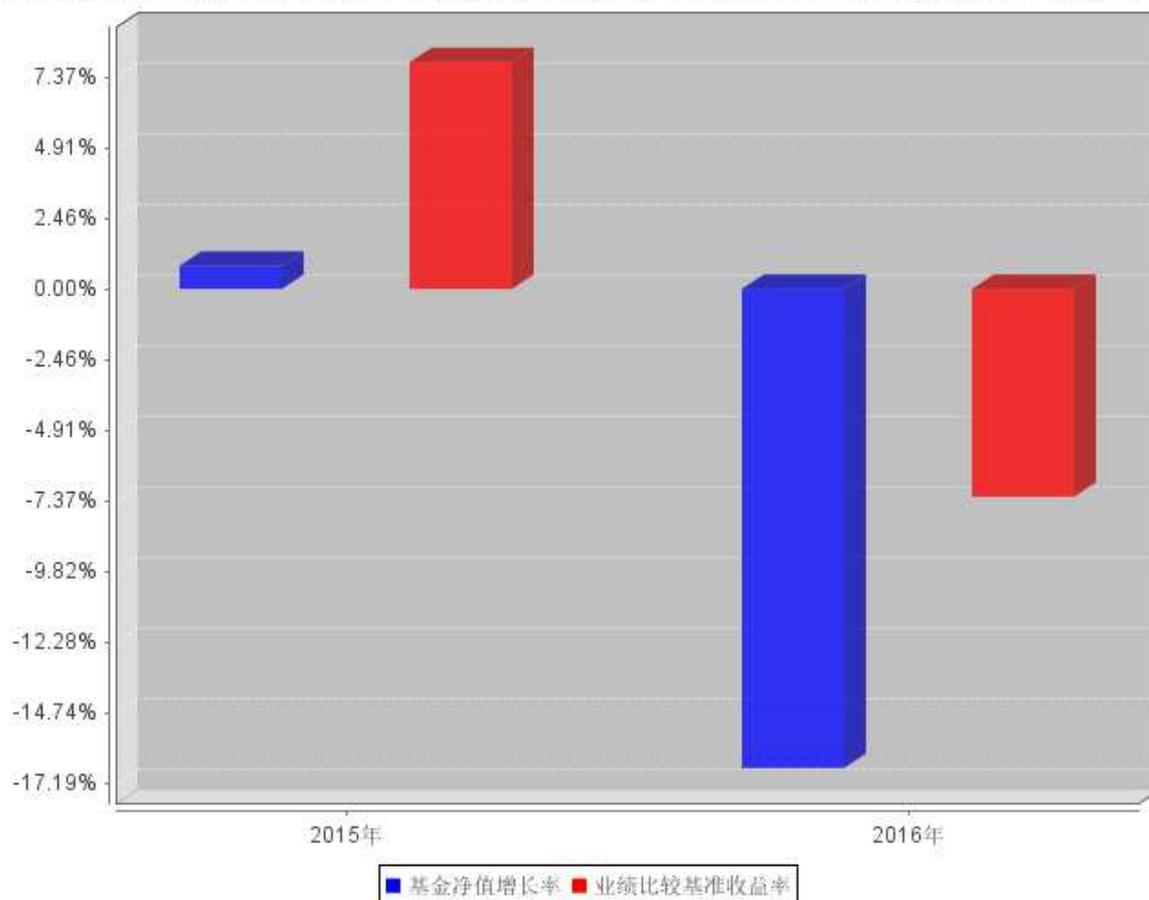
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注: 本基金合同生效日为 2015 年 09 月 23 日,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。

### 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

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		
侯世霞	基金经理	2015 年 9 月 23 日	-	7	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，上证综指下跌 12.31%，沪深 300 指数下跌 11.28%，创业板指数下跌 27.71%，市场整体大幅下跌，其中创业板跌幅最大。板块方面出现分化，中信 29 个一级行业中，只有食品饮料、家电、银行和煤炭指数涨幅为正，其他行业均出现不同程度下跌，其中以传媒、计算机、餐饮旅游等行业跌幅居前。

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，市场内部结构分化显著，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，但是以创业板为代表的新兴产业类个股跌幅较大，最终本基金收益率优于创业板指数，但低于主板涨幅。

### 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 0.840 元，累计单位净值为 0.840 元。报告期内本基金净值增长率为-16.67%，同期业绩基准增长率为-7.23%

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场在内外经济因素，流动性水平制约下，结构分化加剧。由于以煤炭，石油、有色金属为代表的上游周期品价格上涨，化工等中游行业产业价格大幅上行，带动企业盈利好转。并且在当前出现了较为显著的向下游传导的迹象。经济在各行各业补库存需求的拉动下，温和的复苏。但是由于 2017 年地产投资增速的不确定性较大，未来政策将在稳增长和调结构之间做出平衡。而 2016 年第四季度人民币出现大幅贬值，外汇管理压力成为多方考虑的焦点；不断上升的通胀压力会强化加息的预期。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 2017 年市场存在结构性机会，但需留意的是国内经济的再次探底风险。

放眼中长期，2017 年我国将进一步推进更多行业的供给侧改革，落后低效产能进一步出清，由于全社会库存仍然处于较低水平，补库存需求会客观的拉动需求的增长，企业盈利逐步改善，企业再投资意愿增强。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；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，消费的升级，将迅速而深刻地改变行业结构，伴随消费升级崛起的优质公司值得我们高度关注。传统行业通过对产能的升级改造，提升资产收益能力的领域，也是我们 2017 年重点关注的领域。

#### 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(2017)第 20368 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：	
引言段	我们审计了后附的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 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 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。	
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 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> <p>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>	
审计意见段	我们认为，上述红土创新新兴产业混合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新兴产业混合基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度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：红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	5,986,101.00	59,579,727.88
结算备付金		2,045,093.18	7,851,135.67
存出保证金		210,015.34	92,194.60
交易性金融资产	7.4.7.2	87,597,223.50	111,489,784.49
其中：股票投资		87,597,223.50	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	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	4,092,443.41
应收利息	7.4.7.5	4,239.63	17,644.93
应收股利		-	-
应收申购款		789.50	9,940.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		112,035,645.11	183,132,871.87
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 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		-	21,999.13
应付管理人报酬		143,840.84	244,441.65
应付托管费		23,973.47	40,740.27
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	507,711.18	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	7.4.7.8	185,000.00	79,055.26
负债合计		860,525.49	802,469.25
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	132,298,120.42	180,897,544.39
未分配利润	7.4.7.10	-21,123,000.80	1,432,858.23
所有者权益合计		111,175,119.62	182,330,402.62
负债和所有者权益总计		112,035,645.11	183,132,871.87

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.840 元，基金份额总额 132,298,120.42 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：2016 年 1 月 1 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 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 9 月 23 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-21,927,141.65	5,095,809.49
1. 利息收入		907,996.60	549,951.31
其中：存款利息收入	7.4.7.11	270,833.79	149,205.70
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		637,162.81	400,745.61
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-20,972,485.99	2,032,324.99
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-21,272,973.07	2,032,324.99
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	300,487.08	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,925,807.24	2,258,134.26
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	63,154.98	255,398.93
<b>减：二、费用</b>		6,034,940.29	1,832,247.05
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,052,292.42	901,478.27
2. 托管费	7.4.10.2.2	342,048.67	150,246.41

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	3,464,777.86	697,707.49
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	175,821.34	82,814.88
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-27,962,081.94	3,263,562.44
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-27,962,081.94	3,263,562.44

### 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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
五、期末所有者权益（基金净值）	132,298,120.42	-21,123,000.80	111,175,119.62
项目	上年度可比期间 2015 年 9 月 23 日（基金合同生效日）至 2015 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）	244,976,374.41	-	244,976,374.41
二、本期经营活动产生的	-	3,263,562.44	3,263,562.44

基金净值变动数（本期利润）			
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）	-64,078,830.02	-1,830,704.21	-65,909,534.23
其中：1. 基金申购款	5,718,345.02	91,377.76	5,809,722.78
2. 基金赎回款	-69,797,175.04	-1,922,081.97	-71,719,257.01
五、期末所有者权益（基金净值）	180,897,544.39	1,432,858.23	182,330,402.62

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>          范大鹏          </u>	<u>          张祥金          </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、衍生工具(权证、股指期货等)以及经中国证监会批准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%；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%。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。

## 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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。比较财务报表的实际编制期间为 2015 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2015 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[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。

### 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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	5,986,101.00	59,579,727.88
合计:	5,986,101.00	59,579,727.88

#### 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	87,264,896.48	87,597,223.50	332,327.02
合计	87,264,896.48	87,597,223.50	332,327.02
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	109,231,650.23	111,489,784.49	2,258,134.26
合计	109,231,650.23	111,489,784.49	2,258,134.26

#### 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	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

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	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,727.52	13,713.09

应收结算备付金利息	1,012.33	3,886.30
应收买入返售证券利息	395.83	-
其他	103.95	45.54
合计	4,239.63	17,644.93

#### 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	上年度末
	2016年12月31日	2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	507,711.18	416,232.94
合计	507,711.18	416,232.94

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015年12月31日
应付赎回费	-	55.26
预提信息披露费用	125,000.00	25,000.00
预提审计费用	60,000.00	54,000.00
合计	185,000.00	79,055.26

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	180,897,544.39	180,897,544.39
本期申购	1,899,208.89	1,899,208.89
本期赎回(以“-”号填列)	-50,498,632.86	-50,498,632.86
本期末	132,298,120.42	132,298,120.42

#### 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	432,286.58	1,000,571.65	1,432,858.23
本期利润	-26,036,274.70	-1,925,807.24	-27,962,081.94
本期基金份额交易产生的变动数	5,318,294.45	87,928.46	5,406,222.91
其中：基金申购款	-204,760.32	-45,918.00	-250,678.32
基金赎回款	5,523,054.77	133,846.46	5,656,901.23
本期末	-20,285,693.67	-837,307.13	-21,123,000.80

#### 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
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年9月23日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	192,144.12	111,064.14
结算备付金利息收入	75,487.39	37,993.77
其他	3,202.28	147.79
合计	270,833.79	149,205.70

#### 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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年9月23日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出股票成交总额	1,312,623,570.57	230,984,946.75
减：卖出股票成本总额	1,333,896,543.64	228,952,621.76
买卖股票差价收入	-21,272,973.07	2,032,324.99

#### 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1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年9月23日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	300,487.08	-
合计	300,487.08	-

**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1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年9月23日(基金合同生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,925,807.24	2,258,134.26
——股票投资	-1,925,807.24	2,258,134.26
合计	-1,925,807.24	2,258,134.26

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年9月23日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	63,154.98	255,398.93
合计	63,154.98	255,398.93

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1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年9月23日(基金合同生效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	3,464,777.86	697,707.49
合计	3,464,777.86	697,707.49

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 9 月 23 日(基金合同生 效日)至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	54,000.00
信息披露费	100,000.00	25,000.00
银行汇划费	15,821.34	3,414.88
其他	-	400.00
合计	175,821.34	82,814.88

### 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1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年9月23日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,052,292.42	901,478.27
其中：支付销售机构的客户维护费	798,479.29	415,250.98

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。

#### 7.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年9月23日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	342,048.67	150,246.41

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

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

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 2016年12月31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	37.84%	50,060,750.00	27.67%

**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1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年9月23日(基金合同生效日)至2015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	5,986,101.00	192,144.12	59,579,727.88	111,064.14

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**

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****7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金本报告期内无利润分配。

**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**

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
000563	陕国投A	2016年10月14日	重大资产重组	7.48	2017年1月18日	6.73	89,700	671,198.00	670,956.00	-

注：本基金截至 2016 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；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。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2015 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。

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独立的风险管理部门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，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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约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。

### 7.4.13.4 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、存出保证金及买入返售金融资产等。

#### **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
<b>资产</b>					
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
<b>资产总计</b>	<b>23,241,209.52</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>88,794,435.59</b>	<b>112,035,645.11</b>
<b>负债</b>					
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
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>860,525.49</b>	<b>860,525.49</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>23,241,209.52</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>87,933,910.10</b>	<b>111,175,119.62</b>
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	59,579,727.88	-	-	-	59,579,727.88
结算备付金	7,851,135.67	-	-	-	7,851,135.67
存出保证金	92,194.60	-	-	-	92,194.60
交易性金融资产				111,489,784.49	111,489,784.49
应收证券清算款	-	-	-	4,092,443.41	4,092,443.41
应收利息	-	-	-	17,644.93	17,644.93
应收申购款	-	-	-	9,940.89	9,940.89

资产总计	67,523,058.15	-	-	115,609,813.72	183,132,871.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	21,999.13	21,999.13
应付管理人报酬	-	-	-	244,441.65	244,441.65
应付托管费	-	-	-	40,740.27	40,740.27
应付交易费用	-	-	-	416,232.94	416,232.94
其他负债	-	-	-	79,055.26	79,055.26
负债总计	-	-	-	802,469.25	802,469.25
利率敏感度缺口	67,523,058.15	-	-	114,807,344.47	182,330,402.62

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

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 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（2015 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。本基金投资于股票占基金资产的比例为 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%；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%。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		上年度末 2015 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	87,597,223.50	78.79	111,489,784.49	61.15
合计	87,597,223.50	78.79	111,489,784.49	61.15

#### 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：人民币元)	
		本期末(2016 年 12 月 31 日)	上年度末(2015 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准上升 5%	4,360,000.00	-
2. 业绩比较基准下降 5%	-4,360,000.00	-	

注：本基金合同生效日为 2015 年 9 月 23 日，于 2015 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对于本基金 2015 年末资产净值的影响。

#### 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 86,926,267.50 元,属于第二层次的余额为 670,956.00 元,无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日:第一层次 111,489,784.49 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(2015 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)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	87,597,223.50	78.19
	其中:股票	87,597,223.50	78.19
5	买入返售金融资产	15,000,000.00	13.39
6	银行存款和结算备付金合计	8,031,194.18	7.17
7	其他各项资产	1,407,227.43	1.26
8	合计	112,035,645.11	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	32,029,364.00	28.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,258,409.50	11.93
E	建筑业	20,468,626.67	18.41
J	金融业	670,956.00	0.60
M	科学研究和技术服务业	3,291,912.00	2.96
N	水利、环境和公共设施管理业	17,877,955.33	16.08
	合计	87,597,223.50	78.79

### 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	000498	山东路桥	1,128,919	8,952,327.67	8.05
2	600110	诺德股份	564,900	6,021,834.00	5.42
3	000630	铜陵有色	1,714,800	5,281,584.00	4.75
4	601800	中国交建	325,900	4,950,421.00	4.45
5	000826	启迪桑德	138,800	4,577,624.00	4.12
6	300203	聚光科技	149,800	4,576,390.00	4.12
7	600323	瀚蓝环境	314,300	4,513,348.00	4.06
8	300070	碧水源	256,100	4,486,872.00	4.04
9	002573	清新环境	252,167	4,405,357.49	3.96
10	600617	国新能源	417,833	4,387,246.50	3.95
11	000669	金鸿能源	254,100	4,357,815.00	3.92
12	000059	华锦股份	317,900	3,783,010.00	3.40
13	002570	贝因美	267,400	3,508,288.00	3.16
14	300137	先河环保	228,100	3,330,260.00	3.00

15	300262	巴安水务	194,800	3,311,600.00	2.98
16	300284	苏交科	158,265	3,291,912.00	2.96
17	601668	中国建筑	367,300	3,254,278.00	2.93
18	600166	福田汽车	1,050,200	3,245,118.00	2.92
19	600691	阳煤化工	594,500	2,282,880.00	2.05
20	300172	中电环保	223,452	2,216,643.84	1.99
21	300190	维尔利	136,200	2,191,458.00	1.97
22	000563	陕国投 A	89,700	670,956.00	0.60

## 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	601699	潞安环能	21,162,860.51	11.61
2	000630	铜陵有色	21,102,837.00	11.57
3	002074	国轩高科	19,925,716.19	10.93
4	600362	江西铜业	18,816,103.00	10.32
5	000983	西山煤电	17,904,292.07	9.82
6	002371	七星电子	16,213,691.92	8.89
7	000937	冀中能源	15,309,982.32	8.40
8	002707	众信旅游	13,991,977.16	7.67
9	600110	诺德股份	13,644,751.96	7.48
10	002699	美盛文化	12,648,821.00	6.94
11	600328	兰太实业	12,564,087.29	6.89
12	600699	均胜电子	12,194,709.90	6.69
13	300236	上海新阳	12,166,908.62	6.67
14	300242	明家联合	11,642,245.00	6.39
15	600395	盘江股份	11,591,444.18	6.36
16	002714	牧原股份	11,316,248.88	6.21
17	002131	利欧股份	11,122,082.67	6.10
18	000878	云南铜业	10,990,361.36	6.03
19	000709	河钢股份	10,892,672.00	5.97
20	002156	通富微电	10,575,491.23	5.80
21	002185	华天科技	9,934,915.46	5.45
22	002456	欧菲光	9,884,573.25	5.42

23	002421	达实智能	9,837,429.37	5.40
24	001979	招商蛇口	9,815,848.79	5.38
25	600104	上汽集团	9,723,918.00	5.33
26	600489	中金黄金	9,604,828.00	5.27
27	000060	中金岭南	9,276,371.00	5.09
28	000050	深天马A	9,052,809.48	4.97
29	002674	兴业科技	9,021,648.03	4.95
30	600546	*ST山煤	8,812,039.00	4.83
31	300531	优博讯	8,809,076.00	4.83
32	300456	耐威科技	8,578,893.00	4.71
33	600006	东风汽车	8,509,774.20	4.67
34	600884	杉杉股份	8,468,989.59	4.64
35	600338	西藏珠峰	8,371,924.43	4.59
36	000498	山东路桥	8,281,828.33	4.54
37	002001	新和成	8,024,893.50	4.40
38	600882	广泽股份	8,020,149.64	4.40
39	300339	润和软件	7,991,934.30	4.38
40	600584	长电科技	7,955,155.00	4.36
41	600029	南方航空	7,942,132.69	4.36
42	601377	兴业证券	7,938,983.00	4.35
43	600547	山东黄金	7,749,895.00	4.25
44	600872	中炬高新	7,741,589.00	4.25
45	601688	华泰证券	7,570,557.92	4.15
46	300498	温氏股份	7,546,309.50	4.14
47	600987	航民股份	7,519,917.36	4.12
48	300166	东方国信	7,247,990.48	3.98
49	600166	福田汽车	7,235,727.00	3.97
50	600519	贵州茅台	7,137,838.99	3.91
51	300016	北陆药业	7,082,667.13	3.88
52	000807	云铝股份	7,012,357.00	3.85
53	300124	汇川技术	6,717,523.40	3.68
54	300340	科恒股份	6,657,274.00	3.65
55	000776	广发证券	6,496,772.35	3.56
56	601225	陕西煤业	6,430,542.13	3.53
57	600458	时代新材	6,415,191.00	3.52
58	000933	*ST神火	6,225,853.00	3.41

59	000606	*ST 易桥	6,212,337.68	3.41
60	002434	万里扬	6,197,867.16	3.40
61	300141	和顺电气	6,147,360.91	3.37
62	300442	普丽盛	6,135,440.92	3.37
63	300136	信维通信	6,086,284.25	3.34
64	603085	天成自控	6,033,295.00	3.31
65	002753	永东股份	5,822,106.75	3.19
66	600634	中技控股	5,822,077.00	3.19
67	300059	东方财富	5,779,140.00	3.17
68	000801	四川九洲	5,698,939.00	3.13
69	300011	鼎汉技术	5,692,864.36	3.12
70	002288	超华科技	5,674,941.00	3.11
71	002494	华斯股份	5,604,108.00	3.07
72	601898	中煤能源	5,588,638.00	3.07
73	002182	云海金属	5,586,782.21	3.06
74	002326	永太科技	5,580,312.00	3.06
75	300017	网宿科技	5,575,751.47	3.06
76	300068	南都电源	5,554,321.39	3.05
77	600633	浙报传媒	5,439,492.48	2.98
78	600120	浙江东方	5,345,042.00	2.93
79	600076	康欣新材	5,294,327.00	2.90
80	002305	南国置业	5,269,358.00	2.89
81	000568	泸州老窖	5,223,406.70	2.86
82	000960	锡业股份	5,197,424.00	2.85
83	600528	中铁二局	5,036,874.00	2.76
84	002366	台海核电	4,935,009.84	2.71
85	002405	四维图新	4,920,954.22	2.70
86	600183	生益科技	4,882,107.00	2.68
87	000971	高升控股	4,869,223.00	2.67
88	000925	众合科技	4,813,778.00	2.64
89	000596	古井贡酒	4,813,618.00	2.64
90	600499	科达洁能	4,801,944.00	2.63
91	601800	中国交建	4,742,836.00	2.60
92	300254	仟源医药	4,742,363.10	2.60
93	600999	招商证券	4,739,749.00	2.60
94	601318	中国平安	4,734,850.00	2.60

95	601628	中国人寿	4,713,460.60	2.59
96	002519	银河电子	4,519,569.40	2.48
97	600028	中国石化	4,506,482.00	2.47
98	002343	慈文传媒	4,499,961.82	2.47
99	600691	阳煤化工	4,496,914.00	2.47
100	000683	远兴能源	4,482,584.00	2.46
101	300203	聚光科技	4,478,227.44	2.46
102	300347	泰格医药	4,475,886.23	2.45
103	000669	金鸿能源	4,475,228.37	2.45
104	000957	中通客车	4,474,847.00	2.45
105	600617	国新能源	4,474,284.15	2.45
106	000826	启迪桑德	4,472,420.22	2.45
107	002573	清新环境	4,471,719.54	2.45
108	600323	瀚蓝环境	4,470,955.00	2.45
109	300070	碧水源	4,469,973.00	2.45
110	002180	艾派克	4,462,119.55	2.45
111	600172	黄河旋风	4,404,890.12	2.42
112	600031	三一重工	4,366,216.00	2.39
113	300493	润欣科技	4,358,102.00	2.39
114	300467	迅游科技	4,332,135.17	2.38
115	002458	益生股份	4,325,001.64	2.37
116	600188	兖州煤业	4,323,742.00	2.37
117	600178	东安动力	4,299,841.37	2.36
118	002347	泰尔重工	4,284,519.40	2.35
119	002609	捷顺科技	4,284,380.12	2.35
120	300365	恒华科技	4,282,710.00	2.35
121	600782	新钢股份	4,265,286.00	2.34
122	002314	南山控股	4,259,284.00	2.34
123	002241	歌尔股份	4,249,317.00	2.33
124	300398	飞凯材料	4,242,276.00	2.33
125	002121	科陆电子	4,220,400.00	2.31
126	002470	金正大	4,220,388.24	2.31
127	000902	新洋丰	4,219,356.91	2.31
128	600418	江淮汽车	4,215,973.50	2.31
129	000581	威孚高科	4,208,249.37	2.31
130	600297	广汇汽车	4,189,981.74	2.30

131	600497	驰宏锌锗	4,156,353.00	2.28
132	002671	龙泉股份	4,147,517.00	2.27
133	002773	康弘药业	4,117,197.67	2.26
134	002594	比亚迪	4,008,345.95	2.20
135	002407	多氟多	3,975,516.00	2.18
136	300014	亿纬锂能	3,973,872.00	2.18
137	002709	天赐材料	3,957,617.00	2.17
138	300474	景嘉微	3,947,874.00	2.17
139	002499	科林环保	3,861,555.00	2.12
140	000708	大冶特钢	3,814,719.35	2.09
141	600622	嘉宝集团	3,749,732.00	2.06
142	002547	春兴精工	3,718,083.56	2.04
143	000422	湖北宜化	3,667,432.00	2.01
144	601669	中国电建	3,666,316.00	2.01
145	600179	*ST 黑化	3,656,664.00	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	601699	潞安环能	21,568,918.86	11.83
2	002074	国轩高科	19,374,627.52	10.63
3	000983	西山煤电	19,363,845.62	10.62
4	600362	江西铜业	18,793,603.00	10.31
5	002699	美盛文化	16,774,956.29	9.20
6	000937	冀中能源	16,211,174.71	8.89
7	002371	七星电子	15,839,327.72	8.69
8	000630	铜陵有色	15,428,393.00	8.46
9	002707	众信旅游	14,372,715.38	7.88
10	002519	银河电子	13,677,842.16	7.50
11	600328	兰太实业	12,879,027.49	7.06
12	600699	均胜电子	12,713,874.63	6.97
13	300236	上海新阳	12,383,388.00	6.79
14	300242	明家联合	11,896,268.59	6.52
15	000709	河钢股份	11,473,941.00	6.29

16	002131	利欧股份	11,377,796.87	6.24
17	600395	盘江股份	11,323,847.62	6.21
18	002714	牧原股份	10,622,416.46	5.83
19	002156	通富微电	10,525,442.90	5.77
20	002456	欧菲光	10,524,522.62	5.77
21	000878	云南铜业	10,413,529.00	5.71
22	002185	华天科技	10,287,474.91	5.64
23	002674	兴业科技	10,285,370.69	5.64
24	002421	达实智能	10,258,770.00	5.63
25	600104	上汽集团	9,868,853.12	5.41
26	000060	中金岭南	9,403,269.00	5.16
27	600489	中金黄金	9,343,814.32	5.12
28	600006	东风汽车	9,300,566.26	5.10
29	000050	深天马A	9,231,770.00	5.06
30	001979	招商蛇口	9,186,236.22	5.04
31	600338	西藏珠峰	8,992,558.29	4.93
32	600546	*ST山煤	8,850,180.79	4.85
33	300160	秀强股份	8,703,881.13	4.77
34	002343	慈文传媒	8,694,435.75	4.77
35	600884	杉杉股份	8,671,874.00	4.76
36	300531	优博讯	8,604,909.00	4.72
37	300339	润和软件	8,598,304.59	4.72
38	600882	广泽股份	8,166,561.64	4.48
39	600987	航民股份	8,064,236.68	4.42
40	002654	万润科技	7,995,625.00	4.39
41	601377	兴业证券	7,991,586.00	4.38
42	002001	新和成	7,948,029.82	4.36
43	600584	长电科技	7,919,395.49	4.34
44	600110	诺德股份	7,886,480.00	4.33
45	300456	耐威科技	7,774,935.00	4.26
46	600547	山东黄金	7,690,041.00	4.22
47	600029	南方航空	7,643,620.45	4.19
48	600519	贵州茅台	7,486,258.90	4.11
49	600872	中炬高新	7,384,711.16	4.05
50	300016	北陆药业	7,271,503.00	3.99
51	601688	华泰证券	7,265,888.96	3.99
52	600622	嘉宝集团	7,196,095.30	3.95
53	300166	东方国信	7,082,448.88	3.88

54	300124	汇川技术	7,052,895.57	3.87
55	002434	万里扬	7,031,046.85	3.86
56	300498	温氏股份	6,982,169.00	3.83
57	000776	广发证券	6,660,033.24	3.65
58	000933	*ST 神火	6,605,438.90	3.62
59	002183	怡亚通	6,570,368.00	3.60
60	300136	信维通信	6,524,468.23	3.58
61	600458	时代新材	6,524,458.00	3.58
62	601225	陕西煤业	6,502,317.37	3.57
63	600633	浙报传媒	6,464,479.70	3.55
64	002314	南山控股	6,455,010.08	3.54
65	300340	科恒股份	6,351,257.21	3.48
66	000807	云铝股份	6,305,388.90	3.46
67	603085	天成自控	6,189,948.00	3.39
68	300199	翰宇药业	6,072,607.97	3.33
69	000606	*ST 易桥	6,052,595.00	3.32
70	300141	和顺电气	6,043,883.60	3.31
71	600634	中技控股	6,041,176.36	3.31
72	300017	网宿科技	5,992,734.00	3.29
73	002288	超华科技	5,884,296.98	3.23
74	300059	东方财富	5,882,206.47	3.23
75	002326	永太科技	5,880,609.00	3.23
76	300182	捷成股份	5,756,748.00	3.16
77	601898	中煤能源	5,736,870.03	3.15
78	000801	四川九洲	5,603,846.12	3.07
79	300011	鼎汉技术	5,577,508.77	3.06
80	002182	云海金属	5,508,298.00	3.02
81	002494	华斯股份	5,419,594.00	2.97
82	600120	浙江东方	5,379,826.00	2.95
83	300068	南都电源	5,376,709.73	2.95
84	300442	普丽盛	5,361,716.00	2.94
85	000971	高升控股	5,285,108.00	2.90
86	600178	东安动力	5,273,770.00	2.89
87	002347	泰尔重工	5,266,757.77	2.89
88	000568	泸州老窖	5,185,777.00	2.84
89	000960	锡业股份	5,138,609.82	2.82
90	002305	南国置业	5,065,622.52	2.78
91	002180	艾派克	5,063,403.06	2.78

92	002753	永东股份	5,060,746.45	2.78
93	000925	众合科技	4,977,608.78	2.73
94	600999	招商证券	4,955,289.00	2.72
95	600183	生益科技	4,841,702.45	2.66
96	002366	台海核电	4,817,843.25	2.64
97	002405	四维图新	4,807,128.50	2.64
98	600528	中铁二局	4,786,633.00	2.63
99	600499	科达洁能	4,772,991.51	2.62
100	600172	黄河旋风	4,727,229.66	2.59
101	300254	仟源医药	4,702,031.50	2.58
102	300365	恒华科技	4,694,220.76	2.57
103	600028	中国石化	4,610,750.00	2.53
104	002458	益生股份	4,606,861.00	2.53
105	601318	中国平安	4,521,009.34	2.48
106	000683	远兴能源	4,490,017.00	2.46
107	002547	春兴精工	4,464,354.83	2.45
108	600076	康欣新材	4,453,583.00	2.44
109	601628	中国人寿	4,442,170.00	2.44
110	600188	兖州煤业	4,422,412.60	2.43
111	002241	歌尔股份	4,403,271.00	2.41
112	000902	新洋丰	4,381,321.00	2.40
113	000596	古井贡酒	4,347,617.17	2.38
114	002345	潮宏基	4,335,969.00	2.38
115	002609	捷顺科技	4,318,841.00	2.37
116	600497	驰宏锌锗	4,318,265.00	2.37
117	002671	龙泉股份	4,307,047.73	2.36
118	600031	三一重工	4,293,440.00	2.35
119	002121	科陆电子	4,251,598.00	2.33
120	600782	新钢股份	4,236,287.50	2.32
121	002773	康弘药业	4,233,685.00	2.32
122	002470	金正大	4,229,413.00	2.32
123	000581	威孚高科	4,138,122.20	2.27
124	603869	北部湾旅	4,108,880.50	2.25
125	002709	天赐材料	4,087,583.75	2.24
126	000957	中通客车	4,052,696.00	2.22
127	600297	广汇汽车	4,007,053.00	2.20
128	600418	江淮汽车	4,005,512.00	2.20
129	300467	迅游科技	3,949,009.89	2.17

130	002499	科林环保	3,935,070.00	2.16
131	002594	比亚迪	3,925,054.63	2.15
132	300347	泰格医药	3,914,880.05	2.15
133	300398	飞凯材料	3,898,151.00	2.14
134	300493	润欣科技	3,870,920.00	2.12
135	002407	多氟多	3,834,553.70	2.10
136	300502	新易盛	3,820,524.00	2.10
137	300014	亿纬锂能	3,805,806.00	2.09
138	300133	华策影视	3,778,158.82	2.07
139	300474	景嘉微	3,777,754.00	2.07
140	600166	福田汽车	3,704,908.98	2.03
141	002548	金新农	3,678,400.00	2.02
142	601669	中国电建	3,669,264.00	2.01
143	603338	浙江鼎力	3,655,266.60	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	1,311,929,789.89
卖出股票收入（成交）总额	1,312,623,570.57

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

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

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	210,015.34
2	应收证券清算款	1,192,182.96
4	应收利息	4,239.63
5	应收申购款	789.50
9	合计	1,407,227.43

**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
892	148,316.28	52,052,871.87	39.35%	80,245,248.55	60.65%

**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	253,043.90	0.1913%

**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	10-50
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	180,897,544.39
本报告期基金总申购份额	1,899,208.89

减:本报告期基金总赎回份额	50,498,632.86
本报告期期末基金份额总额	132,298,120.42

## § 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。

### 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	2	528,071,542.86	20.12%	386,178.25	20.12%	-
银河证券	2	1,040,658,158.34	39.65%	761,031.38	39.65%	-
申万宏源	2	1,055,815,169.26	40.23%	772,117.87	40.23%	-

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	-	-	960,000,000.00	11.53%	-	-
银河证券	-	-	3,921,000,000.00	47.08%	-	-
申万宏源	-	-	3,447,000,000.00	41.39%	-	-

## 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

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)

红土创新基金管理有限公司  
2017 年 3 月 28 日