

红土创新新科技股票型发起式证券投资基金

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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 9 月 14 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	红土创新新科技股票
基金主代码	006265
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 9 月 14 日
基金管理人	红土创新基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	16,662,195.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于新科技产业主题的上市公司股票，在严格管理风险和保障必要流动性的前提下，实现长期稳健增值。
投资策略	本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析互相补充的方法，在股票、债券和现金等资产类之间进行相对稳定的适度配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中证 TMT 产业主题指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，属于证券投资基金中的较高风险品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张洗尘	郭明
	联系电话	0755-33011878	010-66105799
	电子邮箱	zhangxc@htcfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		0755-33011866	95588
传真		0755-33011855	010-66105798

2.4 信息披露方式

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

主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

2.5 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 9 月 14 日(基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-721,350.09
本期利润	-922,813.88
加权平均基金份额本期利润	-0.0394
本期基金份额净值增长率	-5.45%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0545
期末基金资产净值	15,754,009.50
期末基金份额净值	0.9455

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

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

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

4. 本基金合同生效日为 2018 年 09 月 14 日, 基金合同生效日至本报告期末, 本基金运作时间未满一年。

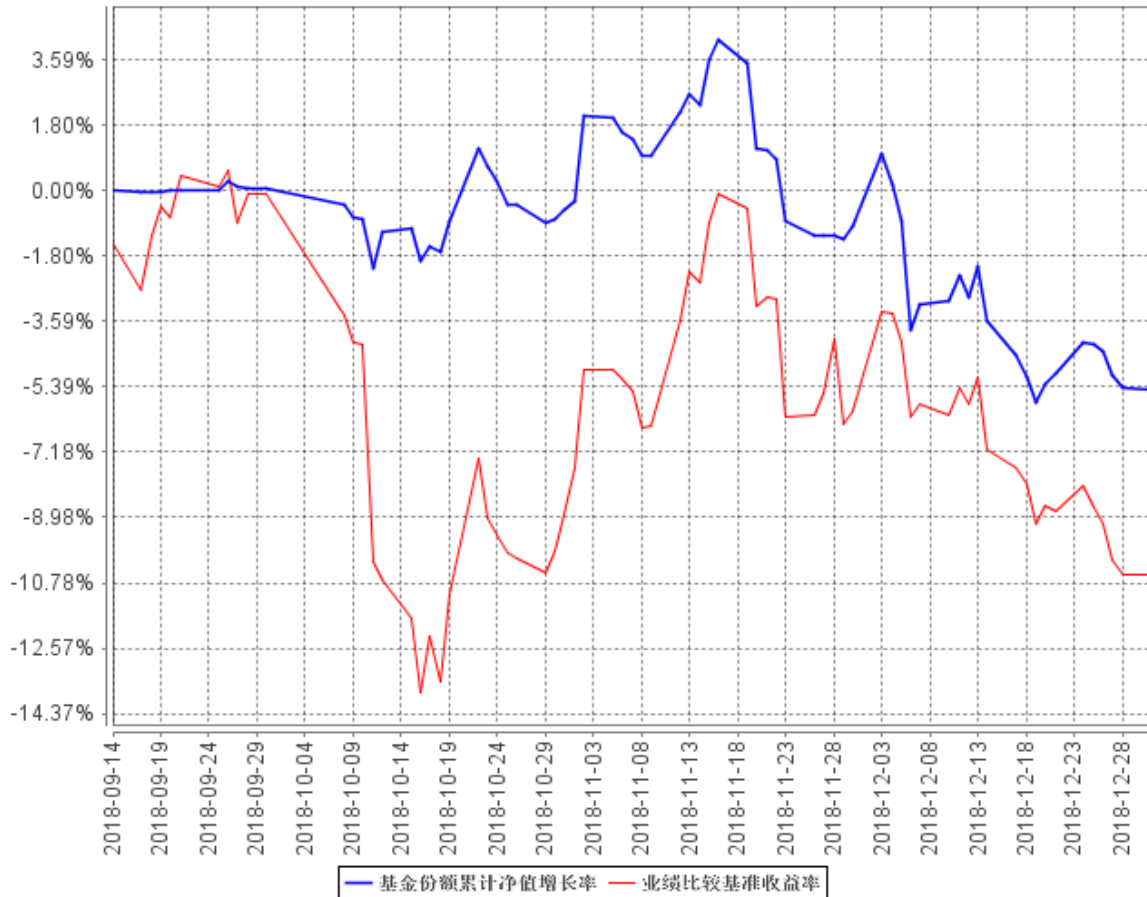
2.6 基金净值表现

2.6.1 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	-5.50%	0.92%	-10.51%	1.70%	5.01%	-0.78%
自基金合同生效起至今	-5.45%	0.85%	-10.57%	1.61%	5.12%	-0.76%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

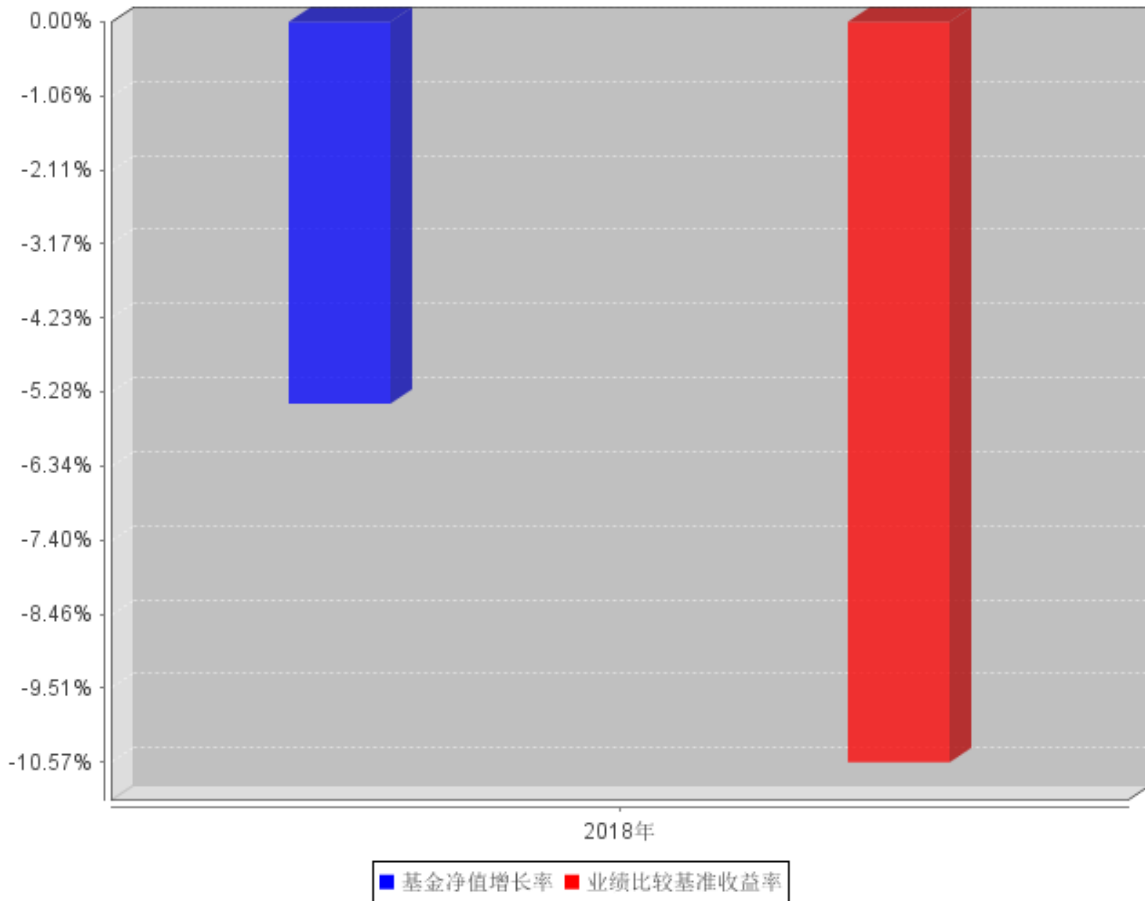


注：1. 基金合同生效日至本报告期末不满一年。

2. 本基金建仓期为六个月，截止本报告期期末尚处于建仓期。

2.6.3 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



2.7 其他指标

无。

2.8 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立后，未有利润分配事项

§ 3 管理人报告

3.1 基金管理人及基金经理情况

3.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

红土创新基金管理有限公司（以下简称“红土创新基金”）经中国证监会证监许可【2014】562号文批准设立。红土创新基金总部位于深圳，注册资本为1.5亿元人民币，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，红土创新基金管理7只公募基金，资产管理规模81.96亿元。

3.1.2 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		
朱然	基金经理	2018年9月14日	-	4	北京大学硕士，3年科技实业经历，曾在英特尔，甲骨文等高科技公司任职；4年证券投资行业从业经历，历任广发证券（香港）海外市场分析师，红土创新基金TMT行业(包括电子，通信和传媒等)高级研究员；现任红土创新定增灵活配置混合型证券投资基金、红土创新新科技股票型发起式证券投资基金基金经理。

3.2 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、《红土创新新科技股票型发起式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。

3.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

3.3.1 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、《红土创新新科技股票型发起式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。

3.3.2 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。

3.3.3 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%。

3.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

3.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2018 年，国内市场受到贸易摩擦，国内政策变动，宏观经济指标下行等内外宏观因素的影响，同时也遭遇了一系列黑天鹅事件，整体市场震荡下行。本产品 2018 年 9 月成立，四季度是本产品成立之后完整运营的第一个季度，沪深 300 指数，创业板指和中证 TMT 指数四季度分别下跌 12%，11%和 14%；从细分行业来看，银行，非银，地产等周期性行业表现较好，而科技，医药，军工等成长行业以及消费行业表现较差，反应了市场风险偏好整体较弱。

宏观层面，国内基建投资增速逐步下行，房地产，汽车，智能机，零售等数据逐步疲软，出口方面受到贸易摩擦的影响，虽然抢出口现象导致数据并未明显下滑，但出口实体的投资预期开始显露下降趋势。从投资，消费和出口的情况来看，国内宏观经济开始表现出加速下滑的趋势。外部环境方面，贸易摩擦由激化到逐步缓和，美国加息预期导致外围市场波动加大，对国内市场情绪产生较大影响。

本产品在报告期内主要投向通信，传媒，云计算，计算机软件等弱周期性板块，以及一些低估值的成长类个股。由于市场整体震荡下行以及黑天鹅事件较多，我们在仓位也进行了一定控制，产品净值虽有一定回撤但相对稳定。

3.4.2 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 0.9455 元；本报告期基金份额净值增长率为-5.45%，业绩比较基准收益率为-10.57%。

3.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，经济增速下行趋势确立，但下行幅度和见底时间仍不确定；1 季度企业盈利情况是重要的观察点。外部环境方面，贸易战走向缓和，对市场情绪带来较大缓解。但美国引起的全球贸易格局变化和新增关税成本仍然会对企业出口带来较大压力。

政策底仍然在不断强化，一系列减税措施将为经济带来中长期的成长动力，货币政策上可能逐步加大宽松力度，国家队和外资机构入市可能会成为增量资金来源。估值方面，当前 A 股估值基本位于历史几次熊市底部区域，虽然无法断定是否会创新低，但下行风险相对有限。

鉴于宏观经济的形势，我们上半年会保持相对谨慎的投资思路，主要选择基本面完好和有边际变化的逆周期成长板块，包括通信系统和终端，新能源，游戏影视，云计算和军工等；

下半年预计宏观经济逐步复苏，在具备中长期成长逻辑的板块中，精选低估值和有核心竞争力的龙头个股，包括库存消化完毕的电子上游元器件，汽车电子和零部件，上游机械设备，营销服务，企业信息化等低估值成长性板块。

3.6 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。

3.7 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。

3.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

遵照本基金合同约定，本基金本报告期内未进行利润分配。

3.9 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。

§ 4 托管人报告

4.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

4.3 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

本托管人依法对红土创新基金管理有限公司编制和披露的红土创新新科技股票型发起式证券投资基金 2018 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 5 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。

§ 6 年度财务报表

6.1 资产负债表

会计主体：红土创新新科技股票型发起式证券投资基金

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
资 产：	
银行存款	7,395,466.07
结算备付金	226,210.37
存出保证金	20,645.15
交易性金融资产	8,289,208.00
其中：股票投资	8,289,208.00
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	-
应收利息	1,791.30
应收股利	-
应收申购款	3,018.84
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	15,936,339.73
负债和所有者权益	本期末 2018 年 12 月 31 日
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	10,422.31
应付管理人报酬	20,665.21
应付托管费	3,444.21
应付销售服务费	-
应付交易费用	92,797.52
应交税费	-

应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	55,000.98
负债合计	182,330.23
所有者权益：	
实收基金	16,662,195.00
未分配利润	-908,185.50
所有者权益合计	15,754,009.50
负债和所有者权益总计	15,936,339.73

注：1. 报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9455 元，基金份额总额 16,662,195.00 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 9 月 14 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日。

6.2 利润表

会计主体：红土创新新科技股票型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 9 月 14 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期
	2018 年 9 月 14 日(基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日
一、收入	-568,221.22
1. 利息收入	92,384.73
其中：存款利息收入	27,678.49
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	64,706.24
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-538,088.31
其中：股票投资收益	-538,088.31
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-201,463.79
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	78,946.15
减：二、费用	354,592.66
1. 管理人报酬	106,573.18

2. 托管费	17,762.22
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	174,021.95
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	56,235.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-922,813.88
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-922,813.88

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：红土创新新科技股票型发起式证券投资基金

本报告期：2018年9月14日(基金合同生效日)至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年9月14日(基金合同生效日)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）	36,300,296.63	-	36,300,296.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-922,813.88	-922,813.88
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）	-19,638,101.63	14,628.38	-19,623,473.25
其中：1. 基金申购款	1,393,771.27	-816.07	1,392,955.20
2. 基金赎回款	-21,031,872.90	15,444.45	-21,016,428.45
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）	16,662,195.00	-908,185.50	15,754,009.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

高峰

基金管理人负责人

高峰

主管会计工作负责人

焦小川

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

红土创新新科技股票型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]951 号《关于准予红土创新新科技股票型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由红土创新基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新新科技股票型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 36,290,133.08 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0624 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《红土创新新科技股票型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 9 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 36,300,296.63 份基金份额,其中认购资金利息折合 10,163.55 份基金份额。本基金的基金管理人为红土创新基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,004,445.98 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新新科技股票型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、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)、可交换债券、中小企业私募债券等)、衍生工具(权证、股指期货等)、资产支持证券、债券回购、银行存款以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 80%-95%,其中投资于本基金所界定的新科技产业主题的股票不低于非现金基金资产的 80%;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不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中证 TMT 产业主题指数收益率 x 80%+中证综合债指数收益率 x 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人红土创新基金管理有限公司于 2019 年 3 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投

资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《红土创新新科技股票型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 9 月 14 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 9 月 14 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 9 月 14 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。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。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认

金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现

平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 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。

6.4.7 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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构

深圳市创新投资集团有限公司(“深创投”)	基金管理人的控股股东
----------------------	------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

6.4.8.1 关联方报酬

6.4.8.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年9月14日(基金合同生效日)至2018年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	106,573.18
其中：支付销售机构的客户维护费	14,552.09

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 × 1.50%/ 当年天数。

6.4.8.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年9月14日(基金合同生效日)至2018年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	17,762.22

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

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25%/ 当年天数。

6.4.8.1.3 销售服务费

无。

6.4.8.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2018 年 9 月 14 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2018 年 9 月 14 日）持有的基金份额	9,999,500.00
期初持有的基金份额	-
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	9,999,500.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	60.0100%

6.4.8.3.2 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

无。

6.4.8.4 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 9 月 14 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	7,395,466.07	26,033.62

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.6 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 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 8,289,208.00 元，无属于第二或第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金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。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	8,289,208.00	52.01
	其中：股票	8,289,208.00	52.01
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	7,621,676.44	47.83
8	其他各项资产	25,455.29	0.16
9	合计	15,936,339.73	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	3,653,581.00	23.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	233,163.00	1.48
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	2,805,170.00	17.81
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	308,112.00	1.96
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	1,289,182.00	8.18
S	综合	-	-
	合计	8,289,208.00	52.62

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 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	600373	中文传媒	56,900	740,269.00	4.70
2	600271	航天信息	28,200	645,498.00	4.10
3	603660	苏州科达	35,800	596,786.00	3.79
4	002624	完美世界	21,300	593,205.00	3.77
5	300408	三环集团	33,600	568,512.00	3.61
6	300383	光环新网	44,700	566,349.00	3.59
7	600845	宝信软件	23,400	487,890.00	3.10
8	300207	欣旺达	54,500	468,155.00	2.97
9	603444	吉比特	3,000	444,000.00	2.82
10	002449	国星光电	41,200	427,656.00	2.71

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300476	胜宏科技	4,433,602.00	28.14
2	600498	烽火通信	4,373,021.65	27.76
3	002463	沪电股份	3,550,071.00	22.53
4	603228	景旺电子	3,524,716.16	22.37
5	600271	航天信息	3,404,328.00	21.61
6	300408	三环集团	3,187,975.00	20.24

7	300747	锐科激光	2,777,717.00	17.63
8	002376	新北洋	2,694,568.00	17.10
9	002384	东山精密	2,562,164.88	16.26
10	603660	苏州科达	2,547,320.60	16.17
11	600845	宝信软件	2,330,358.00	14.79
12	002916	N 深南	2,266,659.45	14.39
13	000988	华工科技	2,230,898.00	14.16
14	002236	大华股份	2,146,406.00	13.62
15	300454	深信服	1,982,655.00	12.59
16	002174	游族网络	1,738,468.00	11.04
17	603444	吉比特	1,731,055.00	10.99
18	300373	扬杰科技	1,605,134.00	10.19
19	002624	完美世界	1,540,997.00	9.78
20	300413	快乐购	1,486,860.00	9.44
21	002027	分众传媒	1,461,696.00	9.28
22	000997	新大陆	1,460,688.00	9.27
23	300383	光环新网	1,406,981.00	8.93
24	000063	中兴通讯	1,241,100.00	7.88
25	603986	兆易创新	1,187,938.00	7.54
26	002138	顺络电子	1,116,647.00	7.09
27	300170	汉得信息	1,116,186.00	7.09
28	300365	恒华科技	945,743.00	6.00
29	300308	中际装备	917,814.00	5.83
30	600373	中文传媒	731,125.00	4.64
31	002179	中航光电	710,583.00	4.51
32	002449	国星光电	676,815.05	4.30
33	002841	视源股份	574,022.00	3.64
34	002739	万达电影	564,244.85	3.58
35	300296	利亚德	537,972.00	3.41
36	002415	海康威视	496,650.00	3.15
37	300661	圣邦股份	494,598.00	3.14
38	600977	中国电影	484,414.00	3.07
39	300207	欣旺达	476,181.00	3.02
40	300571	平治信息	426,395.00	2.71
41	300271	华宇软件	393,250.00	2.50
42	600570	恒生电子	371,840.00	2.36

43	603328	依顿电子	358,972.28	2.28
44	601231	环旭电子	333,982.00	2.12
45	002371	北方华创	333,205.00	2.12
46	000977	浪潮信息	324,901.00	2.06

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300476	胜宏科技	4,473,325.24	28.39
2	600498	烽火通信	4,355,234.28	27.65
3	002463	沪电股份	3,771,777.57	23.94
4	603228	景旺电子	3,256,346.34	20.67
5	300747	锐科激光	2,937,969.00	18.65
6	002376	新北洋	2,726,627.00	17.31
7	600271	航天信息	2,618,693.70	16.62
8	300408	三环集团	2,531,222.00	16.07
9	002384	东山精密	2,408,488.00	15.29
10	002916	N 深南	2,387,115.25	15.15
11	000988	华工科技	2,253,058.00	14.30
12	002236	大华股份	2,133,037.00	13.54
13	300454	深信服	2,037,089.00	12.93
14	603660	苏州科达	1,829,492.00	11.61
15	600845	宝信软件	1,768,170.00	11.22
16	002174	游族网络	1,548,744.00	9.83
17	300373	扬杰科技	1,504,486.00	9.55
18	300413	快乐购	1,325,954.00	8.42
19	603444	吉比特	1,324,850.00	8.41
20	000997	新大陆	1,239,530.00	7.87
21	000063	中兴通讯	1,176,287.00	7.47
22	002138	顺络电子	1,105,350.00	7.02
23	002027	分众传媒	1,099,910.00	6.98
24	603986	兆易创新	1,038,246.44	6.59
25	002624	完美世界	959,432.00	6.09
26	300365	恒华科技	854,543.00	5.42
27	300308	中际装备	849,097.00	5.39

28	300383	光环新网	845,930.00	5.37
29	300170	汉得信息	794,758.00	5.04
30	002841	视源股份	550,730.00	3.50
31	002415	海康威视	528,553.00	3.36
32	300661	圣邦股份	519,088.00	3.29
33	002179	中航光电	469,643.00	2.98
34	300296	利亚德	467,231.00	2.97
35	300571	平治信息	420,059.00	2.67
36	300271	华宇软件	410,025.00	2.60
37	002739	万达电影	392,461.00	2.49
38	600570	恒生电子	358,082.00	2.27
39	002371	北方华创	333,621.00	2.12
40	000977	浪潮信息	316,224.00	2.01

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。

7.4.3 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	72,140,725.92
卖出股票收入（成交）总额	63,111,965.82

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	20,645.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,791.30
5	应收申购款	3,018.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,455.29

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
270	61,711.83	10,077,131.97	60.48%	6,585,063.03	39.52%

8.2 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	210,085.82	1.2600%

8.3 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	10~50

8.4 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	9,999,500.00	60.01	9,999,500.00	60.01	三年
基金管理人高级管理人员	53,897.44	0.32	4,945.98	0.03	三年
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,053,397.44	60.33	10,004,445.98	60.04	三年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年9月14日）基金份额总额	36,300,296.63
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,393,771.27
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	21,031,872.90
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	16,662,195.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 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 40,000.00 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 1 年。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
信达证券	2	124,220,781.58	91.84%	90,842.10	91.84%	-
华创证券	2	9,581,283.00	7.08%	7,006.83	7.08%	-
中信证券	2	1,450,627.16	1.07%	1,060.75	1.07%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权证

		成交总额的比 例		券回购 成交总额 的比例		成交总额的 比例
信达证券	-	-	70,300,000.00	51.92%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	65,100,000.00	48.08%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20180912-20181231	9,999,500.00	0.00	0.00	9,999,500.00	60.01%
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，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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2018 年 9 月 10 日认购本基金金额 10,000,000.00 元，认购费用为 500 元，折合本基金为 9999500.00 份（含募集期利息结转的份额）。以上固有资金作为本基金的发起资金，自本基金基金合同生效之日起，所认购的基金份额持有期限不少于三年。