

红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式 证券投资基金 2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：红塔红土基金管理有限公司

基金托管人：广州农村商业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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。

基金托管人广州农村商业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、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。

本报告中财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19
§ 6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§ 7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
§ 8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况.....	55
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	55
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.....	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	90
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.....	90

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.....	91
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.....	91
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.....	91
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	91
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	91
8.12 投资组合报告附注.....	91
§ 9 基金份额持有人信息.....	93
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	93
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	93
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.....	93
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	94
§ 10 开放式基金份额变动.....	95
§ 11 重大事件揭示.....	96
11.1 基金份额持有人大会决议.....	96
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.....	96
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	96
11.4 基金投资策略的改变.....	96
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	97
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.....	97
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	97
11.8 其他重大事件.....	98
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	101
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.....	101
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	101
§ 13 备查文件目录.....	102
13.1 备查文件目录.....	102
13.2 存放地点.....	102
13.3 查阅方式.....	102

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	红塔红土优质成长	
场内简称	-	
基金主代码	001673	
基金运作方式	契约型开放式发起式	
基金合同生效日	2015 年 8 月 6 日	
基金管理人	红塔红土基金管理有限公司	
基金托管人	广州农村商业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	213,817,610.16 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称:	红塔红土优质成长 A	红塔红土优质成长 C
下属分级基金的场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	001673	001674
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	213,279,903.82 份	537,706.34 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对个股基本面的价值分析精选个股，通过对宏观经济周期阶段的分析确定股票资产和债券资产等各类资产的中长期配置，通过行为金融学对市场短期风格的分析确定短期行业配置，在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动地资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金投资策略包括大类资产配置策略、股票资产投资策略、债券及其它金融工具投资策略几个部分。	
业绩比较基准	沪深 300 指数×55%+中债总指数（财富）×45%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。	
	红塔红土优质成长 A	红塔红土优质成长 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

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		红塔红土基金管理有限公司	广州农村商业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李凌	卿苗
	联系电话	0755-33379079	020-28019512
	电子邮箱	liling@htamc.com.cn	qingmiao@grcbank.com
客户服务电话		4001-666-916（免长途话费）	95313
传真		0755-33379007	020-28019340
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	广州市黄埔区映日路9号
办公地址		深圳市南山区侨香路4068号智慧广场A栋801	广州市珠江新城华夏路1号信合大厦16楼
邮政编码		518052	510000
法定代表人		刘辉	王继康

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》、《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.htamc.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
注册登记机构	红塔红土基金管理有限公司	深圳市南山区侨香路4068号智慧广场A栋801

§ 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 8 月 6 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日	
	红塔红土优质成长 A	红塔红土优质成长 C	红塔红土优质成长 A	红塔红土优质成长 C	红塔红土优质成长 A	红塔红土优质成长 C
本期已实现收益	2,164,523.03	1,051.61	-776,622.48	-31,266.64	602,849.59	27,669.21
本期利润	15,771,974.62	42,695.00	-1,279,560.94	-65,900.92	923,364.25	44,827.29
加权平均基金份额本期利润	0.0724	0.0647	-0.0646	-0.0889	0.0458	0.0449
本期加权平均净值利润率	7.28%	6.54%	-6.76%	-9.32%	4.57%	4.48%
本期基金份额净值增长率	7.25%	6.90%	-5.75%	-5.90%	4.59%	4.59%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
期末可供分配利润	-346,988.84	-3,556.17	-144,193.07	-10,251.99	604,631.84	29,278.77
期末可供分配基金份额利润	-0.0016	-0.0066	-0.0142	-0.0158	0.0300	0.0300
期末基金资产净值	225,503,725.23	565,697.35	10,023,193.76	639,751.72	21,104,182.02	1,021,678.31
期末基金份额净值	1.0573	1.0521	0.9858	0.9842	1.0459	1.0459
3.1.3 累计期末指标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
基金份额累计净值增长率	5.73%	5.21%	-1.42%	-1.58%	4.59%	4.59%

注：1、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；

2、本期已实现收益是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。

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

红塔红土优质成长 A

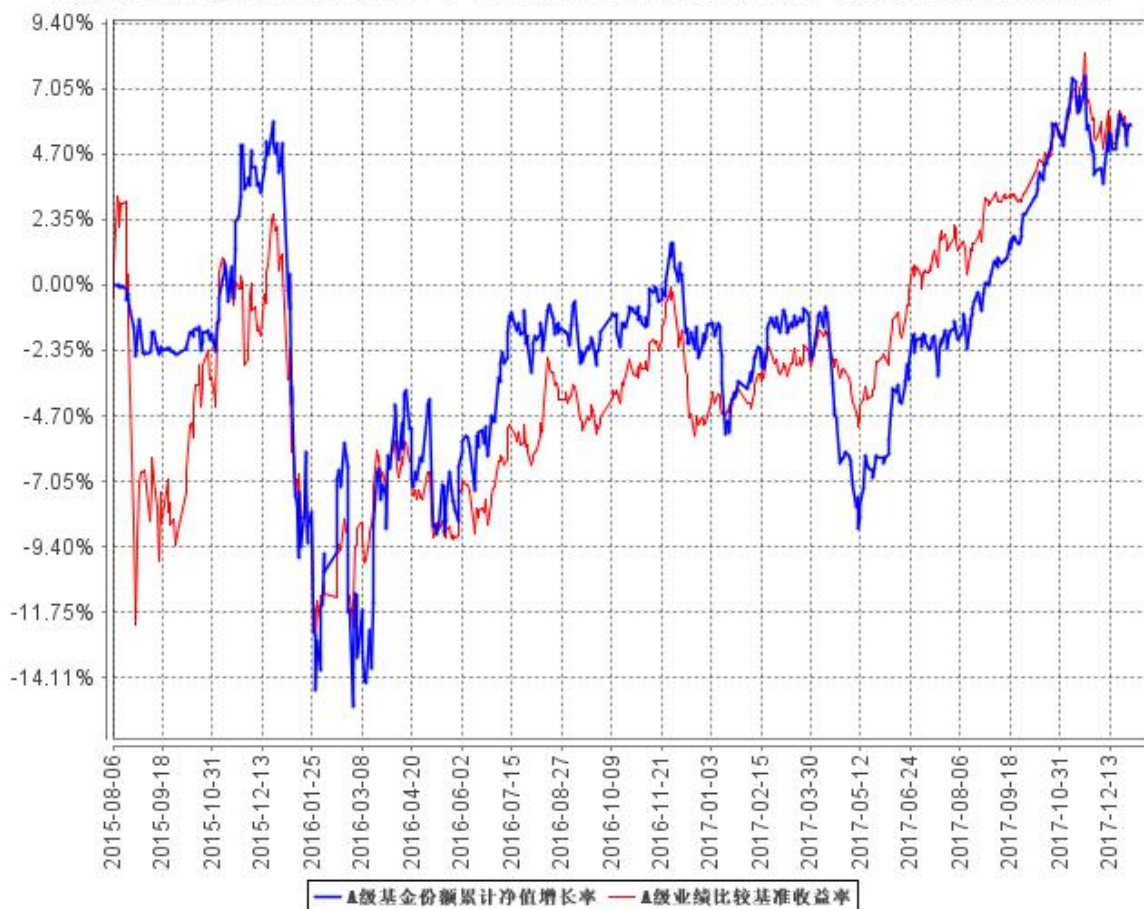
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.12%	0.48%	2.40%	0.43%	0.72%	0.05%
过去六个月	7.83%	0.42%	5.17%	0.38%	2.66%	0.04%
过去一年	7.25%	0.48%	10.98%	0.35%	-3.73%	0.13%
自基金合同生效起至今	5.73%	0.86%	5.79%	0.76%	-0.06%	0.10%

红塔红土优质成长 C

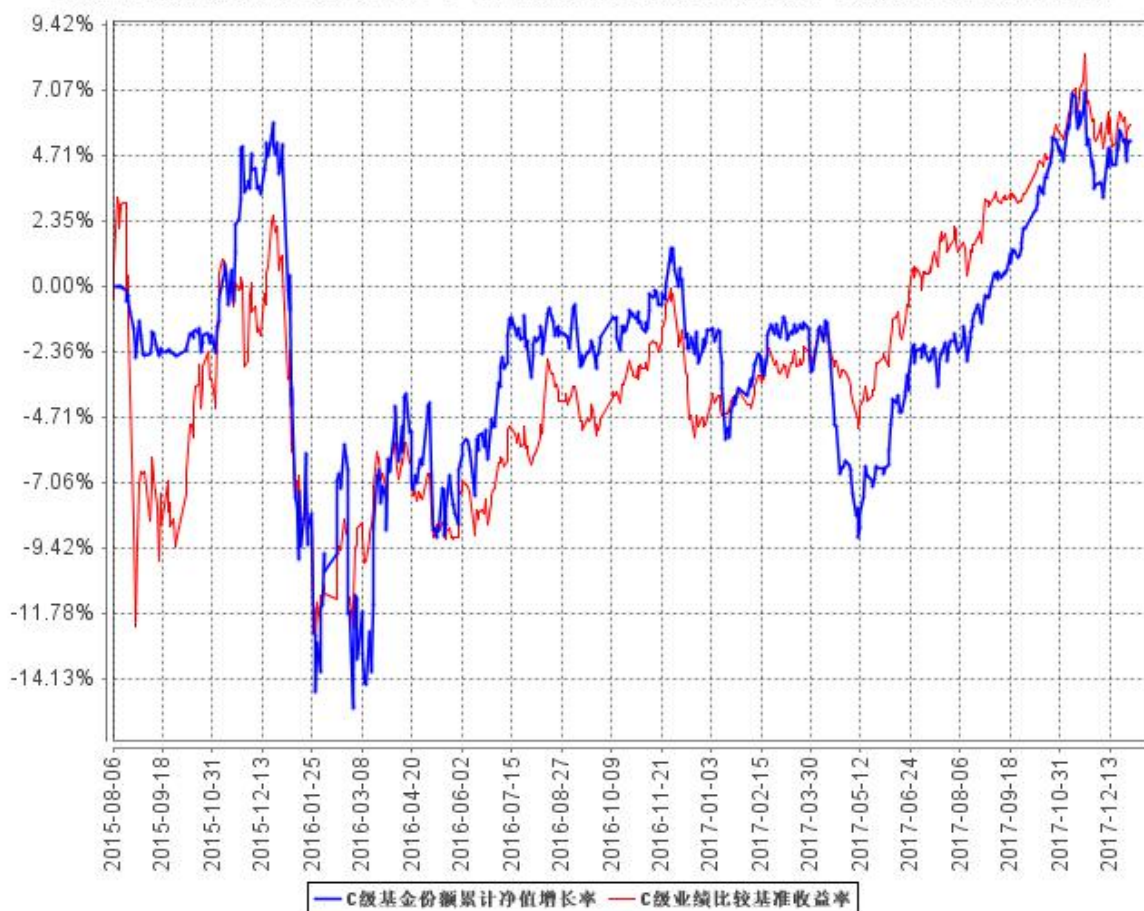
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.07%	0.48%	2.40%	0.43%	0.67%	0.05%
过去六个月	7.71%	0.42%	5.17%	0.38%	2.54%	0.04%
过去一年	6.90%	0.48%	10.98%	0.35%	-4.08%	0.13%
自基金合同生效起至今	5.21%	0.86%	5.79%	0.76%	-0.58%	0.10%

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

A级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

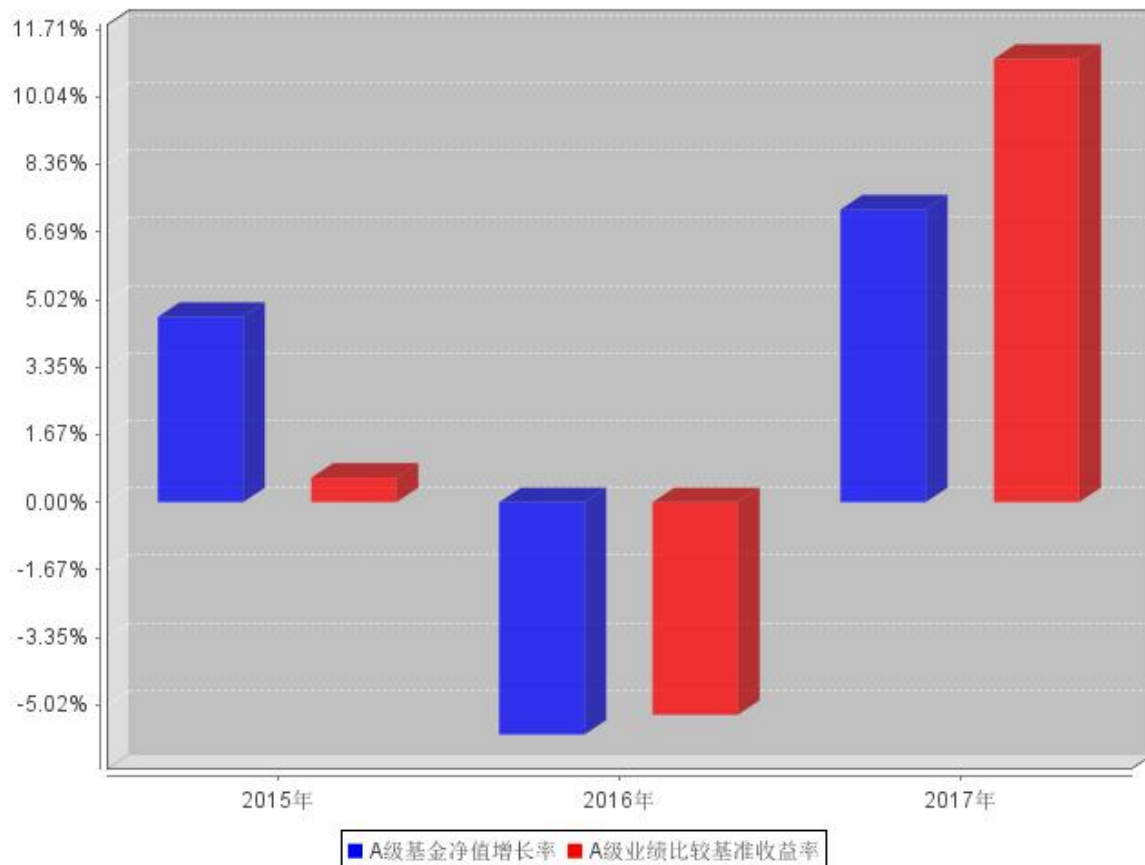


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

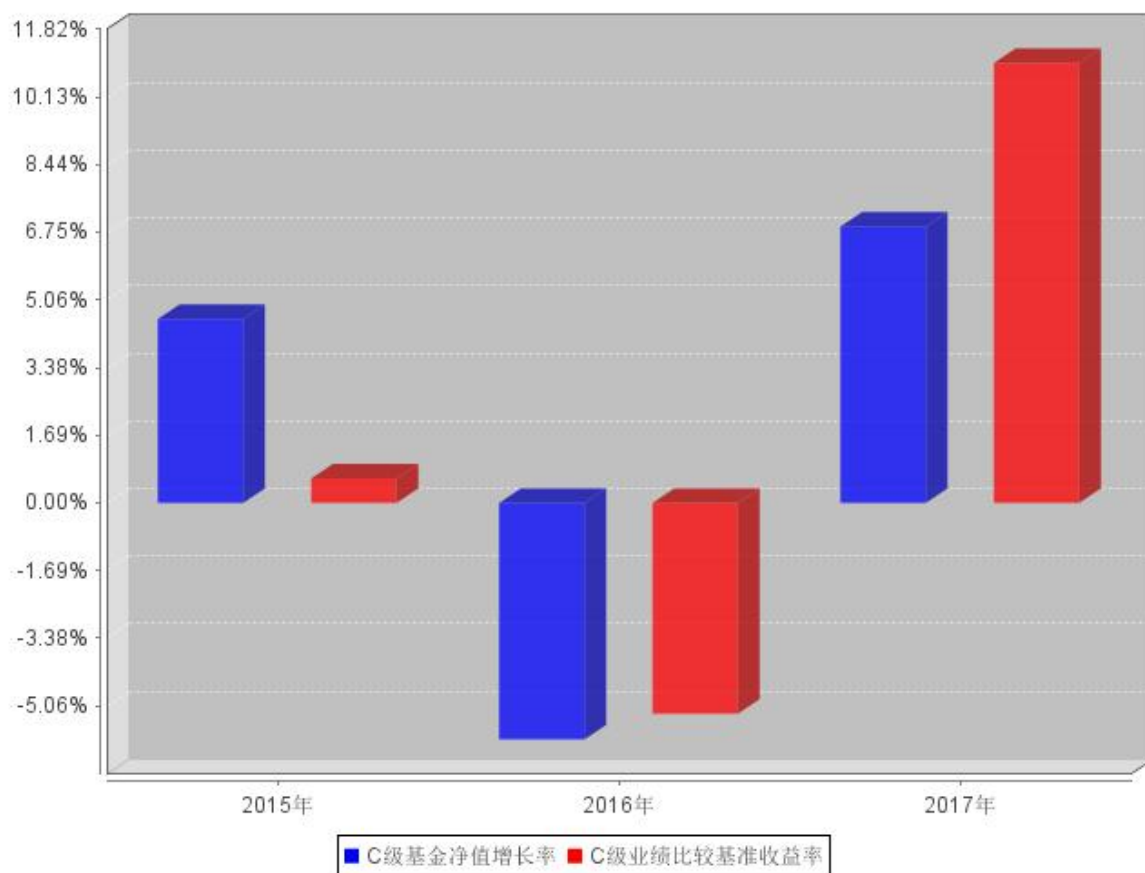


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级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



C级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



3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 8 月 6 日，自基金合同生效日起至报告期末未进行利润分配。

§ 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

本基金管理人为红塔红土基金管理有限公司（简称“公司”），经中国证券监督管理委员会批准，于 2012 年 6 月 12 日正式成立，注册地位于深圳前海，注册资本 4.96 亿元人民币。其中，红塔证券股份有限公司出资比例为 59.27%，北京市华远集团有限公司出资比例为 30.24%，深圳市创新投资集团有限公司出资比例为 10.49%。公司业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理及中国证监会许可的其他业务。

作为一家为客户提供专业投资服务的资产管理机构，公司将坚持价值投资理念，以专业服务回馈社会，建立并不断完善投研一体化平台，坚持把基金持有人利益放在首位，努力实现基金持有人资产增值。同时，重视投资的风险控制，建立起一套全面完善的风险管理体系，以风险预算为基础，合法合规运作为前提，将风险控制贯穿于整个投资运作的全过程，进而实现专业组合投资。截止 2017 年 12 月 31 日，公司有员工 49 人，其中 33 人具有硕士或博士学位；截止 2017 年 12 月 31 日，公司管理 9 只证券投资基金。

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		
罗薇	基金经理	2016 年 5 月 4 日	-	5	澳洲新南威尔士大学会计学硕士，北京大学理学学士，具有五年医药/传媒等行业研究经验，2012 年加入红塔红土基金研究部，现任职于公司投资部，为公司投资决策委员会委员。
林睿	基金经理	2017 年 3 月 2 日	2017 年 8 月 31 日	6	美国范德堡大学经济学专业硕士，北京师范大学电子、经济双学士。近 6 年证券从业经历，历任中国证券登记结算公司北京分公司信息服务部经理助理、深圳市新智达投资管理有限公司资产管理部经理，2015 年加入红塔红土基金研究部，曾任职于公司投资部，为公司投资决

					策委员会委员。
赵耀	基金经理	2015年8月6日	2017年3月2日	14	香港中文大学金融财务工商管理硕士，厦门大学经济学学士，CFA（美国注册金融分析师）。近14年证券、基金从业经历，历任诺安基金交易员、中国国际金融有限公司交易员，具有丰富的大资金运作交易经验。现任职公司投资部，为公司投资决策委员会委员。

注：1、证券从业年限的计算标准：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；

2、本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规，以及《红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内，本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规及基金合同等规定，未从事内幕交易、操纵市场等违法、违规行为，未开展有损于基金份额持有人利益的关联交易，整体运作合法合规。

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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规，制定了《红塔红土基金管理有限公司公平交易管理办法》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。为确保交易的公平执行，公司交易管理实行集中交易制度，将公司所有投资组合的投资决策过程和交易执行过程分开，各投资组合的所有证券买卖活动须通过集中交易室集中统一完成。该公平交易管理方法规范的范围涵盖一级市场分销、二级市场交易和公司内部证券分配等所有投资管理活动；以及研究、授权、决策和执行等投资管理活动的各个环节。

公司建立研究管理平台向所有投资部门人员开放，确保各投资组合公平获得研究资源，通过

建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库。在公司备选股票库的基础上，各投资组合应根据不同投资组合的投资目标、投资风格和投资范围，建立不同投资组合的备选股票库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内独立、自主、审慎决策，超过投资权限的操作需要经过严格的逐级审批程序。基金经理不得兼任投资经理，且各投资组合的基金经理、投资经理投资系统权限要严格分离。针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，由集中交易室通过投资交易系统内的公平交易模块，按照“价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡”的原则，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对以公司名义开展的场外网下交易，严格按照价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。对于银行间市场交易、交易所大宗交易、非公开发行股票申购、债券一级市场申购等非集中竞价交易，涉及到两个或以上投资组合参与同一证券交易的情况，各投资组合经理在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。监察稽核部通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则，定期针对旗下所有投资组合在交易所公开竞价交易中的同日同向、临近交易日同向、反向交易记录，进行交易时机和交易价差的专项统计分析，以排查异常交易。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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》、《红塔红土基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等在研究分析、投资决策、交易执行等各业务环节严格控制，公平对待旗下所有投资组合。

报告期内，基金管理人管理的各投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率以及不同时间窗内（同日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价格未发现异常差异，各投资组合间不存在违背公平交易原则的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了《红塔红土基金管理有限公司异常交易监控管理办法》，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合外，同一投资组合禁止同日反向交易，不同投资组合之间严格限制同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，需经严格审批并留痕备查。

报告期内，本基金与基金管理人管理的其他投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易中，成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的 5%，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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 年中国经济在上半年在海外经济复苏带动和国内库存周期的双重影响下呈现小幅反弹走势，下半年库存周期进入被动补库存阶段，但经济仍然表现平稳，全年 6.9 的 GDP 增速高于政策目标，使得全年经济政策主要以去杠杆调结构为主。在这样的背景下，经济基本面向好，企业盈利改善，而政策面偏紧，股票市场估值压缩，债券市场收益率上行。整个 2017 年，股票市场的走势波动不大但分化非常明显，上证 50 指数上涨 25.08%，沪深 300 指数上涨 21.78%，创业板指数下跌 10.67%。债券市场方面，市场利率整体持续振荡向上，10 年国债利率全年上行 87 个 bp。

红塔红土优质成长基金在 2017 年采取积极的股票管理操作，行业布局上相对比较分散，但都以估值合理的优质行业龙头为主，股票的仓位适中，并通过参与网下新股申购，获得增强收益。债券资产方面主要是短久期高评级的信用债或存单，受市场利率上行的冲击较小。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金 A 级基金份额净值 1.0573 元，C 级基金份额净值 1.0521 元。本报告期 A 级基金份额净值增长率为 7.25%，同期业绩比较基准收益率为 10.98%；C 级基金份额净值增长率为 6.90%，同期业绩比较基准收益率为 10.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年的中国经济，结合近两年的中国经济走势，我们可以很高兴的看到中国经济已经探底启稳成功，目前处于 L 型的底部。但启稳成功并不意味着经济增速会马上反弹，由于人口等因素，中国经济长期潜在的增长速度是在下降的，因此从长期来看，未来经济增速肯定还是会下行的，但启稳成功意味着我们的经济不会出现失速的断崖式下跌，而期间受库存周期和海外经济波动影响还会呈现小幅反弹振荡，也就是说经济已经具备了一定的短周期弹性。并且我们的经济启稳是在不断的金融去杠杆的背景下实现的，也就是说在这样的一个中高增速经济情况下，我们经济结构性问题是在改善的，因此我们看到了更多蓝天白云和青山绿水，也看到了企业盈利质量的改善，整个经济发生系统性风险的概率在下降，应对外围经济冲击的能力也在增强。

对于 2018 年的股票市场我们是谨慎乐观，指数可能是小幅正增长，但个股方面仍然会有较大的分化，因为我们仍然处于金融去杠杆和全球货币政策收紧的大背景下，市场的整体估值仍然处

于收缩期，不具备大牛市的土壤，市场继续向业绩和价值回归，部份高估值的个股仍然会面临估值收缩的压力，而部份估值合理，业绩有保证有增长的个股可以赚到企业盈利的收益。因此在 2018 年我们对于股票市场要有合理的收益预期，要寻找业绩与估值相匹配，并且在基本面上有改善的个股，赚企业业绩的钱。

债券市场也同样遵循慢既是快的规律，在金融去杠杆和全球货币政策收紧的大环境下，债券市场也是个小年，可以获得较好的票息，却较难获得资本利得，因此通过短久期高评级的防守策略是当前情况下较好的稳健策略。而货币市场基金全年因该都有较好的收益，仍然是非常好的现金替代产品。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人内部开展的有关本基金的监察稽核工作包括，严格事前的监督审查，通过系统和人工相结合，开展事中监控、事后检查稽核，保障业务运作的合法合规性。监察稽核部对基金募集和持续营销、基金等各受托资产的投资管理、基金信息披露等方面进行事先合规审核，通过投资交易系统预设风控指标阈值对相关投资组合的合规风险实现事前控制，通过公平交易模块对本基金及基金管理人管理的其他投资组合之间的公平交易情况进行每日监控和定期分析，对各投资组合的潜在异常交易进行每日监测和分析；定期、不定期地对本基金投资、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行全面检查，对控制手段提出改进建议和督促业务部门改进存在问题。此外，监察稽核部还根据新出台的法律法规和行业的新要求，督促公司各部门及时制定、更新规章制度和业务流程，有计划、有针对性针对全体员工、投资管理人员及其他相关业务人员进行多种形式的法律合规培训，每当新法规出台时，及时向公司员工发送并对有关新法规的主要条款进行解释或培训，促进公司合规文化的建设。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

(1) 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。

基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基

金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

根据中国证监会的相关规定，本公司针对停牌股票、债券不活跃市场报价等投资品种启用特殊估值流程，由基金估值小组确定相应证券的估值方法。

估值小组成员包括公司领导、运营部门、法律、监察稽核部、研究部等相关人员。

(2) 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与公司启用特殊估值的流程，发表相关意见和建议，与运营部门、公司领导、研究部相关人员共同商定估值原则和政策。

(3) 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

(4) 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，广州农村商业银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金（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合规守信、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。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由红塔红土基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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	安永华明(2018)审字第 61014670_H03 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	红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表及所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金管理层(以下简称“管理层”)对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在

	<p>由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。</p>

	<p>我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	昌华 乌爱莉
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
审计报告日期	2018年3月25日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	7.4.7.1	3,007,067.90	1,162,400.71
结算备付金		5,835.91	281,361.51
存出保证金		9,723.18	43,399.34
交易性金融资产	7.4.7.2	240,474,292.42	9,260,335.80
其中：股票投资		132,085,324.22	7,497,085.00
基金投资		-	-
债券投资		108,388,968.20	1,763,250.80
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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	2,494,263.80	11,915.06
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		245,991,183.21	10,759,412.42
负债和所有者权益	附注号	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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		19,399,770.90	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		152,557.62	11,700.26
应付托管费		38,139.36	2,925.09
应付销售服务费		123.57	136.10
应付交易费用	7.4.7.7	52,369.63	31,705.49
应交税费		-	-

应付利息		28,799.55	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	250,000.00	50,000.00
负债合计		19,921,760.63	96,466.94
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	213,817,610.16	10,817,390.54
未分配利润	7.4.7.10	12,251,812.42	-154,445.06
所有者权益合计		226,069,422.58	10,662,945.48
负债和所有者权益总计		245,991,183.21	10,759,412.42

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值人民币 1.0573 元，A 类基金份额 213,279,903.82 份；C 类基金份额净值人民币 1.0521 元，C 类基金份额 537,706.34 份，基金份额总额合计为 213,817,610.16 份。

7.2 利润表

会计主体：红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金

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	附注号	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		21,445,993.10	-781,621.90
1.利息收入		5,328,701.60	176,781.52
其中：存款利息收入	7.4.7.11	85,700.17	20,833.54
债券利息收入		5,085,818.94	75,116.05
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		157,182.49	80,831.93
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,973,963.10	-421,526.62
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-274,008.36	-451,793.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-231,145.55	-61,513.34
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	2,479,117.01	91,779.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	13,649,094.98	-537,572.74
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	494,233.42	695.94
减：二、费用		5,631,323.48	563,839.96
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,727,837.04	157,469.74
2. 托管费	7.4.10.2.2	431,959.18	39,367.51
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,630.74	1,764.77
4. 交易费用	7.4.7.19	1,805,012.31	215,537.94
5. 利息支出		1,377,684.21	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,377,684.21	-
6. 其他费用	7.4.7.20	287,200.00	149,700.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,814,669.62	-1,345,461.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,814,669.62	-1,345,461.86

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金

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）	10,817,390.54	-154,445.06	10,662,945.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,814,669.62	15,814,669.62
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）	203,000,219.62	-3,408,412.14	199,591,807.48
其中：1. 基金申购款	336,059,743.06	-5,089,163.60	330,970,579.46
2. 基金赎回款	-133,059,523.44	1,680,751.46	-131,378,771.98
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	213,817,610.16	12,251,812.42	226,069,422.58

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
	金净值)		
一、期初所有者权益（基金净值）	21,155,544.13	970,316.20	22,125,860.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,345,461.86	-1,345,461.86
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）	-10,338,153.59	220,700.60	-10,117,452.99
其中：1. 基金申购款	223,101.23	-8,313.06	214,788.17
2. 基金赎回款	-10,561,254.82	229,013.66	-10,332,241.16
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）	10,817,390.54	-154,445.06	10,662,945.48

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：

_____ 刘辉 _____	_____ 许艺然 _____	_____ 李志朋 _____
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

红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)，系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]1467号《关于核准红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人红塔红土基金管理有限公司(以下简称“红塔红土基金公司”)向社会公开发行募集。本基金的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 20,979,594.13 元，折合 20,979,594.13 份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 530.52 元，折合 530.52 份基金份额，以上实收基金(本息)合计为人民币 20,980,124.65 元，折合 20,980,124.65 份基金份额。本基金合同

于 2015 年 8 月 6 日正式生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为红塔红土基金公司，注册登记机构为红塔红土基金公司，基金托管人为广州农村商业银行股份有限公司(以下简称“广州农村商业银行”)。

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、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、固定收益类资产（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款及现金等）、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它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，债券等固定收益资产占基金资产的比例不低于 5%；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-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，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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×55%+中债总指数（财富）×45%。

本基金的财务报表于 2018 年 3 月 27 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

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主要包括股票、债券、基金和衍生工具等投资。

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、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

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

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为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；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等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照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

(2) 与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(3) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(4) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(5) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率逐日计提；

(3) 基金销售服务费：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25% 年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影

响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：

(1) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 基金收益分配采用现金或红利再投资方式，投资人可选择获取现金红利，投资人可选择获取现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；基金份额持有人事先未做出选择的，默认分红方式为现金红利；

(3) 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 在符合上述基金收益分配的前提下，本基金每年收益分配至多六次，每次基金收益分配比例不得低于可供分配利润的 30%；

(5) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(6) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

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

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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(以下简称“资管产品运营业务”)，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价(2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

(3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

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	上年度末
----	-----	------

	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
活期存款	3,007,067.90	1,162,400.71
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	3,007,067.90	1,162,400.71

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	117,735,078.62	132,085,324.22	14,350,245.60
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	653,976.64	634,968.20
	银行间市场	108,636,042.18	107,754,000.00
	合计	109,290,018.82	108,388,968.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	227,025,097.44	240,474,292.42	13,449,194.98
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	7,692,391.40	7,497,085.00	-195,306.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,767,844.40	1,763,250.80
	银行间市场	-	-
	合计	1,767,844.40	1,763,250.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	9,460,235.80	9,260,335.80	-199,900.00

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末及上年度末均无衍生金融资产/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**

注：本基金于本期末及上年度末均无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末及上年度末均无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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	350.76	277.48
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	2.86	139.37
应收债券利息	2,493,905.45	11,476.76
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	4.73	21.45
合计	2,494,263.80	11,915.06

注：其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金于本期末及上年度末均无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	48,429.88	31,705.49
银行间市场应付交易费用	3,939.75	-
合计	52,369.63	31,705.49

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-

预提审计费	50,000.00	50,000.00
预提信息披露费	200,000.00	-
合计	250,000.00	50,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

红塔红土优质成长 A		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,167,386.83	10,167,386.83
本期申购	335,771,495.70	335,771,495.70
本期赎回（以“-”号填列）	-132,658,978.71	-132,658,978.71
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	213,279,903.82	213,279,903.82

金额单位：人民币元

红塔红土优质成长 C		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	650,003.71	650,003.71
本期申购	288,247.36	288,247.36
本期赎回（以“-”号填列）	-400,544.73	-400,544.73
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	537,706.34	537,706.34

注：申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

红塔红土优质成长 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-116,326.76	-27,866.31	-144,193.07

本期利润	2,164,523.03	13,607,451.59	15,771,974.62
本期基金份额交易产生的变动数	-2,395,185.11	-1,008,775.03	-3,403,960.14
其中：基金申购款	-4,106,515.14	-977,612.86	-5,084,128.00
基金赎回款	1,711,330.03	-31,162.17	1,680,167.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-346,988.84	12,570,810.25	12,223,821.41

单位：人民币元

红塔红土优质成长 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,427.83	-1,824.16	-10,251.99
本期利润	1,051.61	41,643.39	42,695.00
本期基金份额交易产生的变动数	3,820.05	-8,272.05	-4,452.00
其中：基金申购款	-2,965.81	-2,069.79	-5,035.60
基金赎回款	6,785.86	-6,202.26	583.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,556.17	31,547.18	27,991.01

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
	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
活期存款利息收入	32,745.61	16,481.16
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	34,444.44	-
结算备付金利息收入	11,630.72	3,538.58
其他	6,879.40	813.80
合计	85,700.17	20,833.54

注：本年度其他存款利息收入为协议存款利息收入，其他为结算保证金利息收入及申购款利息收入；上年度其他为结算保证金利息收入及申购款利息收入。

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
	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

卖出股票成交总额	619,122,845.92	71,830,965.40
减：卖出股票成本总额	619,396,854.28	72,282,758.59
买卖股票差价收入	-274,008.36	-451,793.19

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-231,145.55	-61,513.34
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	-231,145.55	-61,513.34

7.4.7.13.2 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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	85,274,897.65	1,408,125.78
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	82,490,175.71	1,380,992.77
减：应收利息总额	3,015,867.49	88,646.35
买卖债券差价收入	-231,145.55	-61,513.34

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金于本期及上年度可比期间均无债券投资收益赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金于本期及上年度可比期间均无债券投资收益申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金于本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

7.4.7.16 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	2,479,117.01	91,779.91
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,479,117.01	91,779.91

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	13,649,094.98	-537,572.74
——股票投资	14,545,552.00	-520,463.68

——债券投资	-896,457.02	-17,109.06
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	13,649,094.98	-537,572.74

7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	494,233.13	695.94
转换费收入_001673	0.29	-
合计	494,233.42	695.94

7.4.7.19 交易费用

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
交易所市场交易费用	1,802,712.31	215,537.94
银行间市场交易费用	2,300.00	-
合计	1,805,012.31	215,537.94

7.4.7.20 其他费用

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
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	200,000.00	80,000.00
债券账户维护费	36,000.00	19,500.00
其他	1,200.00	200.00
合计	287,200.00	149,700.00

注：其他为上交所账户查询费。

7.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（以下简称“估值业务指引”），自2018年1月13日起，本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。

截至财务报表批准日，除上述事项及在7.4.6税项中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
红塔红土基金公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构、发起人
广州农村商业银行	基金托管人
红塔证券股份有限公司（“红塔证券”）	基金管理人的股东
深圳市创新投资集团有限公司	基金管理人的股东
北京市华远集团有限公司	基金管理人的股东
深圳市红塔资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下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

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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
-------	-----------------------------	----------------------------------

	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
红塔证券	152,051,319.64	11.32%	55,610,425.07	39.47%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：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	
	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 成交总额的 比例
红塔证券	1,135,330.81	40.72%	3,210,869.06	100.00%

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：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	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
红塔证券	156,500,000.00	61.96%	403,700,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 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年1月1日至2017年12月31日			
	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
红塔证券	141,605.28	13.30%	7,753.35	16.01%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	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

红塔证券	51,789.80	39.48%	14,152.82	44.64%
------	-----------	--------	-----------	--------

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

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管理费	1,727,837.04	157,469.74
其中：支付销售机构的客户维护费	723.38	423.81

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的0.80%年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 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	431,959.18	39,367.51

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 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年1月1日至2017年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	红塔红土优质成长 A	红塔红土优质成长 C	合计
红塔红土基金公司	-	1,504.71	1,504.71
合计	-	1,504.71	1,504.71
获得销售服务费的 各关联方名称	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销售服务费		
	红塔红土优质成长 A	红塔红土优质成长 C	合计
红塔红土基金公司	-	1,617.93	1,617.93
合计	-	1,617.93	1,617.93

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费费率为 0.25%。基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	红塔红土优质成长 A	红塔红土优质成长 C
基金合同生效日（2015 年 8 月 6 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10,000,100.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,100.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	4.6800%	-

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	红塔红土优质成长 A	红塔红土优质成长 C
基金合同生效日（2015 年 8 月 6 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10,000,100.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,100.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	92.4400%	-

注：1) 基金管理人持有本基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付；

2) 根据《红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，发起资金认购本基金的金额不少于人民币 1,000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。2015 年 8 月 6 日(基金合同生效日)，红塔红土基金公司运用自有资金作为发起资金认购的本基金份额为 10,000,100.00 份，占本基金发起时份额总量的 47.66%。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

红塔红土优质成长 A				
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
深圳市红塔资产管理有限公司	-	-	100.00	0.00%

注：其他关联方持有本基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度期末未持有本基金 C 类基金份额。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
广州农村商业银行	3,007,067.90	32,745.61	1,162,400.71	16,481.16

注：本基金的活期银行存款由基金托管人广州农村商业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2017 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
300664	鹏鹞环保	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股未上市	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017 年 12 月 25 日	2018 年 1 月 3 日	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

7.4.12.1.2 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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123004	铁汉转债	2017 年 12 月 21 日	2018 年 1 月 26 日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-
123006	东财转债	2017 年 12 月 25 日	2018 年 1 月 29 日	新债未上市	100.00	100.00	40	4,000.00	4,000.00	-

128024	宁行转债	2017年12月8日	2018年1月12日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-
128028	赣锋转债	2017年12月26日	2018年1月19日	新债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.00	-
128030	天康转债	2017年12月27日	2018年1月29日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

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
002739	万达电影	2017年7月4日	重大事项	52.04	-	-	61,000	3,222,847.68	3,174,440.00	-
000022	深赤湾A	2017年11月20日	重大事项	24.14	-	-	125,000	2,810,807.00	3,017,500.00	-
300730	科创信息	2017年12月25日	重大事项	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	重大事项	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

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

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 19,399,770.90 元，是以如下债券作为质押：

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
101364002	13 豫水利	2018年1月	100.86	100,000	10,086,000.00

	MTN002	5 日			
101761011	17 海沧投资 MTN002	2018 年 1 月 5 日	99.35	100,000	9,935,000.00
合计				200,000	20,021,000.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元,无质押的债券。

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,建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、金融工程小组和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会,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控制委员会,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,协调金融工程小组及其他各部门完成运作风险管理,并进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责,并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

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以控制相应的信用风险。

截至 2017 年 12 月 31 日止,本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基

金资产净值的比例为 43.53%。(2016 年 12 月 31 日: 16.54%)

7.4.13.2.1 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 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	9,986,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	57,557,000.00	-
合计	67,543,000.00	-

注: 1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为银行间同业存单及政策性金融债。

3、债券投资以净价列示。

7.4.13.2.2 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 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	20,191,000.00	905,484.00
AAA 以下	20,654,968.20	857,766.80
未评级	-	-
合计	40,845,968.20	1,763,250.80

注: 1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、债券投资以净价列示。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注: -

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系, 审慎评估各类资产的流动性, 针对性制定流动性风险管理措施, 对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交

易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。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资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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、存出保证金及债券投资等，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。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,007,067.90	-	-	-	-	-	3,007,067.90
结算备付金	5,835.91	-	-	-	-	-	5,835.91
存出保证金	9,723.18	-	-	-	-	-	9,723.18

交易性金融资产	10,119,000.00	20,051,000.00	67,649,000.00	10,560,968.20	9,000.00	132,085,324.22	240,474,292.42
应收利息	-	-	-	-	-	2,494,263.80	2,494,263.80
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,141,626.99	20,051,000.00	67,649,000.00	10,560,968.20	9,000.00	134,579,588.02	245,991,183.21
负债							
卖出回购金融资产款	19,399,770.90	-	-	-	-	-	19,399,770.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	152,557.62	152,557.62
应付托管费	-	-	-	-	-	38,139.36	38,139.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-	123.57	123.57
应付交易费用	-	-	-	-	-	52,369.63	52,369.63
应付利息	-	-	-	-	-	28,799.55	28,799.55
其他负债	-	-	-	-	-	250,000.00	250,000.00
负债总计	19,399,770.90	-	-	-	-	521,989.73	19,921,760.63
利率敏感度缺口	-6,258,143.91	20,051,000.00	67,649,000.00	10,560,968.20	9,000.00	不适用	不适用
上年度末 2016年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,162,400.71	-	-	-	-	-	1,162,400.71
结算备付金	281,361.51	-	-	-	-	-	281,361.51
存出保证金	43,399.34	-	-	-	-	-	43,399.34
交易性金融资产	-	-	-	1,763,250.80	-	7,497,085.00	9,260,335.80
应收利息	-	-	-	-	-	11,915.06	11,915.06
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,487,161.56	-	-	1,763,250.80	-	7,509,000.06	10,759,412.42
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	11,700.26	11,700.26
应付托管费	-	-	-	-	-	2,925.09	2,925.09
应付销售服务费	-	-	-	-	-	136.10	136.10
应付交易费用	-	-	-	-	-	31,705.49	31,705.49
其他负债	-	-	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	96,466.94	96,466.94
利率敏感度缺口	1,487,161.56	-	-	1,763,250.80	-	不适用	不适用

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
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年12月31日）	上年度末（2016年12月31日）

	利率上升 25 个基准点	-169,831.25	-4,404.45
	利率下降 25 个基准点	170,604.10	4,424.12

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。

本基金持有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。

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 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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	132,085,324.22	58.43	7,497,085.00	70.31
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	108,388,968.20	47.95	1,763,250.80	16.54
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	240,474,292.42	106.38	9,260,335.80	86.85

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
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 年 12 月 31 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）

1. 本基金业绩比较基准上升 5%	12,190,250.34	745,023.49
2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-12,190,250.34	-745,023.49

注：本基金业绩比较基准=沪深 300 指数×55%+中债总指数（财富）×45%。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：-

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) 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

(2) 其他事项

(a) 公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、存出保证金、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(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划分为第一层次的余额为人民币 125,744,876.02 元，划分为第二层次的余额为人民币 114,729,416.40 元，无划分为第三层次余额。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划分为第一层次的余额为人民币 7,173,085.00 元，划分为第二层次的余额为人民币 2,087,250.80 元，无划分为第三层次余额。

(ii) 公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃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或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(b) 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	132,085,324.22	53.70
	其中：股票	132,085,324.22	53.70
2	固定收益投资	108,388,968.20	44.06
	其中：债券	108,388,968.20	44.06
	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	3,012,903.81	1.22
7	其他各项资产	2,503,986.98	1.02
8	合计	245,991,183.21	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	1,800,400.00	0.80
B	采矿业	4,809,050.00	2.13
C	制造业	63,878,265.28	28.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,697,343.20	3.40
E	建筑业	1,608,020.00	0.71
F	批发和零售业	4,297,452.05	1.90
G	交通运输、仓储和邮政业	6,555,857.94	2.90
H	住宿和餐饮业	1,614,500.00	0.71
I	信息传输、软件和信息技术服务业	727,418.55	0.32
J	金融业	22,903,974.00	10.13
K	房地产业	5,038,870.00	2.23
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	2,839,023.20	1.26
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	8,315,150.00	3.68
S	综合	-	-
	合计	132,085,324.22	58.43

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：本基金本报告期内未通过沪港通投资股票。

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	601318	中国平安	73,300	5,129,534.00	2.27
2	600887	伊利股份	150,000	4,828,500.00	2.14
3	002008	大族激光	92,000	4,544,800.00	2.01
4	000338	潍柴动力	530,000	4,420,200.00	1.96
5	000895	双汇发展	160,000	4,240,000.00	1.88
6	600196	复星医药	92,000	4,094,000.00	1.81
7	601398	工商银行	610,000	3,782,000.00	1.67
8	601939	建设银行	467,000	3,586,560.00	1.59
9	300003	乐普医疗	147,000	3,551,520.00	1.57
10	601919	中远海控	520,000	3,520,400.00	1.56
11	000402	金融街	300,000	3,333,000.00	1.47
12	600030	中信证券	176,000	3,185,600.00	1.41
13	002739	万达电影	61,000	3,174,440.00	1.40
14	600038	中直股份	65,700	3,057,021.00	1.35
15	000022	深赤湾A	125,000	3,017,500.00	1.33
16	601288	农业银行	780,000	2,987,400.00	1.32
17	600028	中国石化	485,000	2,973,050.00	1.32
18	000581	威孚高科	123,000	2,952,000.00	1.31
19	600056	中国医药	117,000	2,912,130.00	1.29
20	000601	韶能股份	400,000	2,880,000.00	1.27
21	002389	南洋科技	136,000	2,873,680.00	1.27
22	002003	伟星股份	250,000	2,862,500.00	1.27

23	601211	国泰君安	154,000	2,852,080.00	1.26
24	000826	启迪桑德	85,000	2,806,700.00	1.24
25	601607	上海医药	115,000	2,781,850.00	1.23
26	300408	三环集团	133,000	2,681,280.00	1.19
27	300144	宋城演艺	140,000	2,612,400.00	1.16
28	000651	格力电器	59,500	2,600,150.00	1.15
29	600562	国睿科技	107,000	2,569,070.00	1.14
30	002343	慈文传媒	71,000	2,528,310.00	1.12
31	002821	凯莱英	41,812	2,502,448.20	1.11
32	600498	烽火通信	86,000	2,479,380.00	1.10
33	002179	中航光电	50,000	1,969,000.00	0.87
34	600176	中国巨石	120,000	1,954,800.00	0.86
35	601899	紫金矿业	400,000	1,836,000.00	0.81
36	600886	国投电力	250,000	1,835,000.00	0.81
37	000998	隆平高科	70,000	1,800,400.00	0.80
38	600089	特变电工	180,000	1,783,800.00	0.79
39	002146	荣盛发展	179,000	1,705,870.00	0.75
40	600754	锦江股份	50,000	1,614,500.00	0.71
41	600068	葛洲坝	196,100	1,608,020.00	0.71
42	002601	龙蟠佰利	100,000	1,602,000.00	0.71
43	600023	浙能电力	300,000	1,599,000.00	0.71
44	600998	九州通	79,979	1,515,602.05	0.67
45	600535	天士力	40,000	1,423,200.00	0.63
46	601688	华泰证券	80,000	1,380,800.00	0.61
47	600452	涪陵电力	40,000	1,367,200.00	0.60
48	002466	天齐锂业	24,150	1,285,021.50	0.57
49	300188	美亚柏科	34,700	693,306.00	0.31
50	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.12
51	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.08
52	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.02
53	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.02
54	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.02
55	300730	科创信息	821	34,112.55	0.02
56	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.01
57	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.01
58	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.01
59	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.01
60	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.01
61	603329	上海雅仕	1,183	17,957.94	0.01

62	002923	润都股份	954	16,227.54	0.01
63	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.01
64	603655	朗博科技	881	8,193.30	0.00

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	601677	明泰铝业	4,434,371.60	41.59
2	600452	涪陵电力	4,265,369.64	40.00
3	000429	粤高速 A	4,257,433.02	39.93
4	600519	贵州茅台	4,129,215.71	38.72
5	000402	金融街	3,978,288.54	37.31
6	600562	国睿科技	3,959,217.62	37.13
7	000895	双汇发展	3,457,363.60	32.42
8	601688	华泰证券	3,387,524.00	31.77
9	600068	葛洲坝	3,382,976.00	31.73
10	002563	森马服饰	3,268,286.00	30.65
11	600038	中直股份	3,264,320.15	30.61
12	600019	宝钢股份	3,237,222.00	30.36
13	002739	万达电影	3,222,847.68	30.22
14	600028	中国石化	3,203,597.37	30.04
15	601398	工商银行	3,163,264.00	29.67
16	000601	韶能股份	3,047,348.00	28.58
17	600176	中国巨石	3,023,133.00	28.35
18	000826	启迪桑德	3,021,787.00	28.34
19	002415	海康威视	2,978,502.24	27.93
20	601288	农业银行	2,964,000.00	27.80
21	600708	光明地产	2,946,537.65	27.63
22	601318	中国平安	2,913,416.00	27.32
23	603986	兆易创新	2,903,138.00	27.23
24	002008	大族激光	2,892,710.23	27.13
25	600276	恒瑞医药	2,847,344.00	26.70
26	300144	宋城演艺	2,846,611.90	26.70
27	300408	三环集团	2,841,672.00	26.65

28	000338	潍柴动力	2,827,893.14	26.52
29	600036	招商银行	2,822,716.00	26.47
30	600054	黄山旅游	2,813,672.44	26.39
31	002821	凯莱英	2,812,815.40	26.38
32	300003	乐普医疗	2,811,354.98	26.37
33	000022	深赤湾 A	2,810,807.00	26.36
34	600056	中国医药	2,806,778.59	26.32
35	600138	中青旅	2,802,746.97	26.28
36	600071	凤凰光学	2,801,709.05	26.28
37	600064	南京高科	2,798,991.91	26.25
38	300182	捷成股份	2,797,517.55	26.24
39	600196	复星医药	2,792,572.00	26.19
40	000963	华东医药	2,787,630.56	26.14
41	601939	建设银行	2,778,650.00	26.06
42	000581	威孚高科	2,778,400.02	26.06
43	002343	慈文传媒	2,775,908.00	26.03
44	601919	中远海控	2,774,665.00	26.02
45	601211	国泰君安	2,773,776.00	26.01
46	600660	福耀玻璃	2,756,838.98	25.85
47	002003	伟星股份	2,756,443.00	25.85
48	000028	国药一致	2,743,992.98	25.73
49	600030	中信证券	2,737,554.00	25.67
50	000661	长春高新	2,731,946.00	25.62
51	600004	白云机场	2,731,421.84	25.62
52	000900	现代投资	2,725,276.00	25.56
53	603160	汇顶科技	2,723,587.00	25.54
54	600900	长江电力	2,723,310.24	25.54
55	002202	金风科技	2,714,843.00	25.46
56	002389	南洋科技	2,714,209.00	25.45
57	000828	东莞控股	2,697,787.00	25.30
58	600711	盛屯矿业	2,682,020.00	25.15
59	601607	上海医药	2,677,826.00	25.11
60	600887	伊利股份	2,616,201.54	24.54
61	000726	鲁泰 A	2,572,119.00	24.12
62	600998	九州通	2,570,532.34	24.11
63	000543	皖能电力	2,484,266.98	23.30

64	300070	碧水源	2,467,808.71	23.14
65	600335	国机汽车	2,404,656.71	22.55
66	002540	亚太科技	2,340,737.72	21.95
67	000650	仁和药业	2,312,216.50	21.68
68	600073	上海梅林	2,290,072.99	21.48
69	000915	山大华特	2,275,503.00	21.34
70	000796	凯撒旅游	2,275,035.50	21.34
71	002014	永新股份	2,264,573.80	21.24
72	600162	香江控股	2,259,610.00	21.19
73	600961	株冶集团	2,219,553.61	20.82
74	002083	孚日股份	2,217,304.83	20.79
75	600531	豫光金铅	2,201,239.00	20.64
76	600027	华电国际	2,196,591.00	20.60
77	600757	长江传媒	2,178,822.81	20.43
78	000960	锡业股份	2,151,621.11	20.18
79	600782	新钢股份	2,148,094.00	20.15
80	600823	世茂股份	2,117,246.50	19.86
81	000701	厦门信达	2,102,718.58	19.72
82	600461	洪城水业	2,073,014.89	19.44
83	600498	烽火通信	2,067,549.50	19.39
84	600845	宝信软件	2,051,353.50	19.24
85	000708	大冶特钢	2,051,183.25	19.24
86	600269	赣粤高速	2,036,989.65	19.10
87	600894	广日股份	2,012,428.43	18.87
88	600289	ST 信通	2,008,597.00	18.84
89	600886	国投电力	1,989,500.00	18.66
90	000651	格力电器	1,985,469.03	18.62
91	000418	小天鹅 A	1,984,318.00	18.61
92	001979	招商蛇口	1,980,154.00	18.57
93	601313	江南嘉捷	1,979,287.96	18.56
94	600750	江中药业	1,972,286.40	18.50
95	600697	欧亚集团	1,970,433.45	18.48
96	000718	苏宁环球	1,970,263.75	18.48
97	300017	网宿科技	1,957,100.00	18.35
98	600677	航天通信	1,936,129.00	18.16
99	600668	尖峰集团	1,935,077.98	18.15

100	600206	有研新材	1,931,674.69	18.12
101	002133	广宇集团	1,923,290.00	18.04
102	002146	荣盛发展	1,908,233.74	17.90
103	002179	中航光电	1,867,441.96	17.51
104	600278	东方创业	1,865,611.39	17.50
105	600969	郴电国际	1,855,140.00	17.40
106	002157	正邦科技	1,854,353.00	17.39
107	002100	天康生物	1,847,609.68	17.33
108	600093	易见股份	1,844,968.00	17.30
109	600033	福建高速	1,842,881.00	17.28
110	600026	中远海能	1,823,595.00	17.10
111	601231	环旭电子	1,803,725.32	16.92
112	600835	上海机电	1,795,090.62	16.83
113	300357	我武生物	1,794,051.65	16.83
114	000998	隆平高科	1,793,451.00	16.82
115	601058	赛轮金宇	1,789,863.00	16.79
116	600089	特变电工	1,764,000.00	16.54
117	600508	上海能源	1,743,847.81	16.35
118	600966	博汇纸业	1,741,425.90	16.33
119	600051	宁波联合	1,724,145.51	16.17
120	603128	华贸物流	1,689,805.10	15.85
121	600754	锦江股份	1,676,987.00	15.73
122	601518	吉林高速	1,658,597.00	15.55
123	600455	博通股份	1,657,081.00	15.54
124	600350	山东高速	1,650,024.97	15.47
125	000667	美好置业	1,640,469.19	15.38
126	600023	浙能电力	1,638,000.00	15.36
127	002026	山东威达	1,630,105.49	15.29
128	600810	神马股份	1,608,401.26	15.08
129	600271	航天信息	1,598,253.88	14.99
130	002601	龙麟佰利	1,591,548.88	14.93
131	600797	浙大网新	1,588,660.00	14.90
132	600100	同方股份	1,586,892.00	14.88
133	002466	天齐锂业	1,583,665.00	14.85
134	600713	南京医药	1,576,084.59	14.78
135	600975	新五丰	1,553,669.00	14.57

136	300074	华平股份	1,550,236.76	14.54
137	601636	旗滨集团	1,544,367.00	14.48
138	601899	紫金矿业	1,536,000.00	14.41
139	600325	华发股份	1,532,545.00	14.37
140	600483	福能股份	1,526,218.52	14.31
141	600185	格力地产	1,519,963.93	14.25
142	002441	众业达	1,514,174.32	14.20
143	000665	湖北广电	1,507,815.24	14.14
144	002270	华明装备	1,506,822.00	14.13
145	600535	天士力	1,506,362.84	14.13
146	002309	中利集团	1,505,781.16	14.12
147	300219	鸿利智汇	1,504,669.00	14.11
148	000021	深科技	1,495,421.76	14.02
149	300240	飞力达	1,458,035.81	13.67
150	600808	马钢股份	1,457,732.00	13.67
151	002088	鲁阳节能	1,449,640.56	13.60
152	002237	恒邦股份	1,446,219.00	13.56
153	002171	楚江新材	1,431,009.12	13.42
154	600067	冠城大通	1,422,055.00	13.34
155	002641	永高股份	1,420,332.80	13.32
156	600980	北矿科技	1,405,328.50	13.18
157	002440	闰土股份	1,404,927.62	13.18
158	000876	新希望	1,404,632.00	13.17
159	300048	合康新能	1,382,030.60	12.96
160	002135	东南网架	1,377,806.04	12.92
161	600891	秋林集团	1,376,993.99	12.91
162	002728	特一药业	1,376,899.13	12.91
163	600510	黑牡丹	1,368,923.30	12.84
164	000936	华西股份	1,363,403.82	12.79
165	600126	杭钢股份	1,350,190.00	12.66
166	601678	滨化股份	1,348,946.04	12.65
167	000883	湖北能源	1,346,715.00	12.63
168	000006	深振业A	1,343,502.18	12.60
169	300282	汇冠股份	1,340,840.00	12.57
170	600104	上汽集团	1,335,305.21	12.52
171	600548	深高速	1,327,619.00	12.45

172	600795	国电电力	1,325,105.00	12.43
173	600748	上实发展	1,322,699.00	12.40
174	600741	华域汽车	1,321,279.00	12.39
175	002267	陕天然气	1,321,212.00	12.39
176	601088	中国神华	1,320,269.00	12.38
177	600377	宁沪高速	1,316,594.50	12.35
178	600642	申能股份	1,316,257.00	12.34
179	000679	大连友谊	1,315,579.00	12.34
180	600252	中恒集团	1,314,975.00	12.33
181	000531	穗恒运 A	1,314,606.00	12.33
182	000732	泰禾集团	1,310,384.53	12.29
183	300067	安诺其	1,308,741.47	12.27
184	000069	华侨城 A	1,307,951.00	12.27
185	002627	宜昌交运	1,307,385.29	12.26
186	000719	大地传媒	1,306,612.29	12.25
187	600499	科达洁能	1,305,817.01	12.25
188	600439	瑞贝卡	1,305,641.99	12.24
189	600177	雅戈尔	1,305,159.22	12.24
190	600035	楚天高速	1,305,110.81	12.24
191	002626	金达威	1,304,879.48	12.24
192	002394	联发股份	1,304,509.76	12.23
193	600688	上海石化	1,303,496.10	12.22
194	600665	天地源	1,301,571.00	12.21
195	600606	绿地控股	1,298,164.00	12.17
196	600811	东方集团	1,296,699.00	12.16
197	300039	上海凯宝	1,295,531.16	12.15
198	002281	光迅科技	1,294,341.00	12.14
199	002541	鸿路钢构	1,294,067.23	12.14
200	600292	远达环保	1,292,698.84	12.12
201	000030	富奥股份	1,291,906.80	12.12
202	000951	中国重汽	1,291,095.08	12.11
203	000552	靖远煤电	1,289,355.00	12.09
204	300108	吉药控股	1,288,259.96	12.08
205	000761	本钢板材	1,286,456.00	12.06
206	000919	金陵药业	1,285,817.79	12.06
207	002737	葵花药业	1,285,097.00	12.05

208	002534	杭锅股份	1,284,850.00	12.05
209	600346	恒力股份	1,282,381.00	12.03
210	002727	一心堂	1,281,560.64	12.02
211	600039	四川路桥	1,281,316.29	12.02
212	000703	恒逸石化	1,280,722.56	12.01
213	600210	紫江企业	1,280,457.00	12.01
214	600585	海螺水泥	1,279,987.00	12.00
215	600467	好当家	1,279,274.72	12.00
216	601222	林洋能源	1,277,255.16	11.98
217	002001	新和成	1,277,063.23	11.98
218	002092	中泰化学	1,275,783.00	11.96
219	600236	桂冠电力	1,275,020.00	11.96
220	002033	丽江旅游	1,274,796.91	11.96
221	002118	紫鑫药业	1,274,074.14	11.95
222	300269	联建光电	1,273,156.32	11.94
223	300274	阳光电源	1,272,890.20	11.94
224	600637	东方明珠	1,272,414.66	11.93
225	600846	同济科技	1,271,422.21	11.92
226	000686	东北证券	1,271,062.91	11.92
227	000898	鞍钢股份	1,270,065.00	11.91
228	300339	润和软件	1,269,272.00	11.90
229	000059	华锦股份	1,268,666.00	11.90
230	600704	物产中大	1,265,693.00	11.87
231	601339	百隆东方	1,264,728.91	11.86
232	000990	诚志股份	1,264,063.50	11.85
233	600308	华泰股份	1,259,076.72	11.81
234	000751	锌业股份	1,258,274.00	11.80
235	300026	红日药业	1,257,064.00	11.79
236	000420	吉林化纤	1,257,019.00	11.79
237	300206	理邦仪器	1,256,023.25	11.78
238	600805	悦达投资	1,253,712.99	11.76
239	000521	美菱电器	1,253,048.96	11.75
240	601579	会稽山	1,251,799.28	11.74
241	600170	上海建工	1,250,448.00	11.73
242	002452	长高集团	1,249,592.94	11.72
243	600011	华能国际	1,249,164.00	11.71

244	600567	山鹰纸业	1,247,509.00	11.70
245	002037	久联发展	1,244,519.60	11.67
246	002515	金字火腿	1,243,131.50	11.66
247	601233	桐昆股份	1,237,073.41	11.60
248	000587	金洲慈航	1,236,174.00	11.59
249	002462	嘉事堂	1,235,502.96	11.59
250	600129	太极集团	1,234,328.58	11.58
251	002344	海宁皮城	1,233,999.00	11.57
252	300326	凯利泰	1,233,566.67	11.57
253	000055	方大集团	1,230,753.50	11.54
254	600513	联环药业	1,230,660.24	11.54
255	600960	渤海活塞	1,228,540.81	11.52
256	000813	德展健康	1,227,805.00	11.51
257	002147	新光圆成	1,225,758.00	11.50
258	603168	莎普爱思	1,221,407.15	11.45
259	600216	浙江医药	1,205,221.49	11.30
260	000978	桂林旅游	1,204,935.00	11.30
261	002087	新野纺织	1,200,546.00	11.26
262	601699	潞安环能	1,199,025.54	11.24
263	002063	远光软件	1,189,360.00	11.15
264	300139	晓程科技	1,169,387.57	10.97
265	600990	四创电子	1,163,848.65	10.91
266	603939	益丰药房	1,133,081.26	10.63
267	603883	老百姓	1,130,939.89	10.61
268	002352	顺丰控股	1,124,031.96	10.54
269	600057	象屿股份	1,120,808.63	10.51
270	002013	中航机电	1,112,885.00	10.44
271	002582	好想你	1,097,328.00	10.29
272	603609	禾丰牧业	1,086,755.00	10.19
273	600557	康缘药业	1,083,653.80	10.16
274	603123	翠微股份	1,074,000.00	10.07
275	002412	汉森制药	1,071,061.00	10.04
276	600976	健民集团	1,063,655.97	9.98
277	600435	北方导航	1,056,009.00	9.90
278	300031	宝通科技	1,055,374.00	9.90
279	000513	丽珠集团	1,051,965.00	9.87

280	000637	茂化实华	1,050,643.23	9.85
281	600261	阳光照明	1,050,056.00	9.85
282	002369	卓翼科技	1,049,141.70	9.84
283	600285	羚锐制药	1,047,061.00	9.82
284	002313	日海通讯	1,044,443.00	9.80
285	002203	海亮股份	1,040,508.44	9.76
286	002017	东信和平	1,039,063.00	9.74
287	600768	宁波富邦	1,038,881.00	9.74
288	000795	英洛华	1,036,939.90	9.72
289	600327	大东方	1,033,810.73	9.70
290	000790	泰合健康	1,031,367.00	9.67
291	002194	武汉凡谷	1,030,969.00	9.67
292	600829	人民同泰	1,030,054.96	9.66
293	300236	上海新阳	1,027,002.37	9.63
294	000705	浙江震元	1,020,079.38	9.57
295	600529	山东药玻	1,017,241.00	9.54
296	002187	广百股份	1,010,605.16	9.48
297	600288	大恒科技	1,004,388.00	9.42
298	600694	大商股份	1,004,163.00	9.42
299	300389	艾比森	1,002,649.91	9.40
300	002057	中钢天源	1,000,779.85	9.39
301	600623	华谊集团	998,239.00	9.36
302	002165	红宝丽	990,922.00	9.29
303	300076	GQY 视讯	990,473.00	9.29
304	000597	东北制药	985,534.94	9.24
305	002182	云海金属	982,683.10	9.22
306	002470	金正大	981,253.00	9.20
307	000422	湖北宜化	981,176.00	9.20
308	002618	丹邦科技	977,660.00	9.17
309	600597	光明乳业	972,868.63	9.12
310	000404	华意压缩	971,720.43	9.11
311	600077	宋都股份	969,519.00	9.09
312	000989	九芝堂	969,375.00	9.09
313	600418	江淮汽车	969,024.00	9.09
314	002550	千红制药	966,908.00	9.07
315	000421	南京公用	964,436.35	9.04

316	600847	*ST 万里	963,065.00	9.03
317	300238	冠昊生物	962,467.66	9.03
318	300049	福瑞股份	959,967.76	9.00
319	300424	航新科技	957,693.06	8.98
320	603366	日出东方	954,263.00	8.95
321	002467	二六三	949,323.72	8.90
322	000523	广州浪奇	945,808.00	8.87
323	002045	国光电器	944,423.00	8.86
324	300207	欣旺达	939,013.00	8.81
325	300012	华测检测	933,504.00	8.75
326	600237	铜峰电子	919,413.11	8.62
327	000411	英特集团	917,053.00	8.60
328	600062	华润双鹤	914,780.00	8.58
329	600203	福日电子	913,730.09	8.57
330	002566	益盛药业	913,296.00	8.57
331	002294	信立泰	913,056.00	8.56
332	603989	艾华集团	908,553.00	8.52
333	000702	正虹科技	905,354.00	8.49
334	600983	惠而浦	904,139.44	8.48
335	000823	超声电子	902,322.82	8.46
336	300227	光韵达	899,411.00	8.43
337	600594	益佰制药	899,351.00	8.43
338	000733	振华科技	891,844.35	8.36
339	002314	南山控股	883,525.55	8.29
340	002056	横店东磁	879,316.38	8.25
341	300398	飞凯材料	867,813.66	8.14
342	600315	上海家化	862,209.00	8.09
343	600850	华东电脑	860,115.11	8.07
344	002712	思美传媒	858,607.00	8.05
345	600458	时代新材	856,427.46	8.03
346	600020	中原高速	848,408.00	7.96
347	002533	金杯电工	846,806.61	7.94
348	002557	洽洽食品	842,208.95	7.90
349	002731	萃华珠宝	842,100.04	7.90
350	002196	方正电机	839,724.17	7.88
351	002574	明牌珠宝	839,171.00	7.87

352	600426	华鲁恒升	834,706.80	7.83
353	000966	长源电力	834,677.00	7.83
354	600561	江西长运	833,227.53	7.81
355	600366	宁波韵升	830,829.00	7.79
356	002719	麦趣尔	828,750.70	7.77
357	600683	京投发展	828,513.68	7.77
358	601218	吉鑫科技	828,422.56	7.77
359	000908	景峰医药	828,344.93	7.77
360	300303	聚飞光电	826,704.00	7.75
361	603100	川仪股份	826,573.00	7.75
362	002130	沃尔核材	825,393.34	7.74
363	002184	海得控制	825,365.84	7.74
364	600517	置信电气	825,113.00	7.74
365	600889	南京化纤	821,452.50	7.70
366	002124	天邦股份	814,136.00	7.64
367	600248	延长化建	812,063.38	7.62
368	300226	上海钢联	803,620.76	7.54
369	600207	安彩高科	803,307.00	7.53
370	000759	中百集团	801,273.76	7.51
371	000785	武汉中商	790,157.80	7.41
372	600287	江苏舜天	786,780.00	7.38
373	603223	恒通股份	783,304.04	7.35
374	600052	浙江广厦	781,003.06	7.32
375	300365	恒华科技	778,355.34	7.30
376	600058	五矿发展	774,220.00	7.26
377	600729	重庆百货	765,280.25	7.18
378	000555	神州信息	764,157.57	7.17
379	600997	开滦股份	763,960.00	7.16
380	300264	佳创视讯	760,847.86	7.14
381	300286	安科瑞	760,119.08	7.13
382	600305	恒顺醋业	758,552.79	7.11
383	000681	视觉中国	755,499.22	7.09
384	300231	银信科技	754,363.00	7.07
385	300378	鼎捷软件	750,091.44	7.03
386	603020	爱普股份	749,688.98	7.03
387	600537	亿晶光电	749,138.00	7.03

388	002216	三全食品	748,233.00	7.02
389	600718	东软集团	742,095.29	6.96
390	002528	英飞拓	740,939.00	6.95
391	600973	宝胜股份	738,184.00	6.92
392	600268	国电南自	736,710.52	6.91
393	002350	北京科锐	736,095.69	6.90
394	600875	东方电气	731,434.24	6.86
395	000668	荣丰控股	730,962.01	6.86
396	600898	国美通讯	730,321.00	6.85
397	300396	迪瑞医疗	726,500.39	6.81
398	600723	首商股份	724,174.00	6.79
399	600476	湘邮科技	720,598.00	6.76
400	002366	台海核电	719,412.73	6.75
401	002471	中超控股	719,040.00	6.74
402	000899	赣能股份	716,558.00	6.72
403	000043	中航地产	715,286.00	6.71
404	000926	福星股份	713,150.00	6.69
405	000036	华联控股	711,579.00	6.67
406	002082	栋梁新材	708,323.00	6.64
407	000958	东方能源	704,173.00	6.60
408	600235	民丰特纸	696,930.74	6.54
409	600323	瀚蓝环境	685,704.79	6.43
410	002236	大华股份	684,489.00	6.42
411	002396	星网锐捷	684,465.48	6.42
412	002615	哈尔斯	684,454.98	6.42
413	601139	深圳燃气	681,834.00	6.39
414	600769	祥龙电业	679,968.00	6.38
415	002419	天虹股份	673,769.00	6.32
416	600356	恒丰纸业	673,591.97	6.32
417	002225	濮耐股份	671,528.00	6.30
418	601126	四方股份	670,421.00	6.29
419	002231	奥维通信	667,055.00	6.26
420	600396	金山股份	665,256.00	6.24
421	600470	六国化工	663,550.85	6.22
422	600780	通宝能源	658,944.77	6.18
423	600600	青岛啤酒	657,954.00	6.17

424	603003	龙宇燃油	657,847.00	6.17
425	000977	浪潮信息	656,938.58	6.16
426	002577	雷柏科技	654,001.00	6.13
427	600295	鄂尔多斯	653,493.00	6.13
428	000488	晨鸣纸业	649,200.00	6.09
429	000905	厦门港务	648,080.00	6.08
430	002642	荣之联	645,119.00	6.05
431	300188	美亚柏科	641,950.00	6.02
432	600141	兴发集团	636,912.00	5.97
433	600496	精工钢构	633,632.83	5.94
434	000619	海螺型材	629,053.00	5.90
435	300163	先锋新材	624,112.00	5.85
436	601928	凤凰传媒	620,755.00	5.82
437	300119	瑞普生物	619,008.73	5.81
438	000755	*ST 三维	617,127.00	5.79
439	300105	龙源技术	616,366.60	5.78
440	002692	睿康股份	615,537.00	5.77
441	600238	海南椰岛	614,865.00	5.77
442	000848	承德露露	611,779.00	5.74
443	002058	威尔泰	609,364.00	5.71
444	000031	中粮地产	606,326.65	5.69
445	002567	唐人神	600,518.20	5.63
446	002387	黑牛食品	597,735.00	5.61
447	600684	珠江实业	597,706.00	5.61
448	600742	一汽富维	597,442.00	5.60
449	600076	康欣新材	597,132.49	5.60
450	600970	中材国际	590,240.49	5.54
451	300477	合纵科技	586,148.36	5.50
452	000625	长安汽车	585,144.00	5.49
453	300312	邦讯技术	583,385.00	5.47
454	601886	江河集团	583,143.00	5.47
455	600862	中航高科	580,726.00	5.45
456	002417	三元达	580,355.00	5.44
457	000851	高鸿股份	580,106.00	5.44
458	603012	创力集团	577,820.00	5.42
459	603618	杭电股份	575,691.00	5.40

460	300165	天瑞仪器	574,948.12	5.39
461	002706	良信电器	574,319.00	5.39
462	300228	富瑞特装	573,528.00	5.38
463	300360	炬华科技	573,402.00	5.38
464	000731	四川美丰	573,187.00	5.38
465	603969	银龙股份	571,626.22	5.36
466	002234	民和股份	571,587.13	5.36
467	002310	东方园林	570,800.00	5.35
468	002733	雄韬股份	569,974.93	5.35
469	300265	通光线缆	569,887.00	5.34
470	600830	香溢融通	568,587.00	5.33
471	000698	沈阳化工	567,882.39	5.33
472	300164	通源石油	565,849.27	5.31
473	000906	浙商中拓	562,063.00	5.27
474	600081	东风科技	560,656.23	5.26
475	000957	中通客车	554,979.05	5.20
476	002607	亚夏汽车	552,162.58	5.18
477	002458	益生股份	551,934.00	5.18
478	600060	海信电器	548,993.52	5.15
479	600109	国金证券	548,975.09	5.15
480	000700	模塑科技	548,875.47	5.15
481	600354	敦煌种业	545,097.00	5.11
482	000550	江铃汽车	544,358.00	5.11
483	002548	金新农	543,267.42	5.09
484	600584	长电科技	541,100.00	5.07
485	603167	渤海轮渡	539,930.00	5.06
486	002062	宏润建设	536,530.00	5.03
487	600501	航天晨光	536,452.00	5.03
488	002039	黔源电力	536,263.00	5.03
489	002357	富临运业	535,359.33	5.02
490	000600	建投能源	535,337.88	5.02
491	600612	老凤祥	529,827.00	4.97
492	300262	巴安水务	529,363.00	4.96
493	000655	金岭矿业	526,326.00	4.94
494	603188	亚邦股份	526,085.00	4.93
495	600881	亚泰集团	524,479.00	4.92

496	600075	新疆天业	522,282.00	4.90
497	600831	广电网络	519,166.00	4.87
498	601929	吉视传媒	516,496.00	4.84
499	000639	西王食品	515,084.92	4.83
500	000910	大亚圣象	510,818.51	4.79
501	600189	吉林森工	509,583.00	4.78
502	002671	龙泉股份	504,515.00	4.73
503	000498	山东路桥	504,352.00	4.73
504	600022	山东钢铁	503,986.00	4.73
505	000023	深天地 A	498,898.35	4.68
506	601985	中国核电	497,733.00	4.67
507	600509	天富能源	492,638.96	4.62
508	300056	三维丝	491,037.00	4.61
509	000528	柳 工	489,500.00	4.59
510	002420	毅昌股份	489,331.00	4.59
511	601890	亚星锚链	489,248.00	4.59
512	002511	中顺洁柔	488,160.00	4.58
513	002048	宁波华翔	487,599.00	4.57
514	600653	申华控股	486,610.00	4.56
515	601390	中国中铁	486,442.00	4.56
516	600121	*ST 郑煤	485,954.00	4.56
517	603519	立霸股份	484,193.00	4.54
518	000921	海信科龙	484,081.00	4.54
519	002713	东易日盛	483,378.83	4.53
520	300298	三诺生物	483,146.19	4.53
521	002680	长生生物	477,435.00	4.48
522	300486	东杰智能	475,226.97	4.46
523	600971	恒源煤电	469,560.00	4.40
524	000529	广弘控股	465,583.00	4.37
525	000628	高新发展	464,474.00	4.36
526	002532	新界泵业	462,191.36	4.33
527	000632	三木集团	461,370.00	4.33
528	603818	曲美家居	456,771.00	4.28
529	300214	日科化学	456,558.00	4.28
530	600626	申达股份	448,596.00	4.21
531	600231	凌钢股份	445,432.00	4.18

532	002482	广田集团	439,616.00	4.12
533	603001	奥康国际	438,017.62	4.11
534	002015	霞客环保	436,629.00	4.09
535	600689	上海三毛	436,611.00	4.09
536	600389	江山股份	436,338.34	4.09
537	002763	汇洁股份	434,495.92	4.07
538	600630	龙头股份	433,886.00	4.07
539	300210	森远股份	433,501.39	4.07
540	600691	阳煤化工	433,092.00	4.06
541	002002	鸿达兴业	433,083.00	4.06
542	002060	粤水电	432,975.15	4.06
543	000782	美达股份	432,713.00	4.06
544	002324	普利特	430,821.62	4.04
545	002722	金轮股份	428,836.77	4.02
546	002372	伟星新材	428,400.50	4.02
547	601208	东材科技	427,615.00	4.01
548	002302	西部建设	427,191.00	4.01
549	002588	史丹利	427,181.00	4.01
550	603518	维格娜丝	425,834.00	3.99
551	600502	安徽水利	425,457.00	3.99
552	002556	辉隆股份	423,778.00	3.97
553	600096	云天化	423,227.00	3.97
554	600986	科达股份	423,204.00	3.97
555	002510	天汽模	422,792.81	3.97
556	002172	澳洋科技	422,725.00	3.96
557	002150	通润装备	422,234.66	3.96
558	601668	中国建筑	422,135.00	3.96
559	300354	东华测试	421,248.00	3.95
560	002154	报喜鸟	420,731.00	3.95
561	002555	三七互娱	417,535.00	3.92
562	002248	*ST 东数	417,016.00	3.91
563	002559	亚威股份	415,876.00	3.90
564	000570	苏常柴 A	415,210.00	3.89
565	000920	南方汇通	414,673.99	3.89
566	601566	九牧王	413,216.00	3.88
567	002543	万和电气	411,801.00	3.86

568	603600	永艺股份	410,784.75	3.85
569	600337	美克家居	410,406.00	3.85
570	601098	中南传媒	403,948.81	3.79
571	002159	三特索道	399,583.00	3.75
572	603008	喜临门	389,883.00	3.66
573	603611	诺力股份	383,951.00	3.60
574	600761	安徽合力	382,974.00	3.59
575	600992	贵绳股份	381,876.00	3.58
576	000530	大冷股份	380,170.00	3.57
577	600860	*ST 京城	378,894.00	3.55
578	600569	安阳钢铁	378,784.00	3.55
579	300341	麦迪电气	377,615.76	3.54
580	601177	杭齿前进	375,906.00	3.53
581	603899	晨光文具	375,128.22	3.52
582	000723	美锦能源	374,161.00	3.51
583	002705	新宝股份	372,882.00	3.50
584	002209	达意隆	371,619.97	3.49
585	002301	齐心集团	364,374.32	3.42
586	000415	渤海金控	364,136.00	3.41
587	600882	广泽股份	358,581.93	3.36
588	002403	爱仕达	354,355.00	3.32
589	000780	*ST 平能	351,142.00	3.29
590	002043	兔宝宝	349,814.98	3.28
591	002517	恺英网络	310,220.12	2.91
592	002327	富安娜	309,043.70	2.90
593	002612	朗姿股份	307,114.17	2.88
594	002293	罗莱生活	306,775.00	2.88
595	002640	跨境通	296,735.00	2.78
596	002721	金一文化	288,635.00	2.71
597	601601	中国太保	282,104.00	2.65
598	601336	新华保险	270,353.00	2.54
599	000721	西安饮食	247,996.00	2.33
600	603199	九华旅游	235,673.37	2.21
601	002186	全聚德	235,068.50	2.20

注：买入金额按买入成交金额（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	000661	长春高新	4,594,384.00	43.09
2	600519	贵州茅台	4,405,751.60	41.32
3	000429	粤高速 A	4,361,069.80	40.90
4	601677	明泰铝业	4,292,089.43	40.25
5	600276	恒瑞医药	4,231,884.00	39.69
6	002202	金风科技	3,752,160.00	35.19
7	002563	森马服饰	3,535,636.00	33.16
8	600036	招商银行	3,347,245.85	31.39
9	002415	海康威视	3,272,432.62	30.69
10	600900	长江电力	3,209,229.80	30.10
11	600019	宝钢股份	3,169,868.70	29.73
12	600004	白云机场	3,142,799.82	29.47
13	603160	汇顶科技	3,007,873.78	28.21
14	300070	碧水源	2,995,816.94	28.10
15	000963	华东医药	2,905,262.00	27.25
16	300182	捷成股份	2,903,501.00	27.23
17	600138	中青旅	2,877,023.00	26.98
18	600708	光明地产	2,846,398.00	26.69
19	600660	福耀玻璃	2,810,491.00	26.36
20	600711	盛屯矿业	2,777,148.74	26.04
21	000028	国药一致	2,775,165.29	26.03
22	000900	现代投资	2,696,326.74	25.29
23	600064	南京高科	2,665,925.90	25.00
24	603986	兆易创新	2,616,236.00	24.54
25	000828	东莞控股	2,599,441.00	24.38
26	600452	涪陵电力	2,597,117.00	24.36
27	000726	鲁泰 A	2,544,479.20	23.86
28	600071	凤凰光学	2,474,924.45	23.21
29	300017	网宿科技	2,470,966.36	23.17
30	000915	山大华特	2,423,475.00	22.73
31	002540	亚太科技	2,365,671.50	22.19
32	000543	皖能电力	2,364,846.18	22.18
33	600335	国机汽车	2,329,189.21	21.84
34	600269	赣粤高速	2,275,327.50	21.34

35	600073	上海梅林	2,252,390.47	21.12
36	002083	孚日股份	2,241,925.40	21.03
37	600054	黄山旅游	2,239,354.00	21.00
38	000650	仁和药业	2,203,309.17	20.66
39	600961	株冶集团	2,200,663.06	20.64
40	002014	永新股份	2,172,186.16	20.37
41	600531	豫光金铅	2,156,894.82	20.23
42	001979	招商蛇口	2,137,413.92	20.05
43	600750	江中药业	2,134,285.00	20.02
44	600027	华电国际	2,126,861.20	19.95
45	600162	香江控股	2,126,420.50	19.94
46	600757	长江传媒	2,119,989.52	19.88
47	600782	新钢股份	2,114,047.77	19.83
48	000960	锡业股份	2,111,542.96	19.80
49	000796	凯撒旅游	2,099,420.51	19.69
50	600668	尖峰集团	2,022,651.67	18.97
51	000708	大冶特钢	2,002,808.14	18.78
52	000701	厦门信达	1,999,616.28	18.75
53	600068	葛洲坝	1,999,400.00	18.75
54	600823	世茂股份	1,992,541.00	18.69
55	600845	宝信软件	1,969,083.14	18.47
56	000418	小天鹅A	1,967,909.72	18.46
57	600461	洪城水业	1,961,537.80	18.40
58	600894	广日股份	1,939,611.95	18.19
59	600697	欧亚集团	1,937,115.92	18.17
60	600206	有研新材	1,923,198.67	18.04
61	600289	ST 信通	1,916,549.54	17.97
62	601313	江南嘉捷	1,909,089.50	17.90
63	600677	航天通信	1,909,054.10	17.90
64	000718	苏宁环球	1,896,279.30	17.78
65	600093	易见股份	1,860,705.34	17.45
66	600033	福建高速	1,858,826.00	17.43
67	002100	天康生物	1,809,566.00	16.97
68	600835	上海机电	1,805,355.96	16.93
69	601688	华泰证券	1,787,822.91	16.77
70	600278	东方创业	1,775,179.70	16.65
71	601231	环旭电子	1,771,506.30	16.61
72	600969	郴电国际	1,770,062.00	16.60

73	601058	赛轮金宇	1,767,842.70	16.58
74	300357	我武生物	1,752,563.15	16.44
75	002133	广宇集团	1,738,672.24	16.31
76	600026	中远海能	1,736,254.33	16.28
77	600508	上海能源	1,683,233.07	15.79
78	600100	同方股份	1,653,289.75	15.51
79	600966	博汇纸业	1,653,179.00	15.50
80	002627	宜昌交运	1,646,806.31	15.44
81	002157	正邦科技	1,638,396.20	15.37
82	600797	浙大网新	1,621,910.00	15.21
83	600271	航天信息	1,619,860.70	15.19
84	600455	博通股份	1,619,155.68	15.18
85	002026	山东威达	1,574,311.81	14.76
86	603128	华贸物流	1,573,407.00	14.76
87	600325	华发股份	1,552,269.00	14.56
88	300074	华平股份	1,537,079.56	14.42
89	002728	特一药业	1,534,056.99	14.39
90	600051	宁波联合	1,528,220.51	14.33
91	600185	格力地产	1,504,681.80	14.11
92	600483	福能股份	1,500,698.73	14.07
93	600350	山东高速	1,499,110.34	14.06
94	300219	鸿利智汇	1,495,691.92	14.03
95	601518	吉林高速	1,493,496.00	14.01
96	000667	美好置业	1,474,824.00	13.83
97	603123	翠微股份	1,463,007.00	13.72
98	600980	北矿科技	1,454,558.00	13.64
99	600810	神马股份	1,448,767.44	13.59
100	002237	恒邦股份	1,445,516.10	13.56
101	300240	飞力达	1,443,882.30	13.54
102	000665	湖北广电	1,427,588.63	13.39
103	002440	闰土股份	1,423,071.26	13.35
104	600713	南京医药	1,417,677.20	13.30
105	601636	旗滨集团	1,409,028.60	13.21
106	000021	深科技	1,401,455.40	13.14
107	002309	中利集团	1,396,043.06	13.09
108	000978	桂林旅游	1,396,000.30	13.09
109	002441	众业达	1,395,888.12	13.09
110	000876	新希望	1,376,778.00	12.91

111	600176	中国巨石	1,375,426.60	12.90
112	002270	华明装备	1,370,933.96	12.86
113	002171	楚江新材	1,367,380.79	12.82
114	300206	理邦仪器	1,365,677.38	12.81
115	600126	杭钢股份	1,364,484.00	12.80
116	600808	马钢股份	1,362,072.00	12.77
117	002737	葵花药业	1,361,099.58	12.76
118	002088	鲁阳节能	1,359,012.06	12.75
119	601088	中国神华	1,349,584.90	12.66
120	002281	光迅科技	1,347,896.12	12.64
121	600067	冠城大通	1,343,166.00	12.60
122	002462	嘉事堂	1,322,267.00	12.40
123	600177	雅戈尔	1,318,889.93	12.37
124	002727	一心堂	1,313,482.80	12.32
125	002641	永高股份	1,312,967.50	12.31
126	600035	楚天高速	1,307,005.60	12.26
127	601678	滨化股份	1,306,549.50	12.25
128	600795	国电电力	1,300,135.00	12.19
129	000679	大连友谊	1,299,294.88	12.19
130	002267	陕天然气	1,298,500.83	12.18
131	600637	东方明珠	1,293,187.04	12.13
132	600104	上汽集团	1,291,635.00	12.11
133	600252	中恒集团	1,290,571.87	12.10
134	600704	物产中大	1,288,690.00	12.09
135	600439	瑞贝卡	1,285,021.00	12.05
136	600606	绿地控股	1,282,849.61	12.03
137	600499	科达洁能	1,281,024.14	12.01
138	000883	湖北能源	1,279,630.90	12.00
139	000990	诚志股份	1,278,875.68	11.99
140	600011	华能国际	1,277,200.13	11.98
141	600567	山鹰纸业	1,274,390.09	11.95
142	600975	新五丰	1,271,956.74	11.93
143	300039	上海凯宝	1,269,353.60	11.90
144	600548	深高速	1,264,355.00	11.86
145	002534	杭锅股份	1,263,474.48	11.85
146	600688	上海石化	1,262,024.29	11.84
147	000919	金陵药业	1,261,289.38	11.83
148	300067	安诺其	1,260,068.80	11.82

149	600642	申能股份	1,258,499.20	11.80
150	601222	林洋能源	1,255,804.00	11.78
151	000719	大地传媒	1,255,242.90	11.77
152	000030	富奥股份	1,255,136.60	11.77
153	000006	深振业 A	1,254,730.82	11.77
154	002626	金达威	1,251,442.11	11.74
155	600748	上实发展	1,248,996.25	11.71
156	300274	阳光电源	1,243,031.00	11.66
157	600741	华域汽车	1,242,542.38	11.65
158	300269	联建光电	1,239,983.43	11.63
159	300108	吉药控股	1,236,255.80	11.59
160	600377	宁沪高速	1,235,946.03	11.59
161	300048	合康新能	1,231,833.20	11.55
162	000069	华侨城 A	1,231,592.70	11.55
163	000059	华锦股份	1,231,496.40	11.55
164	000703	恒逸石化	1,230,980.91	11.54
165	000521	美菱电器	1,224,470.00	11.48
166	600811	东方集团	1,223,110.75	11.47
167	002001	新 和 成	1,219,007.30	11.43
168	600805	悦达投资	1,217,797.98	11.42
169	300326	凯利泰	1,217,111.76	11.41
170	300339	润和软件	1,214,530.00	11.39
171	600292	远达环保	1,207,261.16	11.32
172	600210	紫江企业	1,205,622.80	11.31
173	600170	上海建工	1,204,462.00	11.30
174	601339	百隆东方	1,202,042.74	11.27
175	600039	四川路桥	1,201,401.60	11.27
176	000751	锌业股份	1,199,847.60	11.25
177	300026	红日药业	1,198,640.60	11.24
178	002135	东南网架	1,198,374.50	11.24
179	002045	国光电器	1,197,461.00	11.23
180	000732	泰禾集团	1,195,796.14	11.21
181	002118	紫鑫药业	1,195,264.00	11.21
182	000898	鞍钢股份	1,193,916.80	11.20
183	002063	远光软件	1,192,806.00	11.19
184	000587	金洲慈航	1,191,092.77	11.17
185	600585	海螺水泥	1,190,585.22	11.17
186	002092	中泰化学	1,189,635.20	11.16

187	603168	莎普爱思	1,189,260.72	11.15
188	601233	桐昆股份	1,189,155.40	11.15
189	000531	穗恒运 A	1,188,896.90	11.15
190	002147	新光圆成	1,187,681.00	11.14
191	000552	靖远煤电	1,185,961.00	11.12
192	600846	同济科技	1,179,242.63	11.06
193	300282	汇冠股份	1,179,160.50	11.06
194	000936	华西股份	1,174,830.23	11.02
195	000761	本钢板材	1,173,307.94	11.00
196	000420	吉林化纤	1,169,842.00	10.97
197	600513	联环药业	1,169,834.00	10.97
198	002013	中航机电	1,165,916.62	10.93
199	000951	中国重汽	1,162,926.86	10.91
200	601579	会稽山	1,162,567.99	10.90
201	002033	丽江旅游	1,161,820.80	10.90
202	600665	天地源	1,159,135.00	10.87
203	600510	黑牡丹	1,157,865.57	10.86
204	000813	德展健康	1,157,004.00	10.85
205	600129	太极集团	1,154,653.26	10.83
206	600308	华泰股份	1,153,872.95	10.82
207	002394	联发股份	1,152,758.12	10.81
208	002203	海亮股份	1,150,800.00	10.79
209	600467	好当家	1,147,641.16	10.76
210	002087	新野纺织	1,146,057.16	10.75
211	000055	方大集团	1,144,105.13	10.73
212	600346	恒力股份	1,140,294.60	10.69
213	300236	上海新阳	1,138,275.35	10.68
214	002515	金字火腿	1,136,472.80	10.66
215	002541	鸿路钢构	1,135,592.33	10.65
216	002344	海宁皮城	1,132,840.15	10.62
217	603939	益丰药房	1,128,450.76	10.58
218	600891	秋林集团	1,127,563.50	10.57
219	600557	康缘药业	1,126,246.54	10.56
220	002452	长高集团	1,125,919.80	10.56
221	600435	北方导航	1,124,215.00	10.54
222	000686	东北证券	1,121,519.71	10.52
223	300207	欣旺达	1,121,440.73	10.52
224	601699	潞安环能	1,120,688.95	10.51

225	600960	渤海活塞	1,117,073.13	10.48
226	002037	久联发展	1,116,285.37	10.47
227	600236	桂冠电力	1,112,988.33	10.44
228	002194	武汉凡谷	1,102,522.47	10.34
229	600562	国睿科技	1,102,495.72	10.34
230	603883	老百姓	1,097,350.20	10.29
231	600057	象屿股份	1,089,909.80	10.22
232	002352	顺丰控股	1,078,083.80	10.11
233	002017	东信和平	1,077,902.57	10.11
234	600990	四创电子	1,076,437.00	10.10
235	603609	禾丰牧业	1,074,605.90	10.08
236	000513	丽珠集团	1,068,621.00	10.02
237	300139	晓程科技	1,062,084.70	9.96
238	000488	晨鸣纸业	1,058,565.00	9.93
239	002313	日海通讯	1,057,898.00	9.92
240	600216	浙江医药	1,043,149.77	9.78
241	002310	东方园林	1,036,983.00	9.73
242	600998	九州通	1,034,548.80	9.70
243	002618	丹邦科技	1,018,169.80	9.55
244	002369	卓翼科技	1,010,690.00	9.48
245	002056	横店东磁	1,002,541.86	9.40
246	300031	宝通科技	1,002,016.90	9.40
247	600261	阳光照明	999,901.40	9.38
248	600418	江淮汽车	996,585.00	9.35
249	000823	超声电子	993,819.00	9.32
250	002165	红宝丽	992,256.46	9.31
251	002470	金正大	991,864.00	9.30
252	600288	大恒科技	987,920.10	9.26
253	600529	山东药玻	985,066.53	9.24
254	600327	大东方	983,627.52	9.22
255	002582	好想你	980,869.95	9.20
256	600694	大商股份	978,590.30	9.18
257	000597	东北制药	973,380.00	9.13
258	000637	茂化实华	972,144.34	9.12
259	002187	广百股份	969,510.26	9.09
260	600829	人民同泰	966,373.82	9.06
261	000421	南京公用	964,297.23	9.04
262	002236	大华股份	959,990.35	9.00

263	600285	羚锐制药	957,145.60	8.98
264	600584	长电科技	956,025.00	8.97
265	600597	光明乳业	953,920.40	8.95
266	600976	健民集团	953,090.00	8.94
267	603989	艾华集团	951,864.96	8.93
268	002057	中钢天源	950,459.80	8.91
269	002412	汉森制药	949,520.60	8.90
270	000790	泰合健康	945,449.20	8.87
271	600983	惠而浦	934,219.19	8.76
272	600062	华润双鹤	933,332.00	8.75
273	300424	航新科技	931,245.80	8.73
274	000705	浙江震元	929,382.70	8.72
275	300012	华测检测	926,688.40	8.69
276	600077	宋都股份	925,398.60	8.68
277	000422	湖北宜化	923,982.57	8.67
278	000404	华意压缩	921,889.40	8.65
279	002182	云海金属	919,985.00	8.63
280	002294	信立泰	919,385.00	8.62
281	603366	日出东方	913,551.00	8.57
282	000411	英特集团	913,114.96	8.56
283	000795	英洛华	911,457.80	8.55
284	002467	二六三	910,831.26	8.54
285	002550	千红制药	908,106.00	8.52
286	000523	广州浪奇	907,118.96	8.51
287	300389	艾比森	906,031.97	8.50
288	002314	南山控股	904,876.80	8.49
289	600237	铜峰电子	901,503.86	8.45
290	600623	华谊集团	899,576.40	8.44
291	300049	福瑞股份	898,280.70	8.42
292	600207	安彩高科	894,316.64	8.39
293	600315	上海家化	890,483.80	8.35
294	600020	中原高速	890,305.00	8.35
295	000989	九芝堂	889,374.25	8.34
296	300227	光韵达	885,850.16	8.31
297	002566	益盛药业	883,412.00	8.28
298	300398	飞凯材料	874,128.74	8.20
299	600768	宁波富邦	867,997.90	8.14
300	000702	正虹科技	866,030.90	8.12

301	300303	聚飞光电	864,816.00	8.11
302	000905	厦门港务	861,100.00	8.08
303	600847	*ST 万里	860,394.78	8.07
304	000958	东方能源	859,940.00	8.06
305	002196	方正电机	859,276.88	8.06
306	000681	视觉中国	858,871.49	8.05
307	600517	置信电气	858,327.00	8.05
308	300238	冠昊生物	856,412.60	8.03
309	600594	益佰制药	855,814.90	8.03
310	002719	麦趣尔	848,970.00	7.96
311	002557	洽洽食品	845,984.59	7.93
312	600426	华鲁恒升	844,583.40	7.92
313	600203	福日电子	844,180.00	7.92
314	601218	吉鑫科技	844,170.00	7.92
315	002712	思美传媒	839,499.80	7.87
316	603100	川仪股份	835,887.85	7.84
317	600683	京投发展	826,901.71	7.75
318	600729	重庆百货	826,284.01	7.75
319	600458	时代新材	824,933.20	7.74
320	600850	华东电脑	824,543.20	7.73
321	600889	南京化纤	821,046.30	7.70
322	000402	金融街	816,157.80	7.65
323	300076	GQY 视讯	811,965.70	7.61
324	000966	长源电力	807,585.30	7.57
325	002533	金杯电工	803,989.00	7.54
326	000043	中航地产	802,318.00	7.52
327	002184	海得控制	801,589.38	7.52
328	000733	振华科技	793,673.40	7.44
329	002130	沃尔核材	792,376.84	7.43
330	000908	景峰医药	790,193.00	7.41
331	600287	江苏舜天	788,807.67	7.40
332	600366	宁波韵升	784,687.35	7.36
333	002574	明牌珠宝	782,553.08	7.34
334	600038	中直股份	774,526.40	7.26
335	300226	上海钢联	773,764.18	7.26
336	600295	鄂尔多斯	771,232.50	7.23
337	600305	恒顺醋业	770,241.60	7.22
338	600052	浙江广厦	766,268.25	7.19

339	002731	萃华珠宝	759,150.55	7.12
340	600248	延长化建	754,478.90	7.08
341	000899	赣能股份	753,887.08	7.07
342	002124	天邦股份	748,942.20	7.02
343	600997	开滦股份	748,389.40	7.02
344	601126	四方股份	741,714.20	6.96
345	600875	东方电气	740,717.60	6.95
346	002419	天虹股份	740,426.00	6.94
347	000926	福星股份	731,930.00	6.86
348	000785	武汉中商	731,602.28	6.86
349	002225	濮耐股份	730,806.00	6.85
350	300365	恒华科技	730,636.80	6.85
351	600058	五矿发展	730,483.93	6.85
352	002567	唐人神	723,964.63	6.79
353	600561	江西长运	723,546.10	6.79
354	000759	中百集团	719,955.44	6.75
355	601139	深圳燃气	717,512.46	6.73
356	300264	佳创视讯	717,121.17	6.73
357	600718	东软集团	716,363.00	6.72
358	600268	国电南自	716,154.54	6.72
359	600537	亿晶光电	711,345.00	6.67
360	600600	青岛啤酒	709,944.38	6.66
361	002350	北京科锐	709,713.60	6.66
362	603020	爱普股份	708,354.70	6.64
363	600973	宝胜股份	707,955.40	6.64
364	000036	华联控股	706,945.21	6.63
365	600723	首商股份	704,966.78	6.61
366	002216	三全食品	704,666.60	6.61
367	002528	英飞拓	701,461.25	6.58
368	300231	银信科技	699,169.46	6.56
369	000555	神州信息	694,190.35	6.51
370	002366	台海核电	693,621.36	6.50
371	600141	兴发集团	691,764.00	6.49
372	603223	恒通股份	691,732.50	6.49
373	603003	龙宇燃油	685,109.00	6.43
374	600496	精工钢构	680,191.60	6.38
375	002231	奥维通信	677,428.65	6.35
376	002471	中超控股	676,605.80	6.35

377	600742	一汽富维	676,439.96	6.34
378	600780	通宝能源	673,318.30	6.31
379	600684	珠江实业	672,615.80	6.31
380	002159	三特索道	670,522.40	6.29
381	600769	祥龙电业	668,710.22	6.27
382	300286	安科瑞	666,157.50	6.25
383	600476	湘邮科技	657,786.00	6.17
384	300378	鼎捷软件	652,848.37	6.12
385	300396	迪瑞医疗	652,423.43	6.12
386	000668	荣丰控股	650,186.00	6.10
387	600323	瀚蓝环境	647,872.00	6.08
388	002396	星网锐捷	636,964.00	5.97
389	600898	国美通讯	635,824.60	5.96
390	000977	浪潮信息	633,686.00	5.94
391	002082	栋梁新材	630,302.00	5.91
392	000031	中粮地产	629,171.70	5.90
393	600396	金山股份	628,822.40	5.90
394	600356	恒丰纸业	627,568.60	5.89
395	600235	民丰特纸	626,885.69	5.88
396	600470	六国化工	623,147.20	5.84
397	601928	凤凰传媒	617,057.60	5.79
398	002615	哈尔斯	616,167.20	5.78
399	300312	邦讯技术	615,617.20	5.77
400	002302	西部建设	612,726.76	5.75
401	002058	威尔泰	611,862.82	5.74
402	600970	中材国际	610,287.00	5.72
403	000848	承德露露	609,670.00	5.72
404	002387	黑牛食品	603,859.00	5.66
405	600238	海南椰岛	601,887.00	5.64
406	300265	通光线缆	600,560.92	5.63
407	000957	中通客车	597,419.96	5.60
408	000910	大亚圣象	595,839.00	5.59
409	603969	银龙股份	591,062.21	5.54
410	002577	雷柏科技	590,980.70	5.54
411	600075	新疆天业	590,265.00	5.54
412	600830	香溢融通	585,647.00	5.49
413	000755	*ST 三维	583,086.82	5.47
414	000731	四川美丰	581,452.00	5.45

415	601886	江河集团	579,450.00	5.43
416	000625	长安汽车	576,214.60	5.40
417	603618	杭电股份	575,922.40	5.40
418	000619	海螺型材	571,558.60	5.36
419	000851	高鸿股份	569,766.40	5.34
420	300119	瑞普生物	567,806.32	5.33
421	600060	海信电器	565,575.00	5.30
422	300105	龙源技术	565,001.90	5.30
423	300163	先锋新材	563,752.00	5.29
424	002417	三元达	563,140.99	5.28
425	000921	海信科龙	560,618.20	5.26
426	600109	国金证券	560,616.00	5.26
427	002692	睿康股份	557,280.00	5.23
428	600862	中航高科	556,554.00	5.22
429	600612	老凤祥	556,530.40	5.22
430	002706	良信电器	552,181.07	5.18
431	000698	沈阳化工	550,561.30	5.16
432	300165	天瑞仪器	548,606.13	5.14
433	000700	模塑科技	548,506.00	5.14
434	603167	渤海轮渡	546,981.00	5.13
435	600076	康欣新材	545,592.60	5.12
436	002062	宏润建设	543,995.50	5.10
437	600881	亚泰集团	540,156.40	5.07
438	300164	通源石油	540,039.80	5.06
439	603188	亚邦股份	538,336.00	5.05
440	300228	富瑞特装	537,419.20	5.04
441	300262	巴安水务	537,257.00	5.04
442	600971	恒源煤电	536,164.80	5.03
443	300477	合纵科技	535,262.00	5.02
444	603012	创力集团	533,943.08	5.01
445	000600	建投能源	533,522.10	5.00
446	600081	东风科技	525,829.12	4.93
447	300360	炬华科技	525,765.90	4.93
448	000550	江铃汽车	524,282.20	4.92
449	000906	浙商中拓	524,273.64	4.92
450	002548	金新农	522,997.10	4.90
451	601890	亚星锚链	522,610.00	4.90
452	002039	黔源电力	521,790.95	4.89

453	002733	雄韬股份	521,385.00	4.89
454	000528	柳工	519,763.60	4.87
455	002511	中顺洁柔	519,437.23	4.87
456	002642	荣之联	514,963.00	4.83
457	601390	中国中铁	507,506.60	4.76
458	002357	富临运业	504,741.00	4.73
459	600022	山东钢铁	501,997.00	4.71
460	600831	广电网络	500,893.00	4.70
461	601929	吉视传媒	500,550.00	4.69
462	601985	中国核电	497,336.00	4.66
463	002146	荣盛发展	495,011.84	4.64
464	002607	亚夏汽车	494,697.70	4.64
465	000655	金岭矿业	491,565.60	4.61
466	600501	航天晨光	490,517.32	4.60
467	600354	敦煌种业	489,750.23	4.59
468	002458	益生股份	487,258.20	4.57
469	603519	立霸股份	485,543.50	4.55
470	601668	中国建筑	484,107.00	4.54
471	002060	粤水电	482,083.00	4.52
472	000498	山东路桥	481,041.80	4.51
473	002671	龙泉股份	480,688.54	4.51
474	002048	宁波华翔	480,560.00	4.51
475	002713	东易日盛	479,300.00	4.50
476	002482	广田集团	476,546.80	4.47
477	000023	深天地A	475,269.00	4.46
478	002234	民和股份	474,019.00	4.45
479	600653	申华控股	470,622.00	4.41
480	600189	吉林森工	469,120.00	4.40
481	002002	鸿达兴业	465,155.00	4.36
482	600509	天富能源	462,395.00	4.34
483	300298	三诺生物	461,974.17	4.33
484	000639	西王食品	460,447.22	4.32
485	600121	*ST 郑煤	458,606.40	4.30
486	000628	高新发展	458,050.00	4.30
487	000632	三木集团	456,803.91	4.28
488	600231	凌钢股份	453,865.50	4.26
489	002543	万和电气	452,956.02	4.25
490	300486	东杰智能	451,127.00	4.23

491	600028	中国石化	450,956.00	4.23
492	300056	三维丝	450,317.00	4.22
493	600337	美克家居	447,163.06	4.19
494	603518	维格娜丝	446,102.44	4.18
495	000529	广弘控股	445,773.00	4.18
496	603001	奥康国际	443,526.99	4.16
497	002510	天汽模	441,452.00	4.14
498	603818	曲美家居	440,721.52	4.13
499	603600	永艺股份	439,878.36	4.13
500	300354	东华测试	439,630.12	4.12
501	600389	江山股份	436,855.38	4.10
502	002559	亚威股份	436,159.00	4.09
503	002722	金轮股份	434,182.00	4.07
504	002015	霞客环保	433,361.05	4.06
505	002555	三七互娱	432,381.50	4.05
506	002680	长生生物	430,103.07	4.03
507	002324	普利特	429,632.17	4.03
508	601566	九牧王	426,862.18	4.00
509	600986	科达股份	426,154.00	4.00
510	600502	安徽水利	425,154.00	3.99
511	600691	阳煤化工	423,776.00	3.97
512	002532	新界泵业	422,956.00	3.97
513	002420	毅昌股份	421,831.34	3.96
514	002372	伟星新材	417,678.40	3.92
515	600626	申达股份	416,225.60	3.90
516	002172	澳洋科技	415,095.92	3.89
517	600630	龙头股份	413,252.00	3.88
518	601208	东材科技	412,550.30	3.87
519	601098	中南传媒	411,613.12	3.86
520	000920	南方汇通	409,495.80	3.84
521	002763	汇洁股份	407,680.00	3.82
522	002588	史丹利	406,796.56	3.82
523	000530	大冷股份	406,554.00	3.81
524	002301	齐心集团	406,544.23	3.81
525	000782	美达股份	406,030.00	3.81
526	002705	新宝股份	405,891.40	3.81
527	000601	韶能股份	405,640.40	3.80
528	002154	报喜鸟	404,335.80	3.79

529	300214	日科化学	403,453.05	3.78
530	600096	云天化	399,503.50	3.75
531	601177	杭齿前进	396,835.00	3.72
532	002556	辉隆股份	396,255.60	3.72
533	600569	安阳钢铁	394,483.60	3.70
534	600689	上海三毛	392,044.30	3.68
535	300210	森远股份	390,340.48	3.66
536	600761	安徽合力	388,050.87	3.64
537	000415	渤海金控	379,955.00	3.56
538	000570	苏常柴A	378,276.20	3.55
539	002209	达意隆	376,178.00	3.53
540	600992	贵绳股份	375,666.00	3.52
541	300341	麦迪电气	373,828.00	3.51
542	603899	晨光文具	368,927.77	3.46
543	603611	诺力股份	363,954.00	3.41
544	603008	喜临门	360,829.00	3.38
545	002150	通润装备	360,356.40	3.38
546	600860	*ST京城	359,433.00	3.37
547	600882	广泽股份	349,914.00	3.28
548	000723	美锦能源	341,084.00	3.20
549	002403	爱仕达	341,053.80	3.20
550	002043	兔宝宝	339,801.40	3.19
551	000780	*ST平能	332,588.00	3.12
552	300699	光威复材	320,176.80	3.00
553	601108	财通证券	310,926.00	2.92
554	002327	富安娜	292,627.80	2.74
555	002248	*ST东数	287,478.00	2.70
556	002293	罗莱生活	287,181.30	2.69
557	002721	金一文化	284,873.40	2.67
558	002612	朗姿股份	277,759.00	2.60
559	600048	保利地产	274,920.00	2.58
560	002640	跨境通	269,910.52	2.53
561	601601	中国太保	268,491.50	2.52
562	002517	恺英网络	267,912.60	2.51
563	000721	西安饮食	264,266.00	2.48
564	601336	新华保险	260,629.00	2.44
565	601326	秦港股份	244,667.22	2.29
566	002186	全聚德	240,131.00	2.25

567	603199	九华旅游	236,852.11	2.22
568	002008	大族激光	230,772.95	2.16
569	603260	合盛硅业	220,583.59	2.07
570	000965	天保基建	215,424.00	2.02

注：卖出金额按卖出成交金额（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	729,404,702.50
卖出股票收入（成交）总额	619,122,845.92

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,980,000.00	4.41
	其中：政策性金融债	9,980,000.00	4.41
4	企业债券	625,968.20	0.28
5	企业短期融资券	9,986,000.00	4.42
6	中期票据	40,211,000.00	17.79
7	可转债（可交换债）	9,000.00	0.00
8	同业存单	47,577,000.00	21.05
9	其他	-	-
10	合计	108,388,968.20	47.94

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111714258	17 江苏银行 CD258	200,000	19,018,000.00	8.41
2	1382023	13 陕交建 MTN1	100,000	10,119,000.00	4.48
3	101364002	13 豫水利 MTN002	100,000	10,086,000.00	4.46
4	1382075	13 皖投 MTN1	100,000	10,071,000.00	4.45
5	041751029	17 重汽 CP001	100,000	9,986,000.00	4.42

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

注：本基金本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

注：本基金报告期内未持有股指期货投资，也无期间损益。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金报告期内未参与股指期货交易。

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

注：本基金报告期内未参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金报告期内未持有国债期货投资，也无期间损益。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金报告期内未参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2

基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

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	9,723.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,494,263.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,503,986.98

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：报告期内，本基金所持可转换债券均不处于转股期。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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

份额级别	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
红塔红土优质成长 A	96	2,221,665.66	213,202,642.49	99.96%	77,261.33	0.04%
红塔红土优质成长 C	116	4,635.40	0.00	0.00%	537,706.34	100.00%
合计	212	1,008,573.63	213,202,642.49	99.71%	614,967.67	0.29%

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）；

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	红塔红土优质成长 A	4,234.78	0.0020%
	红塔红土优质成长 C	506,067.78	94.1160%
	合计	510,302.56	0.2387%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	份额级别	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	红塔红土优质成长 A	0~10
	红塔红土优质成长 C	50~100

有本开放式基金	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	红塔红土优质成长 A	0~10
	红塔红土优质成长 C	0
	合计	0~10

9.4 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	10,000,100.00	4.68	10,000,100.00	4.68	3年
基金管理人高级管理人员	503,462.10	0.24	-	-	-
基金经理等人员	1,255.10	0.00	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	5,585.36	0.00	-	-	-
合计	10,510,302.56	4.92	10,000,100.00	4.68	3年

注：1、上述份额总数为扣除认购费用并包含利息结转份额后的总份额数；

2、本基金发起式资金提供方仅为基金管理人，基金管理人基金经理、其他从业人员认购的基金份额不属于发起份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	红塔红土优质成 长 A	红塔红土优质成 长 C
基金合同生效日（2015 年 8 月 6 日）基金份 额总额	20,165,621.38	814,503.27
本报告期期初基金份额总额	10,167,386.83	650,003.71
本报告期基金总申购份额	335,771,495.70	288,247.36
减:本报告期基金总赎回份额	132,658,978.71	400,544.73
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	213,279,903.82	537,706.34

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

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

本报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

本基金管理人于 2017 年 3 月 2 日公告，自 2017 年 3 月 2 日起增聘林睿为红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理，同时赵耀不再担任红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。

本基金管理人于 2017 年 8 月 31 日进行公告，自 2017 年 8 月 29 日起林睿不再担任红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。

2017 年 10 月 29 日，徐骥任公司董事，原董事施安平不再任公司董事。

2017 年 10 月 29 日，刘珍任公司监事，原监事徐骥不再任公司监事。

本报告期内，基金托管人的重大人事变动如下：

自 2017 年 8 月起，马宇阳先生担任广州农村商业银行股份有限公司资产托管部副总经理。

简历：马宇阳先生，工学硕士。曾任深圳发展银行广州分行科技部副总经理、贸易融资部经理，广州市信用合作联社公司业务部经理，广州农村商业银行总行公司金融部经理，北京门头沟珠江村镇银行董事长，广州农村商业银行北京业务部风险总监，广州农村商业银行总行资产管理部副总经理（主持工作），花都支行副行长，广州农村商业银行总行授信审批部一级审批人。2017 年 8 月起，担任广州农村商业银行总行资产托管部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、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

本基金本报告期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

报告期内应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费用为 50,000.00 元。该审计机构自基金合同生效日起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

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
中金公司	2	900,014,388.52	67.02%	658,181.74	61.83%	新增
华创证券	1	229,216,550.15	17.07%	213,469.93	20.05%	-
红塔证券	1	152,051,319.64	11.32%	141,605.28	13.30%	-
长城证券	2	30,980,567.61	2.31%	28,852.27	2.71%	-
华龙证券	1	30,553,758.19	2.28%	22,343.85	2.10%	新增

注：本基金管理人在租用证券机构交易单元上符合中国证监会的有关规定。本基金管理人将证券经营机构的注册资本、研究水平、财务状况、经营状况、经营行为以及通讯交易条件作为基金专用交易单元的选择标准，由研究部、投资部及交易部对券商进行考评并提出交易单元租用及更换方案。

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
中金公司	1,651,635.00	59.24%	54,900,000.00	21.73%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	1,135,330.81	40.72%	156,500,000.00	61.96%	-	-
长城证券	-	-	2,000,000.00	0.79%	-	-

华龙证券	1,266.40	0.05%	39,200,000.00	15.52%	-	-
------	----------	-------	---------------	--------	---	---

注：1、本报告期内本基金未发生交易所权证交易。

2、本报告期内本基金未发生交易所基金交易。

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	关于红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金暂停大额申购业务的公告	证券时报、证券日报、管理人网站	2017年1月17日
2	红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金2016年第4季度报告	证券时报、证券日报、管理人网站	2017年1月20日
3	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017年2月20日
4	红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、证券日报、管理人网站	2017年3月2日
5	红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金恢复大额申购业务的公告	证券时报、证券日报、管理人网站	2017年3月9日
6	红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金更新招募说明书及摘要(2017年1号)	证券时报、证券日报、管理人网站	2017年3月21日
7	关于红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金暂停大额申购业务的公告	证券时报、证券日报、管理人网站	2017年3月28日
8	红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金2016年度报告及摘要	证券时报、证券日报、管理人网站	2017年3月28日
9	红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金2017年第1季度报告	证券时报、证券日报、管理人网站	2017年4月24日
10	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017年5月17日
11	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017年7月17日
12	红塔红土优质成长灵活配置	证券时报、证券日	2017年7月20日

	混合型发起式证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	报、管理人网站	
13	红塔红土基金管理有限公司 关于旗下基金新增代销机构 的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、管理人网站	2017 年 8 月 1 日
14	红塔红土优质成长灵活配置 混合型发起式证券投资基金 2017 半年度报告及摘要	证券时报、证券日 报、管理人网站	2017 年 8 月 25 日
15	红塔红土优质成长灵活配置 混合型发起式证券投资基金 2017 年临时公告_基金经理变 更公告	证券时报、证券日 报、管理人网站	2017 年 8 月 30 日
16	关于红塔红土优质成长灵活 配置混合型发起式证券投资 基金更新招募说明书摘要 (2017 年 2 号)	证券时报、证券日 报、管理人网站	2017 年 9 月 20 日
17	红塔红土优质成长灵活配置 混合型发起式证券投资基金 2017 年第 3 季度报告	证券时报、证券日 报、管理人网站	2017 年 10 月 25 日
18	红塔红土基金管理有限公司 关于公司注册资本及股权变 更的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、管理人网站	2017 年 11 月 16 日
19	红塔红土基金管理有限公司 关于公司法定代表人变更的 公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、管理人网站	2017 年 11 月 16 日
20	红塔红土基金管理有限公司 关于旗下基金新增代销机构 的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、管理人网站	2017 年 11 月 17 日
21	红塔红土基金管理有限公司 关于子公司深圳市红塔资产 管理有限公司增加注册资本 的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、管理人网站	2017 年 12 月 5 日
22	红塔红土基金管理有限公司 关于基金经理罗薇因休产假 暂停履行职务的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、管理人网站	2017 年 12 月 12 日
23	红塔红土基金管理有限公司 关于旗下基金新增代销机构 的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、管理人网站	2017 年 12 月 22 日
24	红塔红土基金管理有限公司 关于旗下部分基金开展网上 直销费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、管理人网站	2017 年 12 月 28 日
25	红塔红土基金管理有限公司 关于旗下部分开放式基金开 通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、管理人网站	2017 年 12 月 29 日

26	红塔红土基金管理有限公司 关于旗下证券投资基金缴纳 增值税的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报、管理人网站	2017 年 12 月 30 日
----	--	-------------------------------------	------------------

§ 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	2017-01-01 至 2017-12-31	71,008,216.68	132,194,325.81	-	203,202,542.49	95.04%
	2	2017-01-03 至 2017-03-24	-	131,872,489.35	131,872,489.35	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本报告期内，本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情形，可能出现大额赎回导致基金净值波动的风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产导致投资者赎回申请延期办理的风险。敬请投资者留意。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据 2016 年 12 月 25 日财政部、国家税务总局联合下发的《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）、2017 年 1 月 10 日财政部、国家税务总局联合下发的《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）及财政部 2017 年 6 月 30 日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56 号）的通知，现明确自 2018 年 1 月 1 日起，基金管理人运营公募基金及资管产品（以下简称“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。

自 2018 年 1 月 1 日（含）起，本基金管理人将对旗下存续及新增产品发生的增值税应税行为按照相关规定以及税务机关的要求计算和缴纳增值税税款及附加税费。前述税款及附加税费是产品管理、运作和处分过程中发生的，将由产品资产承担，从产品资产中提取缴纳，可能对产品收益水平有所影响，敬请广大投资者知悉。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同；
- 3、红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议；
- 4、红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书；
- 5、报告期内披露的各项公告。

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所：广东省深圳市南山区侨香路 4068 号智慧广场 A 栋 801

基金托管人的办公场所：广州市珠江新城华夏路 1 号信合大厦 16 楼

13.3 查阅方式

投资者可通过基金管理人网站，或在营业期间到基金管理人、基金托管人的办公场所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

客服热线：4001-666-916（免长途话费）

公司网址：www.htamc.com.cn

红塔红土基金管理有限公司

2018 年 3 月 27 日