

# 红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资 基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：红土创新基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 30 日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	红土创新新兴产业混合
基金主代码	001753
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 9 月 23 日
基金管理人	红土创新基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	93,090,143.53 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过灵活的资产配置和对新兴产业的投资管理，拓展大类资产配置空间，在精选处于新兴产业中个股的基础上适度集中投资，在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期增值。
投资策略	本基金的资产配置主要是基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。在股票投资策略方面，本基金将从新兴产业中优选预期成长性较好的公司的股票进行投资。本基金所指的预期成长性较好的公司是指公司所在行业景气度较高且具有可持续性、公司所在行业竞争格局良好以及公司管理层素质较高等标准的公司。在债券投资策略方面，本基金主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。同时，本基金将根据对现货和期货市场的分析，采取多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60% + 中证全债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		红土创新基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张洗尘	田青
	联系电话	0755-33011878	010-67595096
	电子邮箱	zhangxc@htcfund.com	tianqingl.zh@ccb.com

客户服务电话	0755-33011866	010-67595096
传真	0755-33011855	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

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

## § 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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-13,232,517.57	9,167,091.32	-26,036,274.70
本期利润	-23,650,817.39	13,532,243.58	-27,962,081.94
加权平均基金份额本期利润	-0.2487	0.1103	-0.1766
本期基金份额净值增长率	-26.60%	11.90%	-16.67%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3104	-0.0800	-0.1597
期末基金资产净值	64,190,444.38	97,998,042.67	111,175,119.62
期末基金份额净值	0.690	0.940	0.840

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润, 采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额, 不是当期发生数)。

3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

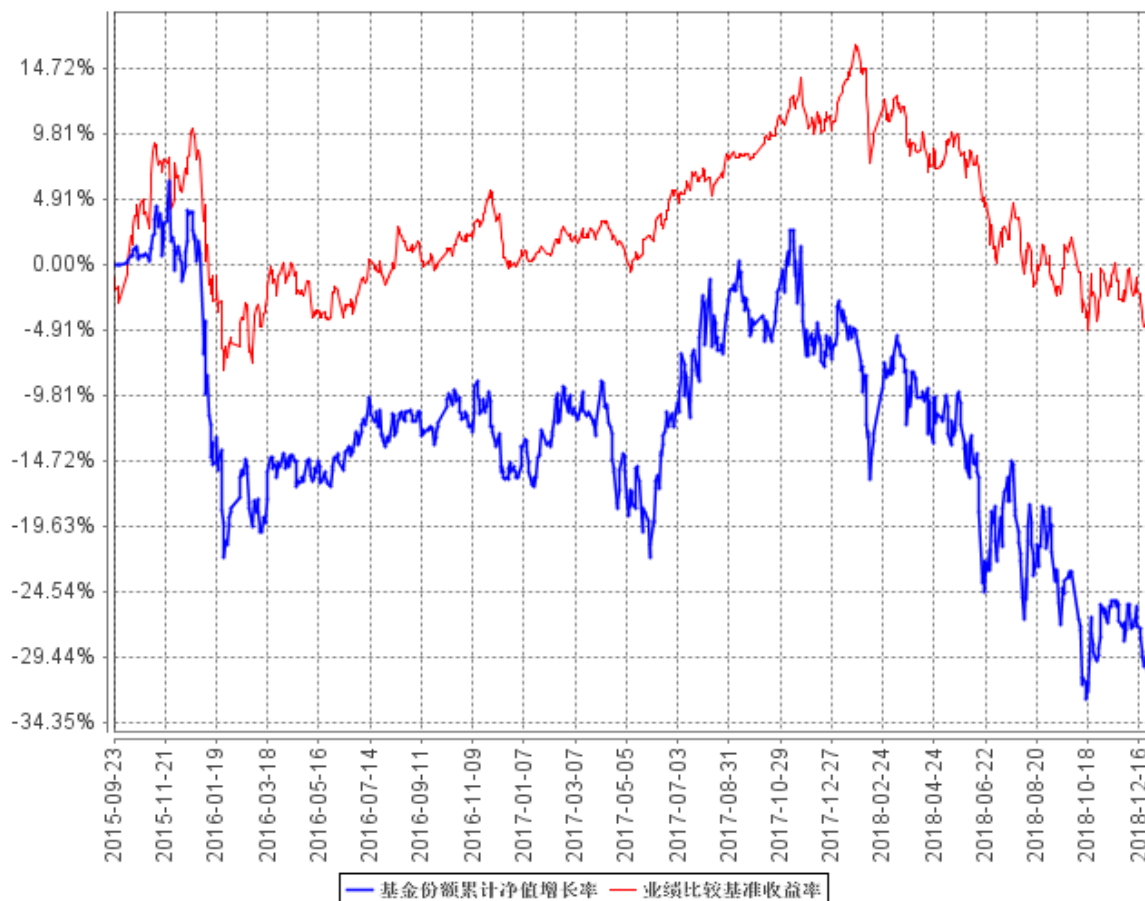
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-10.39%	1.60%	-6.79%	0.98%	-3.60%	0.62%
过去六个月	-15.34%	1.81%	-7.70%	0.90%	-7.64%	0.91%
过去一年	-26.60%	1.75%	-14.11%	0.80%	-12.49%	0.95%
过去三年	-31.55%	1.43%	-11.84%	0.71%	-19.71%	0.72%
自基金合同生效起至今	-31.00%	1.39%	-4.89%	0.74%	-26.11%	0.65%

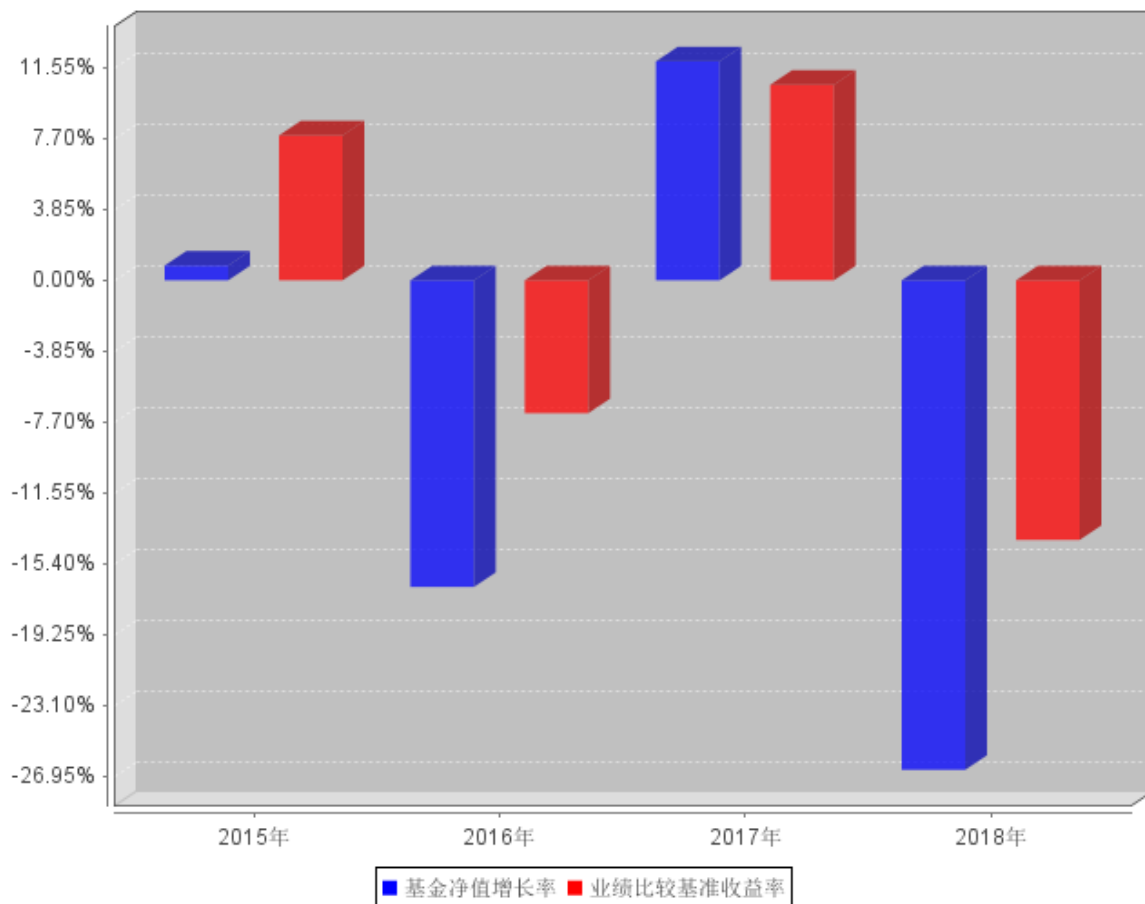
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

红土创新基金管理有限公司（以下简称“红土创新基金”）经中国证监会证监许可【2014】562 号文批准设立。红土创新基金总部位于深圳，注册资本金为 1.5 亿元人民币，是国内首家创投系公募基金管理公司。公司股东为深圳市创新投资集团有限公司，持有股权 100%。

红土创新基金在公募基金业务的优良传承基础上，借力股东对创业投资行业的深入理解，外加国内独创的博士后工作站研究支持，充分利用一级市场优势向二级市场延伸，将红土创新基金打造成为以权益类投资为特色的创新型资产管理机构。截至 2018 年 12 月 31 日，红土创新基金共管理 7 只公募基金，资产管理规模 81.96 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
侯世霞	基金经理	2015 年 9 月 23 日	-	8	兰州大学 MBA。历任平安证券有限责任公司新能源汽车行业研究员；日信证券有限责任公司化工行业首席分析师、证券投资部投资经理、投资部总经理助理、公司投资决策委员会委员。现任红土创新新兴产业混合证券投资基金、红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实



施细则、《红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年，上证综指下跌 24.59%；沪深 300 指数下跌 25.31%；创业板指数下跌 28.65%。板块方面，只有农业板块在行业因素的驱动下，实现 0.07% 的上涨，其余行业指数全部下跌。

本基金严格遵循了优选长期成长价值的投资思路，在对内经济显著下行，对外全球经济下行

拐点显现的背景下，对组合进行了局部的调整。2018 年，市场单边下跌，绝对收益机会稀缺，仅有相对收益。总体而言，行业内的优质公司仍然具备抗跌的属性。本基金根据市场变化，在股票仓位和行业配置上做出了调整应对，收益与市场均值相当。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.690 元；本报告期基金份额净值增长率为-26.60%，业绩比较基准收益率为-14.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年股票市场遭遇内外部多重冲击。国内经济基本面显著下行，全球经济下行拐点显现，全球流动性总量拐点预期强烈。外围市场共振下行和贸易战对基本面的悲观预期对市场形成了显著的拖累。不确定的市场中，业绩成为选择方向的最确定的锚。在未来的一年，随着逆周期调节力度的释放和库存周期见底，国内经济基本面有望触底回升。市场不会是历史的简单重复，但是在底部区域保持乐观一定是最理性的做法。

对于 2018 年全年来看，A 股市场整体大幅下行。前三个季度，优势行业的盈利能力并没有显著变差，市场估值出现了下杀，但在第四季度，经济基本面全面恶化，估值下行的隐含逻辑兑现。在过去的三年，我们经历了自 2016 年第一季度开始的一轮由库存周期上行带动的经济复苏，以及随之而来至今仍未结束的下行。2019 年于基本面而言，是寻底之年，于股票市场而言，机会大于风险。在经济未探明底部之前，具有抗周期性质的云计算，自主可控，通信升级以及新能源汽车等方向，仍将是市场最主要的进攻方向。同时，基建，地产等扮演逆周期调节因素的行业，也会有较为确定的相对收益。经济基本面探明底部之后，券商和汽车等早周期行业将显著受益。同时，随着社会的进步和发展，人对于自身的消费需求也更加重视品质的提升，伴随消费升级崛起的优质公司值得我们长期坚守。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过

网站、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。

报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### **4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值工作组，由投研部门、运营部门及监察稽核部门的相关人员组成。估值工作组负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理，特别是应当保证估值未被歪曲以免对基金份额持有人产生不利影响。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人、基金资产净值低于 5000 万的情形。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## §6 审计报告

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

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	2,255,284.17	10,182,241.07
结算备付金	7,534,261.07	706,790.94
存出保证金	95,061.93	149,696.70
交易性金融资产	52,215,832.42	87,790,851.02
其中：股票投资	52,215,832.42	87,790,851.02
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	2,583,865.72	-
应收利息	2,215.68	2,694.61
应收股利	-	-
应收申购款	1,697.45	4,092.52
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	64,688,218.44	98,836,366.86
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	9,421.39	32,950.78
应付管理人报酬	85,278.19	125,013.34
应付托管费	14,213.03	20,835.54
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	224,344.45	374,465.87
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	164,517.00	285,058.66
负债合计	497,774.06	838,324.19
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	93,090,143.53	104,245,484.09
未分配利润	-28,899,699.15	-6,247,441.42
所有者权益合计	64,190,444.38	97,998,042.67
负债和所有者权益总计	64,688,218.44	98,836,366.86

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.690 元，基金份额总额 93,090,143.53 份。

## 7.2 利润表

会计主体：红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-20,578,987.54	18,510,314.46
1. 利息收入	93,639.86	227,246.96
其中：存款利息收入	93,639.86	127,835.66
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	99,411.30
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-10,279,459.90	13,806,644.13
其中：股票投资收益	-10,642,692.92	13,296,282.07
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-87,680.00	-
股利收益	450,913.02	510,362.06
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-10,418,299.82	4,365,152.26
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	25,132.32	111,271.11
<b>减：二、费用</b>	3,071,829.85	4,978,070.88
1. 管理人报酬	1,178,815.88	1,674,185.31

2. 托管费	196,469.38	279,030.81
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,509,955.12	2,844,500.96
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	186,589.47	180,353.80
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-23,650,817.39</b>	<b>13,532,243.58</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-23,650,817.39</b>	<b>13,532,243.58</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	104,245,484.09	-6,247,441.42	97,998,042.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-23,650,817.39	-23,650,817.39
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）	-11,155,340.56	998,559.66	-10,156,780.90
其中：1. 基金申购款	5,766,343.65	-972,218.46	4,794,125.19
2. 基金赎回款	-16,921,684.21	1,970,778.12	-14,950,906.09
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）	93,090,143.53	-28,899,699.15	64,190,444.38
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		



	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	132,298,120.42	-21,123,000.80	111,175,119.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,532,243.58	13,532,243.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-28,052,636.33	1,343,315.80	-26,709,320.53
其中：1. 基金申购款	20,028,130.62	-1,016,151.93	19,011,978.69
2. 基金赎回款	-48,080,766.95	2,359,467.73	-45,721,299.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	104,245,484.09	-6,247,441.42	97,998,042.67

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：

\_\_\_\_\_  
高峰

\_\_\_\_\_  
高峰

\_\_\_\_\_  
焦小川

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
红土创新基金管理有限公司(“红土创新”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
深圳市创新投资集团有限公司(“深创投”)	基金管理人的控股股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

#### 7.4.3.1 关联方报酬

##### 7.4.3.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,178,815.88	1,674,185.31
其中：支付销售机构的客户维护费	240,429.59	437,987.73

注：支付基金管理人红土创新的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

##### 7.4.3.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	196,469.38	279,030.81

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

##### 7.4.3.1.3 销售服务费

无。

#### 7.4.3.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

**7.4.3.3 各关联方投资本基金的情况****7.4.3.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**7.4.3.3.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018年12月31日		上年度末 2017年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总份 额的比例
深创投	50,060,750.00	53.7800%	50,060,750.00	48.0200%

**7.4.3.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2018年1月1日至2018年12月 31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,255,284.17	80,155.17	10,182,241.07	104,259.54

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.3.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.4 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

**7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代 码	股票名 称	停牌日 期	停牌 原因	期末 估值单价	复牌日 期	复牌 开盘单价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
600030	中信证 券	2018 年 12月 25日	重要 事项 未公 告	16.01	2019年 1月 10日	17.15	100	1,640.00	1,601.00	-

注：本基金截至 2018 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.5 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 52,214,231.42 元，属于第二层次的余额为 1,601.00 元，无第三层次(2017 年 12 月 31 日：第一层次 82,585,560.02 元，第二层次 5,205,291.00 元，无第三层次)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

###### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## §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	52,215,832.42	80.72
	其中：股票	52,215,832.42	80.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,789,545.24	15.13
8	其他各项资产	2,682,840.78	4.15
9	合计	64,688,218.44	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	21,065,914.10	32.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,829,057.00	12.20
F	批发和零售业	5,841,050.00	9.10
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,153,026.00	12.70
J	金融业	1,601.00	0.00
K	房地产业	9,325,184.32	14.53

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	52,215,832.42	81.35

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002024	苏宁易购	593,000	5,841,050.00	9.10
2	300122	智飞生物	119,200	4,620,192.00	7.20
3	300577	开润股份	139,700	4,355,846.00	6.79
4	300383	光环新网	341,200	4,323,004.00	6.73
5	000002	万科A	143,701	3,422,957.82	5.33
6	600048	保利地产	286,350	3,376,066.50	5.26
7	600271	航天信息	142,600	3,264,114.00	5.09
8	601186	中国铁建	250,500	2,722,935.00	4.24
9	300616	尚品宅配	42,380	2,575,432.60	4.01
10	002677	浙江美大	256,400	2,556,308.00	3.98

### 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	300339	润和软件	15,993,195.00	16.32
2	600588	用友网络	15,297,514.76	15.61
3	600271	航天信息	14,663,369.29	14.96



4	300383	光环新网	13,939,417.48	14.22
5	002368	太极股份	13,932,831.60	14.22
6	603993	洛阳钼业	13,089,549.79	13.36
7	000002	万科A	11,277,081.17	11.51
8	002677	浙江美大	10,929,110.56	11.15
9	002384	东山精密	10,632,046.00	10.85
10	603799	华友钴业	10,159,225.14	10.37
11	002410	广联达	9,794,764.70	9.99
12	300208	青岛中程	9,757,360.00	9.96
13	600536	中国软件	9,585,498.00	9.78
14	600048	保利地产	9,584,012.50	9.78
15	603019	中科曙光	9,365,880.22	9.56
16	600845	宝信软件	9,249,018.00	9.44
17	600596	新安股份	8,639,862.20	8.82
18	300577	开润股份	8,155,820.76	8.32
19	300618	寒锐钴业	7,835,521.00	8.00
20	300409	道氏技术	7,420,236.50	7.57
21	300122	智飞生物	7,267,874.63	7.42
22	000977	浪潮信息	6,920,135.81	7.06
23	300047	天源迪科	6,840,472.10	6.98
24	300349	金卡智能	6,813,970.61	6.95
25	300496	中科创达	6,810,543.00	6.95
26	600030	中信证券	6,735,910.41	6.87
27	002027	分众传媒	6,456,252.20	6.59
28	603816	顾家家居	6,360,345.00	6.49
29	002371	北方华创	6,253,271.70	6.38
30	601288	农业银行	6,229,852.00	6.36
31	603589	口子窖	6,178,842.50	6.31
32	300373	扬杰科技	6,172,399.00	6.30
33	002456	欧菲科技	5,815,673.00	5.93
34	002045	国光电器	5,759,786.00	5.88
35	300413	芒果超媒	5,416,757.00	5.53
36	601800	中国交建	5,413,186.00	5.52
37	000568	泸州老窖	5,354,292.00	5.46
38	002065	东华软件	5,296,440.81	5.40
39	000001	平安银行	5,254,985.00	5.36

40	002202	金风科技	5,176,299.00	5.28
41	300170	汉得信息	5,090,146.00	5.19
42	002916	深南电路	5,053,153.00	5.16
43	600362	江西铜业	4,968,058.00	5.07
44	000729	燕京啤酒	4,947,362.00	5.05
45	002152	广电运通	4,880,484.00	4.98
46	601688	华泰证券	4,738,719.02	4.84
47	600600	青岛啤酒	4,612,981.20	4.71
48	300188	美亚柏科	4,574,443.80	4.67
49	600702	舍得酒业	4,569,475.00	4.66
50	600132	重庆啤酒	4,511,990.00	4.60
51	603127	昭衍新药	4,365,993.00	4.46
52	300036	超图软件	4,321,105.00	4.41
53	300476	胜宏科技	4,306,959.60	4.39
54	002712	思美传媒	4,290,519.00	4.38
55	603986	兆易创新	4,281,271.00	4.37
56	300166	东方国信	4,262,125.00	4.35
57	000933	神火股份	4,195,484.00	4.28
58	601390	中国中铁	4,070,564.00	4.15
59	603305	旭升股份	4,018,339.00	4.10
60	600409	三友化工	4,013,378.00	4.10
61	601998	中信银行	3,939,969.00	4.02
62	601988	中国银行	3,690,254.00	3.77
63	600801	华新水泥	3,649,929.00	3.72
64	600585	海螺水泥	3,647,891.00	3.72
65	601869	长飞光纤	3,647,477.20	3.72
66	002304	洋河股份	3,600,885.00	3.67
67	000807	云铝股份	3,579,478.00	3.65
68	600489	中金黄金	3,570,166.00	3.64
69	002281	光迅科技	3,570,083.00	3.64
70	600547	山东黄金	3,569,139.00	3.64
71	601601	中国太保	3,551,788.00	3.62
72	300418	昆仑万维	3,495,877.00	3.57
73	300271	华宇软件	3,458,354.00	3.53
74	603517	绝味食品	3,454,463.00	3.53
75	000672	上峰水泥	3,406,273.00	3.48

76	300284	苏交科	3,374,732.80	3.44
77	002465	海格通信	3,362,311.00	3.43
78	300302	同有科技	3,310,769.84	3.38
79	600887	伊利股份	3,269,247.00	3.34
80	600498	烽火通信	3,233,695.00	3.30
81	001979	招商蛇口	3,187,115.00	3.25
82	000066	中国长城	2,983,945.00	3.04
83	002151	北斗星通	2,938,683.00	3.00
84	300616	尚品宅配	2,813,593.40	2.87
85	600039	四川路桥	2,784,021.00	2.84
86	600219	南山铝业	2,779,140.00	2.84
87	601186	中国铁建	2,736,945.00	2.79
88	300398	飞凯材料	2,720,919.00	2.78
89	300546	雄帝科技	2,707,471.00	2.76
90	002146	荣盛发展	2,703,775.00	2.76
91	603018	中设集团	2,664,588.00	2.72
92	601668	中国建筑	2,630,715.00	2.68
93	002475	立讯精密	2,507,681.00	2.56
94	300571	平治信息	2,460,246.00	2.51
95	002376	新北洋	2,027,331.00	2.07
96	300554	三超新材	1,990,859.00	2.03
97	002024	苏宁易购	1,972,847.00	2.01

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600588	用友网络	15,892,880.62	16.22
2	603799	华友钴业	14,440,362.00	14.74
3	002368	太极股份	13,938,200.00	14.22
4	300339	润和软件	13,168,082.00	13.44
5	000002	万科A	12,822,768.10	13.08
6	603993	洛阳钼业	12,636,939.94	12.90
7	002456	欧菲科技	12,391,223.00	12.64

8	600271	航天信息	12,009,213.28	12.25
9	600048	保利地产	11,242,803.43	11.47
10	600536	中国软件	10,074,710.00	10.28
11	002410	广联达	9,932,045.40	10.13
12	600596	新安股份	9,625,902.37	9.82
13	002384	东山精密	9,306,441.00	9.50
14	603019	中科曙光	9,287,126.88	9.48
15	300383	光环新网	9,192,556.00	9.38
16	300208	青岛中程	8,369,087.00	8.54
17	603517	绝味食品	8,095,971.00	8.26
18	002677	浙江美大	7,854,680.60	8.02
19	002475	立讯精密	7,610,309.68	7.77
20	300618	寒锐钴业	7,198,756.00	7.35
21	600845	宝信软件	7,044,693.00	7.19
22	000725	京东方A	7,030,723.00	7.17
23	600030	中信证券	6,766,169.50	6.90
24	002027	分众传媒	6,525,906.86	6.66
25	002371	北方华创	6,523,861.31	6.66
26	601288	农业银行	6,495,187.00	6.63
27	300349	金卡智能	6,411,945.68	6.54
28	300047	天源迪科	6,385,765.00	6.52
29	300409	道氏技术	6,143,941.25	6.27
30	603589	口子窖	6,074,332.90	6.20
31	300496	中科创达	5,942,424.00	6.06
32	300413	芒果超媒	5,842,863.00	5.96
33	300373	扬杰科技	5,764,756.00	5.88
34	300616	尚品宅配	5,650,609.40	5.77
35	603127	昭衍新药	5,618,535.00	5.73
36	002916	深南电路	5,534,339.53	5.65
37	000977	浪潮信息	5,360,208.39	5.47
38	002065	东华软件	5,236,428.00	5.34
39	000001	平安银行	5,235,616.00	5.34
40	002507	涪陵榨菜	5,211,371.00	5.32
41	000568	泸州老窖	5,207,431.88	5.31
42	002202	金风科技	5,094,688.00	5.20
43	002152	广电运通	5,075,438.00	5.18
44	002045	国光电器	5,069,502.96	5.17
45	000729	燕京啤酒	4,975,409.00	5.08

46	600362	江西铜业	4,828,407.52	4.93
47	300554	三超新材	4,790,007.00	4.89
48	000998	隆平高科	4,710,516.00	4.81
49	300433	蓝思科技	4,673,365.70	4.77
50	601688	华泰证券	4,643,318.58	4.74
51	300700	岱勒新材	4,639,251.97	4.73
52	000888	峨眉山A	4,602,884.54	4.70
53	603816	顾家家居	4,588,476.00	4.68
54	300170	汉得信息	4,496,510.00	4.59
55	600132	重庆啤酒	4,414,550.00	4.50
56	002024	苏宁易购	4,380,890.74	4.47
57	300476	胜宏科技	4,369,283.44	4.46
58	300188	美亚柏科	4,345,946.75	4.43
59	300577	开润股份	4,326,466.00	4.41
60	002712	思美传媒	4,151,234.00	4.24
61	600872	中炬高新	4,081,747.00	4.17
62	600600	青岛啤酒	4,026,983.96	4.11
63	300136	信维通信	3,992,384.20	4.07
64	600702	舍得酒业	3,983,278.00	4.06
65	601390	中国中铁	3,923,759.00	4.00
66	603305	旭升股份	3,757,211.98	3.83
67	300166	东方国信	3,709,709.40	3.79
68	300036	超图软件	3,679,308.00	3.75
69	002281	光迅科技	3,658,153.00	3.73
70	601601	中国太保	3,568,451.70	3.64
71	600547	山东黄金	3,567,033.00	3.64
72	600489	中金黄金	3,541,843.00	3.61
73	000933	神火股份	3,504,110.00	3.58
74	600409	三友化工	3,432,941.00	3.50
75	600801	华新水泥	3,412,745.00	3.48
76	600585	海螺水泥	3,387,891.00	3.46
77	300284	苏交科	3,386,934.00	3.46
78	600498	烽火通信	3,353,058.00	3.42
79	000807	云铝股份	3,346,493.00	3.41
80	600887	伊利股份	3,326,923.00	3.39
81	002304	洋河股份	3,308,416.00	3.38
82	601988	中国银行	3,302,223.00	3.37
83	601998	中信银行	3,285,828.00	3.35

84	603986	兆易创新	3,261,300.00	3.33
85	002465	海格通信	3,177,181.00	3.24
86	300271	华宇软件	3,176,691.60	3.24
87	000672	上峰水泥	2,984,605.00	3.05
88	300302	同有科技	2,972,562.22	3.03
89	300418	昆仑万维	2,881,970.00	2.94
90	300398	飞凯材料	2,811,695.04	2.87
91	002151	北斗星通	2,737,582.00	2.79
92	300546	雄帝科技	2,693,040.71	2.75
93	600219	南山铝业	2,689,404.74	2.74
94	002146	荣盛发展	2,666,080.88	2.72
95	601800	中国交建	2,662,130.00	2.72
96	000066	中国长城	2,657,564.00	2.71
97	601668	中国建筑	2,606,580.00	2.66
98	603018	中设集团	2,599,703.00	2.65
99	300571	平治信息	2,538,498.00	2.59
100	601869	长飞光纤	2,489,869.00	2.54
101	300122	智飞生物	2,072,449.31	2.11
102	002376	新北洋	1,987,735.00	2.03

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	564,174,759.27
卖出股票收入（成交）总额	578,688,785.13

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

#### 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

无。

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**  
无。

**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**  
无。

**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**  
无。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**  
无。

**8.10.1 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金在进行股指期货投资时将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险，如预期大额申购赎回、大量分红等。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**  
无。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**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	95,061.93
2	应收证券清算款	2,583,865.72
3	应收股利	-
4	应收利息	2,215.68
5	应收申购款	1,697.45
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,682,840.78

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。



## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
862	107,993.21	52,052,990.74	55.92%	41,037,152.79	44.08%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	1,039,815.31	1.1200%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2015年9月23日）基金份额总额	244,976,374.41
本报告期期初基金份额总额	104,245,484.09
本报告期期间基金总申购份额	5,766,343.65
减:本报告期期间基金总赎回份额	16,921,684.21
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	93,090,143.53

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本公司原总经理杨兵先生因个人原因，于 2018 年 6 月 11 日离职，相关公告已于 2018 年 6 月 16 日在《证券时报》上披露。2018 年 7 月 17 日，公司再于《证券时报》上披露了“关于高级管理人员变更的公告”，高峰先生于 7 月 16 日任职公司总经理。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本年度支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 60,000.00 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 4 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	数量	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	
广发证券	2	429,932,518.51	37.62%	305,809.47	37.12%	-
中信证券	4	288,717,333.33	25.26%	211,139.30	25.63%	-
银河证券	2	196,884,451.89	17.23%	143,982.10	17.47%	-
兴业证券	2	143,552,239.25	12.56%	101,745.57	12.35%	-
中信证券 (山东)	2	83,777,001.42	7.33%	61,266.01	7.44%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

注：1、为节约交易单元资源，我公司在交易所交易系统升级的基础上，对同一银行托管基金进行了席位整合。

2、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- a、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- b、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- c、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- d、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择交易单元：

- a、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- b、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- c、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。



## §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	20180101-20181231	50,060,750.00	0.00	0.00	50,060,750.00	53.78%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

##### 1. 巨额赎回风险

(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；

(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

##### 2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

单一投资者巨额赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；

##### 3. 流动性风险

单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

在本基金募集期，本基金管理人唯一股东深圳市创新投资集团有限公司出资 5000 万元认购本基金，截止本报告期末，深创投集团持有的本基金份额未发生变化。