

红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资 基金 2017 年年度报告摘要

2017 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 27 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 2018 年 3 月 23 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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§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 | 104,245,484.09 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@htcfund.com | tianqingl.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

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

§ 3 主要财务指标、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 | 2017 年 | 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 | 9,167,091.32 | -26,036,274.70 | 1,005,428.18 |
| 本期利润 | 13,532,243.58 | -27,962,081.94 | 3,263,562.44 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1103 | -0.1766 | 0.0151 |
| 本期基金份额净值增长率 | 11.90% | -16.67% | 0.80% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017 年末 | 2016 年末 | 2015 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0800 | -0.1597 | 0.0024 |
| 期末基金资产净值 | 97,998,042.67 | 111,175,119.62 | 182,330,402.62 |
| 期末基金份额净值 | 0.940 | 0.840 | 1.008 |

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。

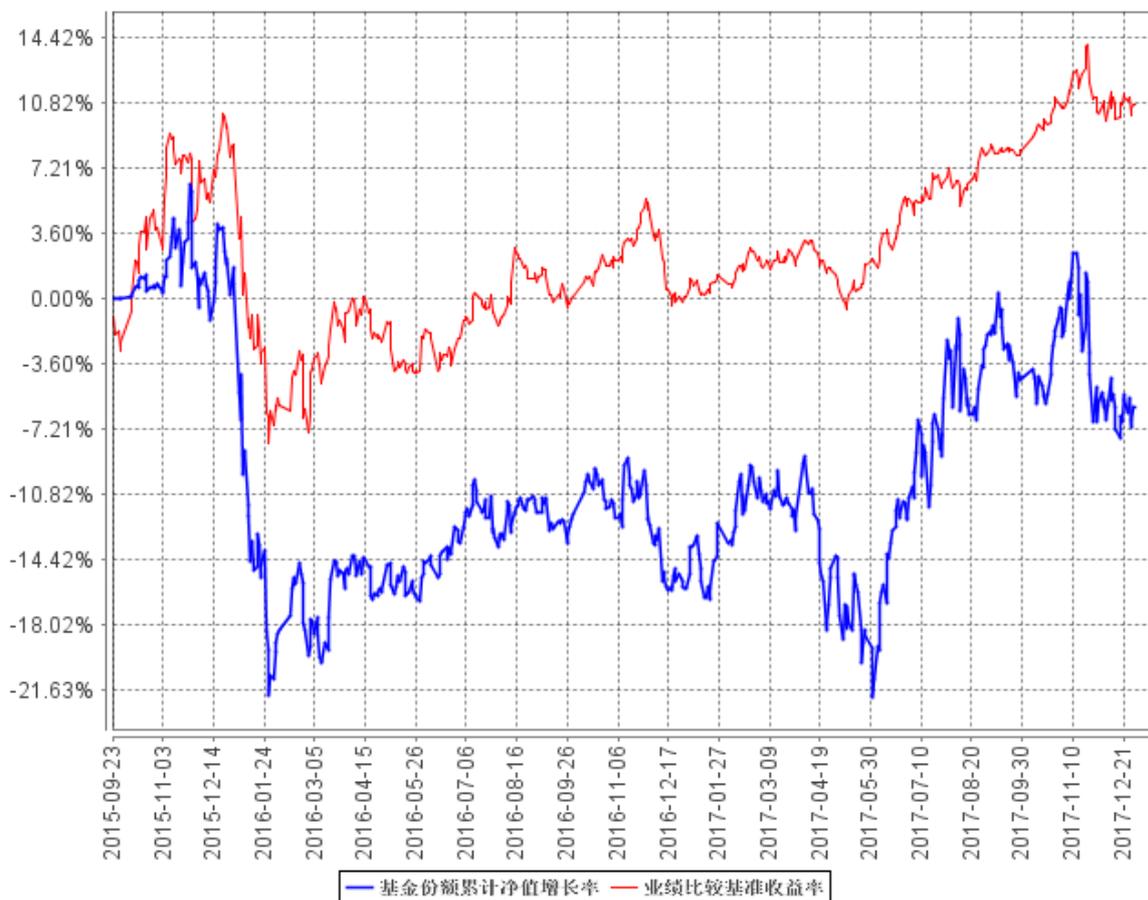
3.2 基金净值表现

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 | -1.67% | 1.29% | 2.33% | 0.48% | -4.00% | 0.81% |
| 过去六个月 | 5.62% | 1.40% | 4.96% | 0.42% | 0.66% | 0.98% |
| 过去一年 | 11.90% | 1.33% | 10.63% | 0.38% | 1.27% | 0.95% |
| 自基金合同 生效起至今 | -6.00% | 1.21% | 10.73% | 0.70% | -16.73% | 0.51% |

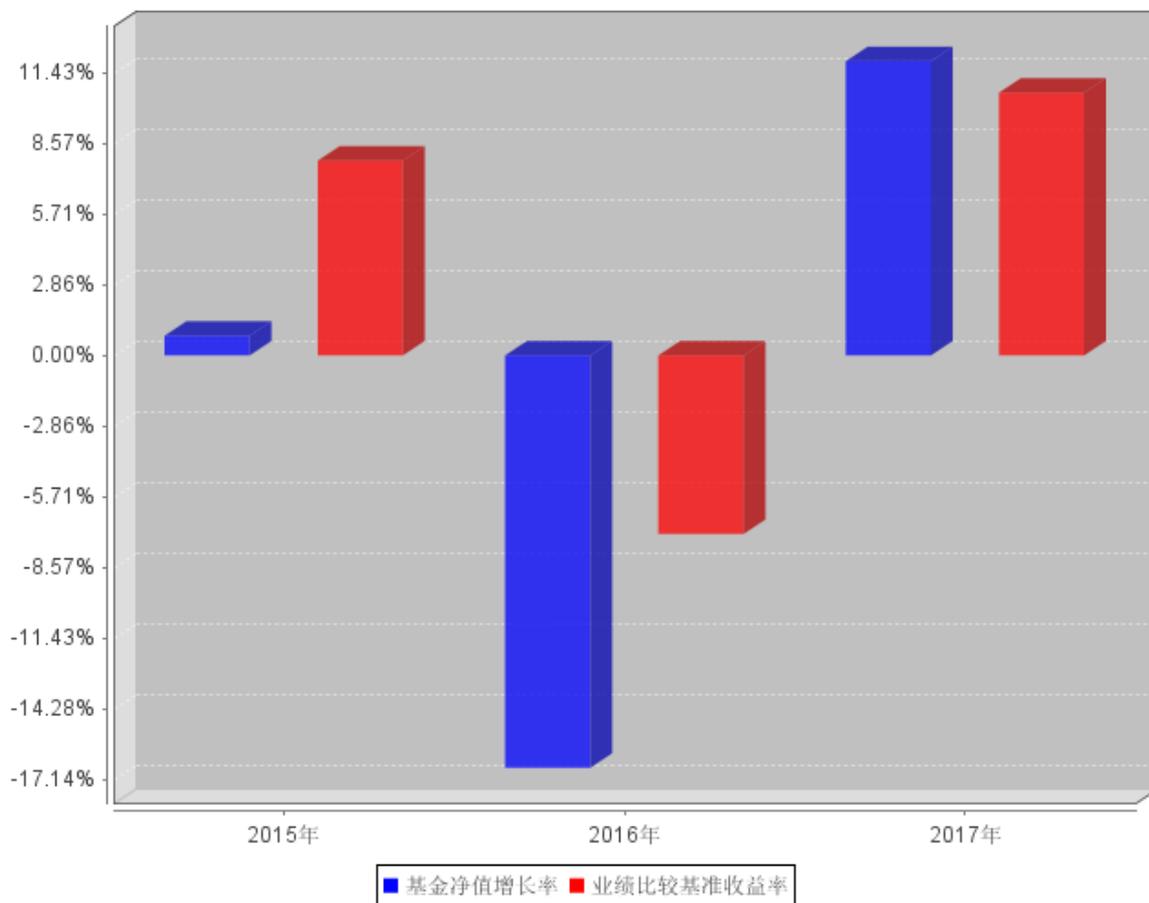
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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

注：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 12 月 31 日，红土创新基金共管理五只公募基金，资产管理规模 40.78 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 | - | 8 | 兰州大学 MBA。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、红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。 |

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

2017 年，上证综指上涨 6.56%，沪深 300 指数上涨 21.77%，创业板指数下跌 10.67%，代表全市场的 Wind 全 A 指数上涨 4.93%，指数之间涨跌幅严重分化。板块方面，中信 29 个一级行业中，15 个行业实现不同程度的上涨，14 个行业下跌。食品饮料、家电、煤炭涨幅居前；服装纺织、传媒、计算机和军工大幅下跌。

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。虽然 2017 年代表新兴产业的创业板指数全年下跌，但是我们优先配置了电子、新能源汽车和通信方向，做出了独立正确的配置选择。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日为止，本基金的单位净值为 0.940 元，累计单位净值为 0.940 元。报告期内本基金净值增长率为 11.90%，同期业绩基准增长率为 10.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年全年，A 股市场受企业盈利增长的支撑，同时受到流动性紧缩的制约，一部分业绩确定性强的行业和公司获得了较高的溢价，而既往增速较快，但是估值较高的行业和公司遭遇了估值的下调，最终表现出来的就是板块间的极度分化。

对于 2018 年全年来看，经济增速相对于 2017 年大概率下行，通胀压力渐显，叠加去杠杆，整体投资环境更加严峻。但是由于全球经济的同步复苏，外需支撑了出口的不断超预期，以及国内三四线城市货币化棚改的持续推进，经济向下的支撑强劲。随着行业结构在落后产能出清后好转，企业盈利逐步改善，企业再投资意愿增强，制造业 ROE 将持续改善，中国制造从求数量阶段进入求质量阶段，必将涌现大批的世界级的优秀公司。当全社会收入水平达到一定程度之后，人对于自身的消费的需求也更加重视品质的提升，伴随消费升级崛起的优质公司值得我们高度关注。新能源汽车在逐步走上市场化发展的道路，供应链经过长期的竞争优胜劣汰之后，优质公司会进入份额扩张期，带来盈利和估值的双升。

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

本报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于红土创新基金管理有限公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§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：2017年12月31日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2017年12月31日 | 上年度末 2016年12月31日 |
|-----------------|----------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 10,182,241.07 | 5,986,101.00 |
| 结算备付金 | 706,790.94 | 2,045,093.18 |
| 存出保证金 | 149,696.70 | 210,015.34 |
| 交易性金融资产 | 87,790,851.02 | 87,597,223.50 |
| 其中：股票投资 | 87,790,851.02 | 87,597,223.50 |
| 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 | - | 15,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | 1,192,182.96 |
| 应收利息 | 2,694.61 | 4,239.63 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 4,092.52 | 789.50 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 98,836,366.86 | 112,035,645.11 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2017年12月31日 | 上年度末 2016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 | - | - |
| 应付赎回款 | 32,950.78 | - |
| 应付管理人报酬 | 125,013.34 | 143,840.84 |
| 应付托管费 | 20,835.54 | 23,973.47 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 374,465.87 | 507,711.18 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 285,058.66 | 185,000.00 |
| 负债合计 | 838,324.19 | 860,525.49 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 104,245,484.09 | 132,298,120.42 |
| 未分配利润 | -6,247,441.42 | -21,123,000.80 |
| 所有者权益合计 | 97,998,042.67 | 111,175,119.62 |
| 负债和所有者权益总计 | 98,836,366.86 | 112,035,645.11 |

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.940 元，基金份额总额 104,245,484.09 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |
|-------------------|---|--|
| 一、收入 | 18,510,314.46 | -21,927,141.65 |
| 1. 利息收入 | 227,246.96 | 907,996.60 |
| 其中：存款利息收入 | 127,835.66 | 270,833.79 |
| 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 | 99,411.30 | 637,162.81 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 13,806,644.13 | -20,972,485.99 |
| 其中：股票投资收益 | 13,296,282.07 | -21,272,973.07 |
| 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 | 510,362.06 | 300,487.08 |

| | | |
|----------------------------|----------------------|-----------------------|
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 4,365,152.26 | -1,925,807.24 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 111,271.11 | 63,154.98 |
| 减：二、费用 | 4,978,070.88 | 6,034,940.29 |
| 1. 管理人报酬 | 1,674,185.31 | 2,052,292.42 |
| 2. 托管费 | 279,030.81 | 342,048.67 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 2,844,500.96 | 3,464,777.86 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 180,353.80 | 175,821.34 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 13,532,243.58 | -27,962,081.94 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 13,532,243.58 | -27,962,081.94 |

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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） | 132,298,120.42 | -21,123,000.80 | 111,175,119.62 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 13,532,243.58 | 13,532,243.58 |
| 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） | -28,052,636.33 | 1,343,315.80 | -26,709,320.53 |
| 其中：1. 基金申购款 | 20,028,130.62 | -1,016,151.93 | 19,011,978.69 |
| 2. 基金赎回款 | -48,080,766.95 | 2,359,467.73 | -45,721,299.22 |
| 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） | 104,245,484.09 | -6,247,441.42 | 97,998,042.67 |
| 项目 | 上年度可比期间 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 |
| 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） | 132,298,120.42 | -21,123,000.80 | 111,175,119.62 |

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>杨兵</u> | <u>焦小川</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 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。

7.4.2 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(“红土创新”) | 基金管理人、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。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.3.1 关联方报酬

7.4.3.1.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,674,185.31 | 2,052,292.42 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 437,987.73 | 798,479.29 |

注：支付基金管理人红土创新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 X 1.50% / 当年天数。

7.4.3.1.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 279,030.81 | 342,048.67 |

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。

7.4.3.1.3 销售服务费

注：无。

7.4.3.2 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。

7.4.3.3 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：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。

7.4.3.3.2 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 2017 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2016 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 | 48.0200% | 50,060,750.00 | 37.8400% |

7.4.3.4 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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 | 10,182,241.07 | 104,259.54 | 5,986,101.00 |

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。

7.4.3.5 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。

7.4.3.6 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。

7.4.4 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.4.2 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 |
|--------|------|-----------------|------|--------|------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 002507 | 涪陵榨菜 | 2017 年 12 月 4 日 | 重大事项 | 17.94 | - | - | 290,150 | 4,519,898.64 | 5,205,291.00 | - |

注：本基金截至 2017 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。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 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。

7.4.4.3.2 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。

7.4.5 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 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 82,585,560.02 元，属于第二层次的余额为 5,205,291.00 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 86,926,267.50 元，第二层次 670,956.00 元，无属于第三层次的余额)。

(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，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 2017 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(2016 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂

适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，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 | 87,790,851.02 | 88.82 |
| | 其中：股票 | 87,790,851.02 | 88.82 |
| 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 | - | - |
| | 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 | 10,889,032.01 | 11.02 |
| 7 | 其他各项资产 | 156,483.83 | 0.16 |
| 8 | 合计 | 98,836,366.86 | 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 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 4,562,728.00 | 4.66 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 59,308,953.60 | 60.52 |
| 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 | 9,113,035.00 | 9.30 |
| 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 | 9,875,133.00 | 10.08 |
| 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 | 4,931,001.42 | 5.03 |
| 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 | 87,790,851.02 | 89.58 |

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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 | 002024 | 苏宁易购 | 741,500 | 9,113,035.00 | 9.30 |
| 2 | 002456 | 欧菲科技 | 364,500 | 7,505,055.00 | 7.66 |
| 3 | 000725 | 京东方 A | 1,244,800 | 7,207,392.00 | 7.35 |
| 4 | 300136 | 信维通信 | 116,558 | 5,909,490.60 | 6.03 |
| 5 | 002507 | 涪陵榨菜 | 290,150 | 5,205,291.00 | 5.31 |
| 6 | 002475 | 立讯精密 | 216,100 | 5,065,384.00 | 5.17 |
| 7 | 600048 | 保利地产 | 355,900 | 5,035,985.00 | 5.14 |
| 8 | 000888 | 峨眉山 A | 457,846 | 4,931,001.42 | 5.03 |
| 9 | 000002 | 万科 A | 155,800 | 4,839,148.00 | 4.94 |
| 10 | 603517 | 绝味食品 | 117,700 | 4,639,734.00 | 4.73 |

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 | 603993 | 洛阳钼业 | 49,963,122.00 | 44.94 |
| 2 | 603799 | 华友钴业 | 45,196,124.00 | 40.65 |
| 3 | 002340 | 格林美 | 18,336,219.10 | 16.49 |
| 4 | 600366 | 宁波韵升 | 17,075,695.00 | 15.36 |
| 5 | 600362 | 江西铜业 | 16,209,330.78 | 14.58 |
| 6 | 002456 | 欧菲科技 | 16,163,309.72 | 14.54 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 7 | 002466 | 天齐锂业 | 15,889,858.00 | 14.29 |
| 8 | 002460 | 赣锋锂业 | 15,356,309.40 | 13.81 |
| 9 | 600383 | 金地集团 | 14,985,888.03 | 13.48 |
| 10 | 600048 | 保利地产 | 14,925,679.88 | 13.43 |
| 11 | 000059 | 华锦股份 | 13,777,336.00 | 12.39 |
| 12 | 601233 | 桐昆股份 | 13,759,696.03 | 12.38 |
| 13 | 600183 | 生益科技 | 13,601,531.62 | 12.23 |
| 14 | 600110 | 诺德股份 | 11,968,195.67 | 10.77 |
| 15 | 000823 | 超声电子 | 11,851,536.65 | 10.66 |
| 16 | 300037 | 新宙邦 | 11,818,843.90 | 10.63 |
| 17 | 600109 | 国金证券 | 11,595,665.00 | 10.43 |
| 18 | 002024 | 苏宁云商 | 11,014,250.00 | 9.91 |
| 19 | 600019 | 宝钢股份 | 10,713,637.20 | 9.64 |
| 20 | 000725 | 京东方A | 10,694,741.00 | 9.62 |
| 21 | 000970 | 中科三环 | 10,654,299.00 | 9.58 |
| 22 | 000807 | 云铝股份 | 10,403,816.20 | 9.36 |
| 23 | 603808 | 歌力思 | 10,362,080.90 | 9.32 |
| 24 | 300700 | 岱勒新材 | 10,083,169.15 | 9.07 |
| 25 | 000333 | 美的集团 | 9,880,370.00 | 8.89 |
| 26 | 000651 | 格力电器 | 9,874,016.00 | 8.88 |
| 27 | 600029 | 南方航空 | 9,520,856.00 | 8.56 |
| 28 | 601111 | 中国国航 | 9,502,020.00 | 8.55 |
| 29 | 601669 | 中国电建 | 9,338,818.00 | 8.40 |
| 30 | 600115 | 东方航空 | 9,247,066.00 | 8.32 |
| 31 | 603186 | 华正新材 | 9,241,658.00 | 8.31 |
| 32 | 002051 | 中工国际 | 9,228,778.38 | 8.30 |
| 33 | 600685 | 中船防务 | 9,097,935.44 | 8.18 |
| 34 | 600967 | 内蒙一机 | 9,040,526.00 | 8.13 |
| 35 | 002074 | 国轩高科 | 8,731,025.00 | 7.85 |
| 36 | 002555 | 三七互娱 | 8,566,964.00 | 7.71 |
| 37 | 300461 | 田中精机 | 8,350,820.00 | 7.51 |
| 38 | 600392 | 盛和资源 | 8,283,624.00 | 7.45 |
| 39 | 300115 | 长盈精密 | 8,004,489.83 | 7.20 |
| 40 | 000831 | 五矿稀土 | 7,689,368.00 | 6.92 |
| 41 | 600111 | 北方稀土 | 7,671,301.00 | 6.90 |
| 42 | 600068 | 葛洲坝 | 7,516,180.00 | 6.76 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 43 | 000002 | 万 科 A | 7,388,394.00 | 6.65 |
| 44 | 300554 | 三超新材 | 7,233,669.00 | 6.51 |
| 45 | 300577 | 开润股份 | 7,008,578.40 | 6.30 |
| 46 | 000878 | 云南铜业 | 6,878,383.00 | 6.19 |
| 47 | 600745 | 闻泰科技 | 6,693,581.00 | 6.02 |
| 48 | 000933 | 神火股份 | 6,675,435.00 | 6.00 |
| 49 | 603305 | 旭升股份 | 6,192,740.00 | 5.57 |
| 50 | 002867 | 周大生 | 6,110,500.00 | 5.50 |
| 51 | 600585 | 海螺水泥 | 6,090,003.00 | 5.48 |
| 52 | 000065 | 北方国际 | 5,985,731.00 | 5.38 |
| 53 | 600801 | 华新水泥 | 5,980,847.31 | 5.38 |
| 54 | 601668 | 中国建筑 | 5,974,549.00 | 5.37 |
| 55 | 600426 | 华鲁恒升 | 5,912,618.00 | 5.32 |
| 56 | 000060 | 中金岭南 | 5,862,713.00 | 5.27 |
| 57 | 300059 | 东方财富 | 5,851,379.52 | 5.26 |
| 58 | 600872 | 中炬高新 | 5,844,543.00 | 5.26 |
| 59 | 603228 | 景旺电子 | 5,843,217.00 | 5.26 |
| 60 | 000538 | 云南白药 | 5,732,109.00 | 5.16 |
| 61 | 300618 | 寒锐钴业 | 5,703,794.46 | 5.13 |
| 62 | 600887 | 伊利股份 | 5,664,584.47 | 5.10 |
| 63 | 600259 | 广晟有色 | 5,647,555.00 | 5.08 |
| 64 | 601628 | 中国人寿 | 5,620,355.00 | 5.06 |
| 65 | 600398 | 海澜之家 | 5,434,194.00 | 4.89 |
| 66 | 002507 | 涪陵榨菜 | 5,317,482.00 | 4.78 |
| 67 | 000338 | 潍柴动力 | 5,258,066.00 | 4.73 |
| 68 | 002539 | 云图控股 | 5,126,160.00 | 4.61 |
| 69 | 002475 | 立讯精密 | 5,043,026.00 | 4.54 |
| 70 | 300136 | 信维通信 | 5,029,125.64 | 4.52 |
| 71 | 002304 | 洋河股份 | 4,860,890.00 | 4.37 |
| 72 | 600808 | 马钢股份 | 4,845,916.00 | 4.36 |
| 73 | 002142 | 宁波银行 | 4,787,950.00 | 4.31 |
| 74 | 300602 | 飞荣达 | 4,776,601.00 | 4.30 |
| 75 | 600076 | 康欣新材 | 4,735,605.00 | 4.26 |
| 76 | 601996 | 丰林集团 | 4,735,102.00 | 4.26 |
| 77 | 000910 | 大亚圣象 | 4,734,574.00 | 4.26 |
| 78 | 600172 | 黄河旋风 | 4,717,785.00 | 4.24 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 79 | 000761 | 本钢板材 | 4,701,861.00 | 4.23 |
| 80 | 300199 | 翰宇药业 | 4,698,801.60 | 4.23 |
| 81 | 600495 | 晋西车轴 | 4,698,108.92 | 4.23 |
| 82 | 601800 | 中国交建 | 4,692,041.00 | 4.22 |
| 83 | 300203 | 聚光科技 | 4,691,714.00 | 4.22 |
| 84 | 600072 | 中船科技 | 4,690,921.00 | 4.22 |
| 85 | 002458 | 益生股份 | 4,688,131.64 | 4.22 |
| 86 | 002635 | 安洁科技 | 4,687,543.00 | 4.22 |
| 87 | 002048 | 宁波华翔 | 4,685,879.00 | 4.21 |
| 88 | 600277 | 亿利洁能 | 4,685,328.00 | 4.21 |
| 89 | 600535 | 天士力 | 4,684,836.70 | 4.21 |
| 90 | 600221 | 海航控股 | 4,684,592.00 | 4.21 |
| 91 | 600446 | 金证股份 | 4,684,236.86 | 4.21 |
| 92 | 002234 | 民和股份 | 4,676,602.80 | 4.21 |
| 93 | 600089 | 特变电工 | 4,676,112.98 | 4.21 |
| 94 | 000888 | 峨眉山A | 4,675,727.97 | 4.21 |
| 95 | 300511 | 雪榕生物 | 4,672,402.00 | 4.20 |
| 96 | 000401 | 冀东水泥 | 4,663,662.00 | 4.19 |
| 97 | 601899 | 紫金矿业 | 4,663,417.00 | 4.19 |
| 98 | 600885 | 宏发股份 | 4,660,673.00 | 4.19 |
| 99 | 300003 | 乐普医疗 | 4,640,775.00 | 4.17 |
| 100 | 000998 | 隆平高科 | 4,624,888.00 | 4.16 |
| 101 | 603179 | 新泉股份 | 4,621,773.18 | 4.16 |
| 102 | 600690 | 青岛海尔 | 4,613,796.24 | 4.15 |
| 103 | 000980 | 众泰汽车 | 4,609,229.22 | 4.15 |
| 104 | 600477 | 杭萧钢构 | 4,599,540.00 | 4.14 |
| 105 | 002155 | 湖南黄金 | 4,587,378.00 | 4.13 |
| 106 | 002594 | 比亚迪 | 4,585,373.18 | 4.12 |
| 107 | 600963 | 岳阳林纸 | 4,583,905.34 | 4.12 |
| 108 | 603517 | 绝味食品 | 4,563,365.00 | 4.10 |
| 109 | 000063 | 中兴通讯 | 4,527,920.00 | 4.07 |
| 110 | 600028 | 中国石化 | 4,521,753.00 | 4.07 |
| 111 | 600150 | 中国船舶 | 4,503,848.00 | 4.05 |
| 112 | 600691 | 阳煤化工 | 4,503,223.90 | 4.05 |
| 113 | 600703 | 三安光电 | 4,501,447.00 | 4.05 |
| 114 | 601600 | 中国铝业 | 4,497,319.00 | 4.05 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 115 | 002497 | 雅化集团 | 4,492,065.00 | 4.04 |
| 116 | 603938 | 三孚股份 | 4,442,167.00 | 4.00 |
| 117 | 601169 | 北京银行 | 4,422,418.00 | 3.98 |
| 118 | 603626 | 科森科技 | 4,419,279.00 | 3.98 |
| 119 | 600884 | 杉杉股份 | 4,404,285.00 | 3.96 |
| 120 | 600688 | 上海石化 | 4,400,603.00 | 3.96 |
| 121 | 600827 | 百联股份 | 4,385,385.00 | 3.94 |
| 122 | 000683 | 远兴能源 | 4,372,898.80 | 3.93 |
| 123 | 601688 | 华泰证券 | 4,365,003.00 | 3.93 |
| 124 | 002230 | 科大讯飞 | 4,304,792.56 | 3.87 |
| 125 | 002174 | 游族网络 | 4,302,549.79 | 3.87 |
| 126 | 002624 | 完美世界 | 4,284,854.54 | 3.85 |
| 127 | 002643 | 万润股份 | 4,282,590.50 | 3.85 |
| 128 | 603986 | 兆易创新 | 4,135,337.00 | 3.72 |
| 129 | 002769 | 普路通 | 4,110,017.57 | 3.70 |
| 130 | 603288 | 海天味业 | 4,092,101.00 | 3.68 |
| 131 | 300616 | 尚品宅配 | 4,078,006.00 | 3.67 |
| 132 | 300433 | 蓝思科技 | 3,888,541.00 | 3.50 |
| 133 | 000551 | 创元科技 | 3,558,619.00 | 3.20 |
| 134 | 600036 | 招商银行 | 3,537,955.60 | 3.18 |
| 135 | 601997 | 贵阳银行 | 3,531,028.96 | 3.18 |
| 136 | 601009 | 南京银行 | 3,511,912.00 | 3.16 |
| 137 | 601939 | 建设银行 | 3,495,044.00 | 3.14 |
| 138 | 601398 | 工商银行 | 3,491,254.00 | 3.14 |
| 139 | 000090 | 天健集团 | 3,426,593.00 | 3.08 |
| 140 | 600549 | 厦门钨业 | 3,384,017.35 | 3.04 |
| 141 | 300408 | 三环集团 | 3,104,163.12 | 2.79 |
| 142 | 002281 | 光迅科技 | 2,977,309.00 | 2.68 |
| 143 | 600498 | 烽火通信 | 2,971,862.70 | 2.67 |
| 144 | 600499 | 科达洁能 | 2,468,779.00 | 2.22 |
| 145 | 002876 | 三利谱 | 2,407,851.00 | 2.17 |
| 146 | 601166 | 兴业银行 | 2,397,082.00 | 2.16 |
| 147 | 000001 | 平安银行 | 2,396,059.60 | 2.16 |
| 148 | 000630 | 铜陵有色 | 2,286,484.00 | 2.06 |
| 149 | 002108 | 沧州明珠 | 2,272,766.90 | 2.04 |
| 150 | 300477 | 合纵科技 | 2,265,610.98 | 2.04 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 151 | 300284 | 苏交科 | 2,246,225.00 | 2.02 |
| 152 | 300545 | 联得装备 | 2,243,941.00 | 2.02 |

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 | 603993 | 洛阳钼业 | 51,926,785.27 | 46.71 |
| 2 | 603799 | 华友钴业 | 42,984,178.21 | 38.66 |
| 3 | 002340 | 格林美 | 18,839,543.00 | 16.95 |
| 4 | 600110 | 诺德股份 | 18,550,878.41 | 16.69 |
| 5 | 000059 | 华锦股份 | 18,509,844.58 | 16.65 |
| 6 | 002466 | 天齐锂业 | 17,080,577.00 | 15.36 |
| 7 | 600366 | 宁波韵升 | 16,748,446.00 | 15.06 |
| 8 | 002460 | 赣锋锂业 | 16,747,458.75 | 15.06 |
| 9 | 600383 | 金地集团 | 14,926,858.86 | 13.43 |
| 10 | 600362 | 江西铜业 | 14,876,601.00 | 13.38 |
| 11 | 601233 | 桐昆股份 | 14,146,736.76 | 12.72 |
| 12 | 600183 | 生益科技 | 14,066,820.00 | 12.65 |
| 13 | 300037 | 新宙邦 | 11,766,307.88 | 10.58 |
| 14 | 000823 | 超声电子 | 11,448,790.85 | 10.30 |
| 15 | 600048 | 保利地产 | 10,751,447.14 | 9.67 |
| 16 | 002555 | 三七互娱 | 10,640,836.99 | 9.57 |
| 17 | 600109 | 国金证券 | 10,578,872.00 | 9.52 |
| 18 | 600392 | 盛和资源 | 10,545,701.00 | 9.49 |
| 19 | 603808 | 歌力思 | 10,514,565.08 | 9.46 |
| 20 | 600029 | 南方航空 | 10,010,002.00 | 9.00 |
| 21 | 600019 | 宝钢股份 | 9,956,437.01 | 8.96 |
| 22 | 000970 | 中科三环 | 9,953,316.00 | 8.95 |
| 23 | 002051 | 中工国际 | 9,946,855.68 | 8.95 |
| 24 | 603186 | 华正新材 | 9,858,891.26 | 8.87 |
| 25 | 600111 | 北方稀土 | 9,789,010.00 | 8.81 |
| 26 | 601800 | 中国交建 | 9,682,501.41 | 8.71 |
| 27 | 601111 | 中国国航 | 9,535,277.00 | 8.58 |
| 28 | 000333 | 美的集团 | 9,398,695.20 | 8.45 |
| 29 | 000651 | 格力电器 | 9,368,152.42 | 8.43 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 30 | 000807 | 云铝股份 | 9,297,595.20 | 8.36 |
| 31 | 600115 | 东方航空 | 9,210,584.00 | 8.28 |
| 32 | 601669 | 中国电建 | 9,200,756.00 | 8.28 |
| 33 | 002456 | 欧菲科技 | 9,190,409.35 | 8.27 |
| 34 | 000498 | 山东路桥 | 9,054,852.19 | 8.14 |
| 35 | 601668 | 中国建筑 | 9,036,779.00 | 8.13 |
| 36 | 300203 | 聚光科技 | 9,036,466.87 | 8.13 |
| 37 | 002074 | 国轩高科 | 9,010,895.60 | 8.11 |
| 38 | 600967 | 内蒙一机 | 8,860,461.00 | 7.97 |
| 39 | 600685 | 中船防务 | 8,709,235.48 | 7.83 |
| 40 | 300461 | 田中精机 | 7,986,932.00 | 7.18 |
| 41 | 000831 | 五矿稀土 | 7,522,171.00 | 6.77 |
| 42 | 300115 | 长盈精密 | 7,522,170.67 | 6.77 |
| 43 | 600068 | 葛洲坝 | 7,458,295.44 | 6.71 |
| 44 | 000630 | 铜陵有色 | 7,314,772.00 | 6.58 |
| 45 | 600745 | 闻泰科技 | 7,287,900.00 | 6.56 |
| 46 | 600691 | 阳煤化工 | 6,950,849.36 | 6.25 |
| 47 | 000878 | 云南铜业 | 6,907,459.00 | 6.21 |
| 48 | 300700 | 岱勒新材 | 6,664,377.88 | 5.99 |
| 49 | 300577 | 开润股份 | 6,637,671.00 | 5.97 |
| 50 | 300602 | 飞荣达 | 6,630,148.08 | 5.96 |
| 51 | 600426 | 华鲁恒升 | 6,521,067.00 | 5.87 |
| 52 | 600585 | 海螺水泥 | 6,187,971.00 | 5.57 |
| 53 | 000063 | 中兴通讯 | 5,946,186.00 | 5.35 |
| 54 | 600801 | 华新水泥 | 5,945,045.55 | 5.35 |
| 55 | 002867 | 周大生 | 5,880,804.68 | 5.29 |
| 56 | 000065 | 北方国际 | 5,866,634.00 | 5.28 |
| 57 | 601628 | 中国人寿 | 5,856,403.12 | 5.27 |
| 58 | 600259 | 广晟有色 | 5,745,824.06 | 5.17 |
| 59 | 603228 | 景旺电子 | 5,742,951.02 | 5.17 |
| 60 | 600477 | 杭萧钢构 | 5,734,762.00 | 5.16 |
| 61 | 600887 | 伊利股份 | 5,721,961.18 | 5.15 |
| 62 | 000538 | 云南白药 | 5,698,074.32 | 5.13 |
| 63 | 300059 | 东方财富 | 5,629,624.33 | 5.06 |
| 64 | 000060 | 中金岭南 | 5,580,939.50 | 5.02 |
| 65 | 000725 | 京东方 A | 5,550,298.00 | 4.99 |
| 66 | 000338 | 潍柴动力 | 5,458,365.00 | 4.91 |
| 67 | 300284 | 苏交科 | 5,398,897.75 | 4.86 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 68 | 603305 | 旭升股份 | 5,386,103.00 | 4.84 |
| 69 | 600398 | 海澜之家 | 5,284,960.00 | 4.75 |
| 70 | 002573 | 清新环境 | 5,135,018.24 | 4.62 |
| 71 | 000933 | 神火股份 | 5,112,743.68 | 4.60 |
| 72 | 002539 | 云图控股 | 5,102,365.14 | 4.59 |
| 73 | 600089 | 特变电工 | 4,947,925.00 | 4.45 |
| 74 | 600076 | 康欣新材 | 4,934,522.00 | 4.44 |
| 75 | 600172 | 黄河旋风 | 4,907,544.00 | 4.41 |
| 76 | 002624 | 完美世界 | 4,895,603.64 | 4.40 |
| 77 | 002142 | 宁波银行 | 4,857,451.76 | 4.37 |
| 78 | 600884 | 杉杉股份 | 4,820,343.00 | 4.34 |
| 79 | 600072 | 中船科技 | 4,808,957.00 | 4.33 |
| 80 | 002048 | 宁波华翔 | 4,803,746.98 | 4.32 |
| 81 | 000826 | 启迪桑德 | 4,759,393.51 | 4.28 |
| 82 | 600323 | 瀚蓝环境 | 4,749,684.30 | 4.27 |
| 83 | 600495 | 晋西车轴 | 4,732,350.00 | 4.26 |
| 84 | 300618 | 寒锐钴业 | 4,718,457.57 | 4.24 |
| 85 | 600535 | 天士力 | 4,714,656.00 | 4.24 |
| 86 | 600690 | 青岛海尔 | 4,680,088.35 | 4.21 |
| 87 | 600446 | 金证股份 | 4,675,286.83 | 4.21 |
| 88 | 300554 | 三超新材 | 4,666,382.00 | 4.20 |
| 89 | 000910 | 大亚圣象 | 4,648,553.00 | 4.18 |
| 90 | 600221 | 海航控股 | 4,643,738.00 | 4.18 |
| 91 | 603938 | 三孚股份 | 4,637,683.00 | 4.17 |
| 92 | 002458 | 益生股份 | 4,626,818.57 | 4.16 |
| 93 | 600885 | 宏发股份 | 4,625,950.04 | 4.16 |
| 94 | 002304 | 洋河股份 | 4,624,274.00 | 4.16 |
| 95 | 601996 | 丰林集团 | 4,612,886.00 | 4.15 |
| 96 | 300003 | 乐普医疗 | 4,602,729.00 | 4.14 |
| 97 | 000401 | 冀东水泥 | 4,597,889.00 | 4.14 |
| 98 | 000980 | 众泰汽车 | 4,591,338.25 | 4.13 |
| 99 | 600028 | 中国石化 | 4,575,492.00 | 4.12 |
| 100 | 002234 | 民和股份 | 4,544,025.90 | 4.09 |
| 101 | 601899 | 紫金矿业 | 4,529,516.00 | 4.07 |
| 102 | 002594 | 比亚迪 | 4,516,086.99 | 4.06 |
| 103 | 002230 | 科大讯飞 | 4,500,611.77 | 4.05 |
| 104 | 300199 | 翰宇药业 | 4,478,741.02 | 4.03 |
| 105 | 600688 | 上海石化 | 4,470,361.00 | 4.02 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 106 | 300511 | 雪榕生物 | 4,462,126.00 | 4.01 |
| 107 | 002174 | 游族网络 | 4,450,644.25 | 4.00 |
| 108 | 000669 | 金鸿控股 | 4,449,755.60 | 4.00 |
| 109 | 601169 | 北京银行 | 4,445,926.00 | 4.00 |
| 110 | 601688 | 华泰证券 | 4,441,597.00 | 4.00 |
| 111 | 000683 | 远兴能源 | 4,422,063.20 | 3.98 |
| 112 | 600963 | 岳阳林纸 | 4,416,652.08 | 3.97 |
| 113 | 600827 | 百联股份 | 4,407,642.38 | 3.96 |
| 114 | 002635 | 安洁科技 | 4,397,241.00 | 3.96 |
| 115 | 600703 | 三安光电 | 4,353,168.00 | 3.92 |
| 116 | 603179 | 新泉股份 | 4,300,433.00 | 3.87 |
| 117 | 600150 | 中国船舶 | 4,230,828.00 | 3.81 |
| 118 | 300070 | 碧水源 | 4,229,767.15 | 3.80 |
| 119 | 600277 | 亿利洁能 | 4,229,104.90 | 3.80 |
| 120 | 600808 | 马钢股份 | 4,228,774.00 | 3.80 |
| 121 | 600617 | 国新能源 | 4,217,937.85 | 3.79 |
| 122 | 002497 | 雅化集团 | 4,202,054.00 | 3.78 |
| 123 | 601600 | 中国铝业 | 4,195,225.00 | 3.77 |
| 124 | 002643 | 万润股份 | 4,189,473.00 | 3.77 |
| 125 | 000002 | 万科A | 4,127,338.00 | 3.71 |
| 126 | 000761 | 本钢板材 | 4,080,879.00 | 3.67 |
| 127 | 002155 | 湖南黄金 | 4,021,914.00 | 3.62 |
| 128 | 002769 | 普路通 | 4,016,105.03 | 3.61 |
| 129 | 603626 | 科森科技 | 3,993,664.00 | 3.59 |
| 130 | 603288 | 海天味业 | 3,885,900.32 | 3.50 |
| 131 | 600549 | 厦门钨业 | 3,824,454.12 | 3.44 |
| 132 | 600036 | 招商银行 | 3,778,904.86 | 3.40 |
| 133 | 600166 | 福田汽车 | 3,707,206.00 | 3.33 |
| 134 | 601009 | 南京银行 | 3,702,008.00 | 3.33 |
| 135 | 601997 | 贵阳银行 | 3,653,494.08 | 3.29 |
| 136 | 601398 | 工商银行 | 3,596,390.00 | 3.23 |
| 137 | 601939 | 建设银行 | 3,531,109.89 | 3.18 |
| 138 | 000551 | 创元科技 | 3,459,454.00 | 3.11 |
| 139 | 002570 | 贝因美 | 3,423,355.56 | 3.08 |
| 140 | 300137 | 先河环保 | 3,384,081.00 | 3.04 |
| 141 | 603986 | 兆易创新 | 3,351,692.00 | 3.01 |
| 142 | 000090 | 天健集团 | 3,339,581.00 | 3.00 |
| 143 | 300262 | 巴安水务 | 3,183,740.39 | 2.86 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 144 | 300408 | 三环集团 | 3,104,173.58 | 2.79 |
| 145 | 002281 | 光迅科技 | 3,024,691.00 | 2.72 |
| 146 | 600498 | 烽火通信 | 2,867,904.87 | 2.58 |
| 147 | 000001 | 平安银行 | 2,580,093.60 | 2.32 |
| 148 | 600499 | 科达洁能 | 2,491,465.00 | 2.24 |
| 149 | 601166 | 兴业银行 | 2,432,364.00 | 2.19 |
| 150 | 300172 | 中电环保 | 2,396,511.00 | 2.16 |
| 151 | 300477 | 合纵科技 | 2,365,743.95 | 2.13 |
| 152 | 002876 | 三利谱 | 2,358,246.98 | 2.12 |
| 153 | 000707 | 双环科技 | 2,250,624.71 | 2.02 |
| 154 | 300190 | 维尔利 | 2,243,285.97 | 2.02 |

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 | 1,065,412,465.49 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,082,880,272.30 |

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

注：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

注：无。

8.7 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。

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

注：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

注：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

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

8.10.1 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

注：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 | 149,696.70 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,694.61 |
| 5 | 应收申购款 | 4,092.52 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 156,483.83 |

8.12.4 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。

8.12.5 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 | 002507 | 涪陵榨菜 | 5,205,291.00 | 5.31 | 临时停牌 |

§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 |
| 1,124 | 92,745.09 | 52,052,990.74 | 49.93% | 52,192,493.35 | 50.07% |

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 | 260,580.53 | 0.2500% |

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 | 0~10 |
| 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 | 132,298,120.42 |
| 本报告期基金总申购份额 | 20,028,130.62 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 48,080,766.95 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 104,245,484.09 |

§ 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、2017 年 1 月 23 日，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审议通过，免去杨兵先生公司副总经理的职务，由杨兵先生转任公司总经理、公司董事。

2、阮菲女士于 2017 年 10 月 12 日因个人原因离任，自 2017 年 10 月 12 日后不再担任红土创新基金管理有限公司副总经理。

3、2017 年 9 月 1 日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

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。本年度支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 60,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 3 年。

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 例 | 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | |
| 银河证券 | | 2746,906,452.09 | 34.77% | 546,212.80 | 34.77% | - |
| 申万宏源 | | 2680,577,940.21 | 31.68% | 497,705.37 | 31.68% | - |
| 中信证券 | | 4566,290,575.87 | 26.36% | 414,127.13 | 26.36% | - |
| 中信证券 (山东) | 2 | 154,517,769.62 | 7.19% | 112,999.02 | 7.19% | - |
| 广发证券 | 2 | - | - | - | - | - |

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 |
| 银河证券 | - | - | 115,000,000.00 | 17.97% | - | - |
| 申万宏源 | - | - | 204,000,000.00 | 31.88% | - | - |
| 中信证券 | - | - | 307,000,000.00 | 47.97% | - | - |
| 中信证券 (山东) | - | - | 14,000,000.00 | 2.19% | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 | 1 | 20170103-20171231 | 50,060,750.00 | 0.00 | 0.00 | 50,060,750.00 | 48.02% |
| 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；

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。

12.2 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。