

红土创新定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度 报告

2017-06-30

基金管理人：红土创新基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2017-08-26

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

[重要提示](#)

[基金简介](#)

[基金基本情况](#)

[基金产品说明](#)

[基金管理人和基金托管人](#)

[信息披露方式](#)

[其他相关资料](#)

[主要财务指标和基金净值表现](#)

[主要会计数据和财务指标](#)

[基金净值表现](#)

[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](#)

[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](#)

[管理人报告](#)

[基金管理人及基金经理情况](#)

[基金管理人及其管理基金的经验](#)

[基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介](#)

[管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明](#)

[管理人对报告期内公平交易情况的专项说明](#)

[公平交易制度的执行情况](#)

[异常交易行为的专项说明](#)

[管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明](#)

[报告期内基金投资策略和运作分析](#)

[报告期内基金的业绩表现](#)

[管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望](#)

[管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明](#)

[管理人对报告期内基金利润分配情况的说明](#)

[管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明](#)

[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](#)

[托管人报告](#)

[报告期内本基金托管人遵规守信情况声明](#)

[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](#)

托管人对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

半年度财务会计报告（未经审计）

资产负债表

利润表

所有者权益（基金净值）变动表

报表附注

基金基本情况

会计报表的编制基础

遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

重要会计政策和会计估计

会计年度

记账本位币

金融资产和金融负债的分类

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债的估值原则

金融资产和金融负债的抵销

实收基金

损益平准金

收入/(损失)的确认和计量

费用的确认和计量

基金的收益分配政策

分部报告

其他重要的会计政策和会计估计

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

会计政策变更的说明

会计估计变更的说明

差错更正的说明

税项

重要财务报表项目的说明

银行存款

衍生金融资产/负债

买入返售金融资产

各项买入返售金融资产期末余额

期末买断式逆回购交易中取得的债券

应收利息

其他资产

应付交易费用

其他负债

实收基金

未分配利润

存款利息收入

股票投资收益

股票投资收益——买卖股票差价收入

债券投资收益

债券投资收益项目构成

债券投资收益——买卖债券差价收入

债券投资收益——赎回差价收入

债券投资收益——申购差价收入

资产支持证券投资收益

衍生工具收益

衍生工具收益——买卖权证差价收入

衍生工具收益——其他投资收益

股利收益

公允价值变动收益

其他收入

交易费用

其他费用

分部报告

或有事项、资产负债表日后事项的说明

或有事项

资产负债表日后事项

关联方关系

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

本报告期与基金发生关联交易的各关联方

本报告期及上年度可比期间的关联方交易

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

权证交易

应支付关联方的佣金

关联方报酬

基金管理费

基金托管费

销售服务费

与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

各关联方投资本基金的情况

报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

其他关联交易事项的说明

利润分配情况

利润分配情况——非货币市场基金

期末本基金持有的流通受限证券

因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

期末持有的暂时停牌等流通受限股票

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

银行间市场债券正回购

交易所市场债券正回购

金融工具风险及管理
风险管理政策和组织架构
信用风险
按短期信用评级列示的债券投资
按长期信用评级列示的债券投资
流动性风险
金融资产和金融负债的到期期限分析
市场风险
利率风险
利率风险敞口
利率风险的敏感性分析
外汇风险
外汇风险敞口
外汇风险的敏感性分析
其他价格风险
其他价格风险敞口
其他价格风险的敏感性分析
采用风险价值法管理风险
有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
投资组合报告
期末基金资产组合情况
报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末按行业分类的股票投资组合
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
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
报告期内股票投资组合的重大变动
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
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
买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
期末按债券品种分类的债券投资组合
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细
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
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金投资股指期货的投资政策
报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本期国债期货投资政策
报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本期国债期货投资评价
投资组合报告附注
本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明
基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

期末其他各项资产构成
期末持有的处于转股期的可转换债券明细
期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
投资组合报告附注的其他文字描述部分
基金份额持有人信息
期末基金份额持有人户数及持有人结构
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
发起式基金发起资金持有份额情况
重大事件揭示
基金份额持有人大会决议
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
涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
基金投资策略的改变
为基金进行审计的会计师事务所情况
管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
基金租用证券公司交易单元的有关情况
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
其他重大事件
重大事件揭示
基金份额持有人大会决议
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
涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
基金投资策略的改变
为基金进行审计的会计师事务所情况
管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
基金租用证券公司交易单元的有关情况
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
其他重大事件
影响投资者决策的其他重要信息
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
影响投资者决策的其他重要信息
备查文件目录
备查文件目录
存放地点
查阅方式

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金名称

红土创新定增灵活配置混合型证券投资基金

基金简称

红土创新定增混合

场内简称

红土定增

基金主代码

168401

基金运作方式

上市契约型封闭式

基金合同生效日

2016-12-30

基金管理人

红土创新基金管理有限公司

基金托管人

中国工商银行股份有限公司

报告期末基金份额总额

210,524,085.37

基金合同存续期

基金产品说明

投资目标

基于对宏观经济、资本市场的深入分析和理解，在基金合同生效后 24 个月（含 24 个月）内，通过对定向增发项目的深入研究，利用定向增发项目的事件性特征与折价优势，优选能够改善、提升企业基本面与经营状况的定向增发股票以及具有定增概念的股票进行投资；本基金合同生效 24 个月后，转为上市开放式基金（LOF），通过深度挖掘中国经济战略转型过程中产生的各类投资机遇，精选具有估值优势和成长优势的公司股票进行投资，力争获取超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略

本基金在基金合同生效后 24 个月（含 24 个月），通过对宏观经济，行业分析轮动效应与定向增发项目优势的深入研究的基础上，利用定向增发项目的事件性特征与折价优势，优选能够改善、提升企业基本面与经营状况的定向增发股票进行投资。将定向增发改善企业基本面与产业结构作为投资主线，形成以定向增发主题为核心的投资策略。

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。

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

中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人

姓名

张洗尘

洪渊

联系电话

0755-33011878

010-66105799

电子邮箱

zhangxc@htcxfund.com

custody@icbc.com.cn

客户服务电话

0755-33011866

95588

传真

0755-33011855

010-66105798

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

北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址

深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦6楼

北京市西城区复兴门内大街55号

邮政编码

518048

100140

法定代表人

邵钢

易会满

信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称

上海证券报

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址

<http://www.htcxfund.com>

基金年度报告备置地点

基金管理人及基金托管人住所

其他相关资料

项目

名称

办公地址

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

主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

报告期

报告期(2017-01-01 至 2017-06-30)

本期已实现收益

3,776,481.03

本期利润

3,298,400.51

加权平均基金份额本期利润

0.0157

本期加权平均净值利润率

1.55 %

本期基金份额净值增长率

1.57 %

报告期末

报告期末(2017-06-30)

期末可供分配利润

3,300,958.94

期末可供分配基金份额利润

0.0157

期末基金资产净值

213,825,044.31

期末基金份额净值

1.0157

报告期末

报告期末(2017-06-30)

基金份额累计净值增长率

1.57 %

注：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 2016 年 12 月 30 日。

基金净值表现

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

净值增长率①

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

0.87 %

0.27 %

3.33 %

0.40 %

-2.46 %

-0.13 %

过去三个月

-0.67 %

0.29 %

3.26 %

0.38 %

-3.93 %

-0.09 %

过去六个月

1.57 %

0.24 %

5.40 %

0.35 %

-3.83 %

-0.11 %

自基金合同生效起至今

1.57 %

0.23 %

5.50 %

0.35 %

-3.93 %

-0.12 %

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：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。

基金管理人及基金经理情况

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1.5亿元人民币，

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 6 月 30 日，红土创新基金共管理三只开放式基金，资产管理规模 3.50 亿元。

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期限

证券从业年限

说明

任职日期

离任日期

徐雄晖

基金经理

2016-12-30

-

8

中国人民大学经济学学士、北京大学经济学硕士。八年证券从业经验，历任大成基金研究员、基金经理助理、基金经理。现担任“红土创新定增灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。

管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《红土创新定增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。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。

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。

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%。

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

报告期内基金投资策略和运作分析

上半年经济有所回落，受市场监管和金融去杠杆的影响，市场分化明显。上证指数略微下跌 0.9%，但创业板指数下跌接近 5%，金融、家电、白酒表现较好，壳资源、次新股是下跌重灾区。定增减持新规的变化，对于我们的定增投资产生了较大的影响，我们也在积极思考如何适应新的市场变化。

报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金的份额净值为 1.0157 元，累计份额净值为 1.0157 元。报告期内本基金净值增长率为 1.57%，同期业绩基准增长率为 5.40%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过上半年的调整，目前市场整体估值明显回落，大致处于历史平均估值附近，可以以积极的心态寻找投资机会。随着“漂亮 50”股价的持续上涨，市场对业绩和估值的关注度也日渐提高，我们判断后续行情大概率会逐步向各细分行业龙头演绎。寻找各细分领域内，市值不大，具有显著竞争优势的企业，是我们下一阶段投资的重点。后续的定增，我们将基于这一思路，以绝对收益为导向，积极寻找估值合理的投资标的，力争为持有人获取长期稳健的超额收益。

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。

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。

管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

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。

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对红土创新定增灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，红土创新定增灵活配置混合型证券投资基金的管理人——红土创新基金管理有限公司在红土创新定增灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，红土创新定增灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

托管人对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

本托管人依法对红土创新基金管理有限公司编制和披露的红土创新定增灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

资产负债表

会计主体：红土创新定增灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017-06-30

单位：人民币元

资产

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

资产：

银行存款

6,583,063.94

210,414,551.43

结算备付金

12,416,637.00

-

存出保证金

38,400.92

-

交易性金融资产

26,290,430.02

-

其中：股票投资

26,290,430.02

-

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

156,000,000.00

-

应收证券清算款

12,918,275.59

-

应收利息

-48,807.18

12,624.87
应收股利
-
-
应收申购款
-
-
递延所得税资产
-
-
其他资产
60,000.00
109,533.94
资产总计
214,258,000.29
210,536,710.24
负债和所有者权益
本期末
2017-06-30
上年度末
2016-12-31
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
-
-
应付赎回款
-
-
应付管理人报酬
262,520.91
8,628.38
应付托管费

43,753.49
1,438.06
应付销售服务费
-
-
应付交易费用
47,340.23
-
应交税费
-
-
应付利息
-
-
应付利润
-
-
递延所得税负债
-
-
其他负债
79,341.35
-
负债合计
432,955.98
10,066.44
所有者权益：
-
-
实收基金
210,524,085.37
210,524,085.37
未分配利润
3,300,958.94
2,558.43
所有者权益合计
213,825,044.31
210,526,643.80
负债和所有者权益总计
214,258,000.29
210,536,710.24

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0157 元，基金份额总额 210,524,085.37 份。

利润表

会计主体：红土创新定增灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017-01-01 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

-至-

一、收入

5,396,343.79

-

1.利息收入

2,537,773.34

-

其中：存款利息收入

132,246.78

-

 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

2,405,526.56

-

 其他利息收入

-

-

2.投资收益（损失以“-”填列）

3,336,334.27

-

其中：股票投资收益

3,252,855.12

-

 基金投资收益

-

-

 债券投资收益

-

-

 资产支持证券投资收益

2,509.33

-

贵金属投资收益
-
-
衍生工具收益
-
-
股利收益
80,969.82
-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）
-478,080.52
-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）
-
-
5.其他收入（损失以“-”号填列）
316.70
-
减：二、费用
2,097,943.28
-
1. 管理人报酬
1,583,947.53
-
2. 托管费
263,991.23
-
3. 销售服务费
-
-
4. 交易费用
170,016.17
-
5. 利息支出
-
-
其中：卖出回购金融资产支出
-
-
6. 其他费用
79,988.35
-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）
3,298,400.51

-
减：所得税费用

-
-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）

3,298,400.51

-

注：注：本基金合同生效日为2016年12月30日,无上年同期对比数据。

所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：红土创新定增灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017-01-01至2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01至2017-06-30

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）

210,524,085.37

2,558.43

210,526,643.80

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

3,298,400.51

3,298,400.51

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）

-
-
-

其中：1.基金申购款

-
-
-

2.基金赎回款

-
-
-

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）

210,524,085.37

3,300,958.94

213,825,044.31

项目

上年度可比期间

-至-

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）

-

-

-

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（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）

-

-

-

其中：1.基金申购款

-

-

-

2.基金赎回款

-

-

-

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）

210,524,085.37

2,558.43

210,526,643.80

注：本基金合同生效日为 2016 年 12 月 30 日。

本报告第 6.1 页至第 6.4 页财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨兵 主管会计工作负责人：范大鹏 会计机构负责人：张祥金

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

报表附注

基金基本情况

红土创新定增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[2016]2470号《关于准予红土创新定增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《红土创新定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型封闭式,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 210,413,011.48 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(2016)第 1744 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《红土创新定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 210,524,085.37 份基金份额,其中认购资金利息折合 111,073.89 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新定增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、超短期融资券、地方政府债、债券回购等)、货币市场工具、银行存款、资产支持证券、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:基金合同生效后 24 个月(含 24 个月),股票占基金资产的比例为 0-100%;定增股票资产占非现金资产的比例不低于 80%;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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。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。本基金转为上市开放式基金(LOF)后,股票资产占基金资产的比例为 0%-95%;投资转型精选类公司的证券占非现金资产的比例不低于 80%;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,保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。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 8 月 26 批准报出。

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》、《红土创新定增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。

遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 1 月 1 日至 2017 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 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。

重要会计政策和会计估计

-

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。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日。

记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

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。

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。

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。

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。

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。

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)。

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。

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。

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。

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。

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和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券,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。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供,本基金本报告期内没有持有银行间同业市场交易的债券品种

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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。

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。

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。

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。

重要财务报表项目的说明

银行存款

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

活期存款

6,583,063.94

-

定期存款

-

-

其中：存款期限 1-3 个月

-

-

其他存款

-

-

合计

6,583,063.94

210,414,551.43

交易性金融资产

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

成本

公允价值

公允价值变动

股票

26,774,201.66

26,290,430.02

-483,771.64

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

26,774,201.66

26,290,430.02

-483,771.64

项目

上年度末

2016-12-31

成本

公允价值

公允价值变动

股票

-

-

-

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

-

-

-

衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

合同/名义金额

公允价值

备注

资产

负债

利率衍生工具

-

-

-

-

货币衍生工具

-

-

-

-

权益衍生工具

-

-

-

-

其他衍生工具

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

项目

上年度末

2016-12-31

合同/名义金额

公允价值

备注

资产

负债

利率衍生工具

-

-

-

-

货币衍生工具

-

-

-

-

权益衍生工具

-

-

-

-

其他衍生工具

-

-

-

-

合计

-
-
-
-

注：注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

买入返售金融资产

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

2017-06-30

账面余额

其中：买断式逆回购

买入返售证券

156,000,000.00

-

合计

156,000,000.00

-

项目

上年度末

2016-12-31

账面余额

其中：买断式逆回购

期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

债券代码

债券名称

约定返售日

估值单价

数量（张）

估值总额

其中：已出售或再质押总额

项目

上年度末

2016-12-31

债券代码

债券名称

约定返售日

估值单价

数量（张）

估值总额

其中：已出售或再质押总额

注：无。

应收利息

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

应收活期存款利息

3,339.39

-

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

5,587.50

-

应收债券利息

-

-

应收买入返售证券利息

-57,751.37

-

应收申购款利息

-

-

应收黄金合约拆借孳息

-

-

其他

17.30

-

合计

-48,807.18

12,624.87

注：附注：本基金 2017 年 6 月 30 日应收买入返售证券利息为负数，系 2017 年 5 月 22 日起沪深交易所买入返售改变计息方式所致，实际到期后应收返售证券利息为正数。

其他资产

单位：人民币元

项目
本期末
2017-06-30
上年度末
2016-12-31
其他应收款

-
-
待摊费用
60,000.00

-
合计
60,000.00
109,533.94

应付交易费用
单位：人民币元

项目
本期末
2017-06-30
上年度末
2016-12-31

交易所市场应付交易费用
47,340.23

-
银行间市场应付交易费用

-
-
合计
47,340.23

-
其他负债
单位：人民币元

项目
本期末
2017-06-30
上年度末
2016-12-31

应付券商交易单元保证金

-
-
应付赎回费

-
-
预提费用

79,341.35

-

合计

79,341.35

-

实收基金

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

基金份额（份）

账面金额

上年度末

210,524,085.37

210,524,085.37

本期申购

-

-

本期赎回（以“-”号填列）

-

-

本期末

210,524,085.37

210,524,085.37

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

2,558.43

-

2,558.43

本期利润

3,776,481.03

-478,080.52

3,298,400.51

本期基金份额交易产生的变动数

-

-

-

其中：基金申购款

-

-

-

基金赎回款

-

-

-

本期已分配利润

-

-

-

本期末

3,779,039.46

-478,080.52

3,300,958.94

存款利息收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

-至-

活期存款利息收入

44,816.14

-

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

87,225.22

-

其他

205.42

-

合计

132,246.78

-

股票投资收益

股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

-至-

卖出股票成交总额

63,045,820.66

-

减：卖出股票成本总额

59,792,965.54

-

买卖股票差价收入

3,252,855.12

-

债券投资收益

债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

-至-

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入

-

-

债券投资收益——赎回差价收入

-

-

债券投资收益——申购差价收入

-

-

合计

-

-

注：注：本基金本报告期无债券投资收益。

债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

-至-

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额

-

-

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额

-

-

减：应收利息总额

-

-

买卖债券差价收入

-

-

债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

-至-

赎回基金份额对价总额

-

-

减：现金支付赎回款总额

-

-

减：赎回债券成本总额

-

-

减：赎回债券应收利息总额

-

-

赎回差价收入

-

-

债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

-至-

申购基金份额对价总额

-

-

减：现金支付申购款总额

-

-

减：申购债券成本总额

-

-

减：申购债券应收利息总额

-

-

申购差价收入

-

-

资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

-至-

卖出资产支持证券成交总额

-

-

减：卖出资产支持证券成本总额

-

-

减：应收利息总额

-

-

资产支持证券投资收益

2,509.33

-

注：注：本基金本报告期无资产支持证券

衍生工具收益

衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

-至-

卖出权证成交总额

-

-

减：卖出权证成本总额

-

-

买卖权证差价收入

-

-
衍生工具收益——其他投资收益

项目

本期收益金额

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间收益金额

-至-

权证投资收益

-

-

股指期货-投资收益

-

-

股利收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

-至-

股票投资产生的股利收益

76,484.20

-

基金投资产生的股利收益

4,485.62

-

合计

80,969.82

-

公允价值变动收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

-至-

1.交易性金融资产

-478,080.52

-

——股票投资

-483,771.64

-

——债券投资

-

-
——资产支持证券投资

-

-

——基金投资

5,691.12

-

——贵金属投资

-

-

——其他

-

-

2.衍生工具

-

-

——权证投资

-

-

3.其他

-

-

合计

-478,080.52

-

其他收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

-至-

基金赎回费收入

316.70

-

合计

316.70

-

注：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。

交易费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间
-至-
交易所市场交易费用
170,016.17

-
银行间市场交易费用
-
-
合计
170,016.17

-
其他费用
单位：人民币元

项目
本期
2017-01-01 至 2017-06-30
上年度可比期间

-至-
审计费用
29,752.78

-
信息披露费
49,588.57

-
银行汇划费
247.00

-
其他
400.00

-
合计
79,988.35

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。

或有事项、资产负债表日后事项的说明

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。

资产负债表日后事项

截至本财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

关联方关系

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

中国工商银行

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：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。

本报告期及上年度可比期间的关联方交易

注：无。

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

-至-

成交金额

占当期股票成交总额的比例

成交金额

占当期股票成交总额的比例

权证交易

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

-至-

成交金额

占当期股票成交总额的比例

成交金额

占当期股票成交总额的比例

应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

当期佣金

占当期佣金总量的比例

期末应付佣金余额

占期末应付佣金总额的比例

关联方名称

上年度可比期间

-至-

当期佣金

占当期佣金总量的比例

期末应付佣金余额

占期末应付佣金总额的比例

关联方报酬

基金管理费

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

-至-

当期发生的基金应支付的管理费

1,583,947.53

-

其中：支付销售机构的客户维护费

616,321.46

-

注：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。

基金托管费

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

-至-

当期发生的基金应支付的托管费

263,991.23

-

注：注：支付基金托管人中国工商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。

销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

当期发生的基金应支付的销售服务费

获得销售服务费的各关联方名称

上年度可比期间

-至-

当期应支付的销售服务费

注：注：无。

与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

银行间市场交易的各关联方名称

债券交易金额

基金逆回购

基金正回购

基金买入

基金卖出

交易金额

利息收入

交易金额

利息支出

上年度可比期间

-至-

银行间市场交易的各关联方名称

债券交易金额

基金逆回购

基金正回购

基金买入

基金卖出

交易金额

利息收入

交易金额

利息支出

注：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。

各关联方投资本基金的情况

报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

-至-

基金合同生效日（2016-12-30）持有的基金份额

-
-

报告期初持有的基金份额

-
-

报告期间申购/买入总份额

-
-

报告期间因拆分变动份额

-
-

减：期间赎回/卖出总份额

-
-

报告期末持有的基金份额

-
-

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例

-%

-%

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

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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

注：本报告期内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

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

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

-至-

期末余额

当期利息收入

期末余额

当期利息收入

中国工商银行

6,583,063.94

44,816.14

-

-

注：注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

关联方名称

证券代码

证券名称

发行方式

基金在承销期内买入

数量（单位：股/张）

总金额

上年度可比期间

-至-

关联方名称

证券代码

证券名称

发行方式

基金在承销期内买入

数量（单位：股/张）

总金额

注：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。

其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

利润分配情况

利润分配情况——非货币市场基金

单位：人民币元

序号

权益登记日

除息日

每 10 份基金份额分红数

现金形式发放总额

再投资形式发放总额

本期利润分配合计

备注

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

期末（2017-06-30）本基金持有的流通受限证券

因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

受限证券类别：股票

证券代码

证券名称

成功认购日

可流通日

流通受限类型

认购价格

期末估值单价

数量（单位：股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

300118

东方日升

2017-04-11

-

非公开发行流通受限

14.06

14.05

1,361,626

19,144,461.56

19,130,845.30

-

受限证券类别：债券

证券代码

证券名称

成功认购日

可流通日

流通受限类型

认购价格

期末估值单价

数量（单位：股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

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

600277

亿利洁能

-

临时停牌

7.16

-

-

999,942

7,629,740.10

7,159,584.72

-

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

银行间市场债券正回购

-

金额单位：人民币元

债券代码

债券名称

回购到期日

期末估值单价

数量（张）

期末估值总额

注：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。

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。

金融工具风险及管理

-

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，建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、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董事会下设立风险控制委员会，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分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工

作。

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工商银行，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。

本报告期，本基金未持有交易性债券投资。

按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

A-1

-

-

A-1 以下

-

-

未评级

-

-

合计

-

-

注： 无

按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

AAA

-

-

AAA 以下

-

-

未评级

-
-
合计
-
-

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、组合在短期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，均能根据本基金的基金管理人的投资意图以合理的价格适时变现。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 2017 年 6 月 30 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。

金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末

2017-06-30

合计

资产

资产总计

-

负债

负债总计

-

流动性净额

-

上年度末

2016-12-31

合计

资产

资产总计

-

负债
负债总计

-
流动性净额

-
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。

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。

利率风险敞口

单位：人民币元

本期末

2017-06-30

1 个月以内

不计息

合计

资产

银行存款

6,583,063.94

-

6,583,063.94

结算备付金

12,416,637.00

-

12,416,637.00

存出保证金

38,400.92

-

38,400.92

交易性金融资产

-

26,290,430.02

26,290,430.02

买入返售金融资产

156,000,000.00

-

156,000,000.00
应收证券清算款
-
12,918,275.59
12,918,275.59
应收利息
-
-48,807.18
-48,807.18
其他资产
-
60,000.00
60,000.00
资产总计
175,038,101.86
39,219,898.43
214,258,000.29
负债
应付管理人报酬
-
262,520.91
262,520.91
应付托管费
-
43,753.49
43,753.49
应付交易费用
-
47,340.23
47,340.23
其他负债
-
79,341.35
79,341.35
负债总计
-
432,955.98
432,955.98
利率敏感度缺口
175,038,101.86
38,786,942.45
213,825,044.31
上年度末
2016-12-31

1 个月以内	
不计息	
合计	
资产	
银行存款	
	210,414,551.43
-	
	210,414,551.43
应收利息	
-	
	12,624.87
	12,624.87
其他资产	
-	
	109,533.94
	109,533.94
资产总计	
	210,414,551.43
	122,158.81
	210,536,710.24
负债	
应付管理人报酬	
-	
	8,628.38
	8,628.38
应付托管费	
-	
	1,438.06
	1,438.06
其他负债	
-	
-	
-	
负债总计	
-	
	10,066.44
	10,066.44
利率敏感度缺口	
	210,414,551.43
	112,092.37
	210,526,643.80

注：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。

利率风险的敏感性分析

假设

-

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

2017-06-30

上年度末

-

注：注：2017年6月30日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。

外汇风险敞口

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

美元折合人民币

港币折合人民币

其他币种折合人民币

合计

以外币计价的资产

资产合计

-

-

-

-

以外币计价的负债

负债合计

-

-

-

-

资产负债表外汇风险敞口净额

-

-

-

-

项目

上期末

-

美元折合人民币

港币折合人民币
其他币种折合人民币
合计
以外币计价的资产
资产合计

-
-
-
-

以外币计价的负债
负债合计

-
-
-
-

资产负债表外汇风险敞口净额

-
-
-
-

外汇风险的敏感性分析
假设

-

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

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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%**；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。

其他价格风险敞口	
金额单位：人民币元	
项目	
本期末	
2017-06-30	
上年度末	
-	
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	
26,290,430.02	
12.30	
-	
-	
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	
26,290,430.02	
12.30	

-

-

其他价格风险的敏感性分析

假设

除业绩比较基准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

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

1.业绩比较基准上升 5%

1,310,000.00

-

2.业绩比较基准下降 5%

-1,310,000.00

-

注：注：本基金合同生效日为 2016 年 12 月 30 日，于 2017 年 6 月 30 日，本基金成立尚
未满足一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对于本基金本期末资产净值的影响。

采用风险价值法管理风险

-

假设

-

-

分析

风险价值（金额单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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 6 月 30 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 26,290,430.02 元，无属于第二层次和第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(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6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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。

期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号

项目

金额（元）

占基金总资产的比例（%）

1

权益类投资

26,290,430.02

12.27

其中：股票

26,290,430.02

12.27

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

156,000,000.00

72.81

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

18,999,700.94

8.87

7

其他各项资产

12,967,869.33

6.05

8

合计

214,258,000.29

100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的股票投资组合

代码

行业类别

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

A

农、林、牧、渔业

-

-

B

采矿业

-

-

C

制造业

26,290,430.02

12.30

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

-

-

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

-

-

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

-

-

O

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

26,290,430.02

12.30

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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（元）

占基金资产净值比例（%）

1

300118

东方日升

1,361,626

19,130,845.30

8.95

2

600277

亿利洁能

999,942

7,159,584.72

3.35

报告期内股票投资组合的重大变动

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

300118

东方日升

19,144,461.56

9.09

2

600109

国金证券

12,910,800.00

6.13

3

300219

鸿利智汇

12,801,987.00

6.08

4

000651

格力电器

10,641,012.28

5.05

5

601377

兴业证券

10,552,094.66

5.01

6

600261

阳光照明

9,771,836.60

4.64

7

600277

亿利洁能

7,629,740.10

3.62

8

601328

交通银行

2,088,000.00

0.99

9

000001

平安银行

1,006,000.00

0.48

10

603881

数据港

15,600.00

0.01

11

601881

中国银河

13,620.00

0.01

12

601228

广州港

4,580.00

0.00

13

002839

张家港行

4,370.00

0.00

14

300643

万通智控

4,300.00

0.00

注：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。

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

300219

鸿利智汇

14,007,666.35

6.65

2

000651

格力电器

13,745,240.62

6.53

3

600109

国金证券
11,674,062.69
5.55
4
601377
兴业证券
10,419,825.72
4.95
5
600261
阳光照明
9,809,205.28
4.66
6
601328
交通银行
2,293,100.00
1.09
7
000001
平安银行
1,007,600.00
0.48
8
603881
数据港
54,080.00
0.03
9
601881
中国银河
12,110.00
0.01
10
601228
广州港
9,330.00
0.00
11
300643
万通智控
9,065.00
0.00
12

002839

张家港行

4,535.00

0.00

注：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。

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

67,401,470.64

卖出股票收入（成交）总额

63,045,820.66

注：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。

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。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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。

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

序号

贵金属代码

贵金属名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值

公允价值变动

风险说明

公允价值变动总额合计

-

股指期货投资本期收益

-

股指期货投资本期公允价值变动

-

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

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。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险指标说明

公允价值变动总额合计(元)

-

国债期货投资本期收益（元）

-

国债期货投资本期公允价值变动(元)

-

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

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。

投资组合报告附注

本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

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。

基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

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

38,400.92

2

应收证券清算款

12,918,275.59

3

应收股利

-

4
应收利息
-48,807.18
5
应收申购款
-
6
其他应收款
-
7
待摊费用
60,000.00
8
其他
-
9
合计
12,967,869.33

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。

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

300118

东方日升

19,130,845.30

8.95

非公开发行

2

600277

亿利洁能

7,159,584.72

3.35

临时停牌

投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

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

2,696

78,087.57

2,122,770.00

1.01 %

208,401,315.37

98.99 %

期末上市基金前十名持有人

序号

持有人名称

持有份额（份）

占上市总份额比例

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金

-

本基金基金经理持有本开放式基金

-

发起式基金发起资金持有份额情况

项目

持有份额总数

持有份额占基金总份额比例

发起份额总数

发起份额占基金总份额比例

发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金

-

-%

-

-%

-

基金管理人高级管理人员

-

-%

-

-%

-

基金经理等人员

-

-%

-

-%

-

基金管理人股东

-

-%

-

-%

-

其他

-

-%

-

-%

-

合计

-

-%

-

-%

-

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。

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十三次会议决议审议通过，免除杨兵先生副总经理职务，改任公司总经理，2017年1月25日公告。

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。

基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

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。

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。

基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
基金交易	
债券交易	
债券回购交易	
权证交易	
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	
成交金额	
占当期基金成交总额的比例	
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	
佣金	
占当期佣金总量的比例	
信达证券	
2	
34,944,574.41	
26.79 %	
-	
-%	
-	
-%	
2,718,600,000.00	
17.46 %	
-	
-%	
25,555.43	
26.89 %	
-	
中信证券	
2	
95,502,716.89	
73.21 %	
-	
-%	
-	
-%	
12,854,000,000.00	
82.54 %	

-
-%

69,465.00

73.11 %

-
注：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。 -

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调整旗下部分基金单笔申购最低金额及赎回持有最低份额的公告

证券时报、中国证券报

2017-01-17

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

2017-01-25

3

红土创新基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告

上海证券报

2017-04-13

4

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

上海证券报

2017-04-25

5

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

中国证券报

2017-06-10

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

-

-

-

-

-

-

-

-

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；本基金合同生效日 24 个月内属于封闭期，不得申购赎回，暂无巨额赎回风险。

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。

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定增灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- (2) 《红土创新定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《红土创新定增灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《红土创新定增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) 报告期内红土创新定增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。

存放地点

深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 楼

查阅方式

公司网站：www.htcxfund.com