

# 红土创新新科技股票型发起式证券投资基金 招募说明书（更新）摘要

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

二〇一九年十二月

## 重要提示

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”）经中国证监会 2018 年 6 月 12 日证监许可【2018】951 号文核准募集。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明中国证监会对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金属于股票型证券投资基金，属于证券投资基金中的高风险品种，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型证券投资基金。

本基金投资于证券市场，基金净值会因证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，应仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立、谨慎决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。基金管理人在基金管理实施过程中产生的操作或技术风险、本基金的特定风险等。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个开放日基金的净赎回申请份额超过上一开放日基金总份额的 10% 时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

本招募说明书约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

本招募说明书所载内容截止日期为 2019 年 3 月 13 日，其中投资组合报告与基金业绩截止日期为 2018 年 12 月 31 日。

## 第一部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：红土创新基金管理有限公司

住所：广东省深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街1号前海深港合作区管理局综合办公楼A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦6层

设立日期：2014年6月18日

注册资本：壹亿伍仟万元人民币

股权结构：公司股东为深圳市创新投资集团有限公司（持股比例100%）

法定代表人：邵钢

电话：0755~33011866

传真：0755~33011855

联系人：黄石结

### 二、证券投资基金管理情况

红土创新基金管理有限公司下设16个部门，分别为综合管理部，监察稽核部，投资部，专户投资部，新三板投资部，固定收益部，指数与量化投资部，研究部，交易部，基金事务部，信息技术部，渠道销售部，市场营销部，产品开发部，财富管理部，企划财务部。此外，公司还设立了投资决策委员会、风险管理委员会等专业委员会。

红土创新基金管理有限公司旗下管理8只公募基金。

### 三、主要人员情况

#### 1、公司董事会成员

邵钢先生，董事长，硕士研究生学历，曾任吉林森林工业集团总公司计划开发部科员，深圳市投资管理公司高级投资经理，香港深业投资公司总经理，深圳市创新投资集团有限公司办公室主任兼投资决策委员会常任委员，红土创新基金管理有限公司总经理。现任深圳市创新投资集团有限公司党委副书记，红土创新基金管理有限公司董事长。

高峰先生，董事，硕士学位。曾为全国人大财经委《破产法》起草小组正式成员；历任中国对外经济贸易信托投资公司计划财务部财务科经理和公司发展战略小组成员，中化总公司财务部综合部经理；宝盈基金管理公司筹备组成员、研究发展部高级策略分析师、研究发展部副总经理；中国对外经济贸易信托有限公司资产管理部副总经理、证券业务部总经理、资产管理总部执行总经理并兼任宝盈基金管理有限公司董事；宝盈基金管理有限公司总经理助理、投资部总监；北信瑞丰基金管理有限公司副总经理；现任红土创新基金管理有限公司董事、总经理。

乔旭东先生，董事，博士学位。历任西安交通大学讲师、副教授；深圳市创新投资集团有限公司风控委秘书长助理、研究中心总经理；红土创新基金管理有限公司执行监事；现任红土创新基金管理有限公司董事。

曹泉伟先生，独立董事，博士学历，清华大学教授，历任美国宾夕法尼亚州立大学商学院金融系助理教授、副教授、教授，清华大学五道口金融学院教授、副院长。现任红土创新基金管理有限公司独立董事。

王晓东先生，独立董事，大学学历，律师，历任丹东纺织专科学校教师，丹东市涉外律师事务所律师，信达律师事务所律师，广东经天律师事务所合伙人，广东博合律师事务所合伙人，国浩律师（深圳）事务所合伙人。曾任中国证监会发审委专职委员。现任红土创新基金管理有限公司独立董事。

刘杰生先生，独立董事，大学学历，高级会计师，历任立信羊城会计师事务所有限公司审计员、副主任会计师，立信会计师事务所（特殊普通合伙）合伙人。现任红土创新基金管理有限公司独立董事。

## 2、公司监事：

陈外华，执行监事，博士学历。历任深圳市世纪星源股份有限公司法律顾问、广东律师事务所律师、平安保险公司法律顾问、深圳市创新投资集团有限公司纪委副书记兼投决会委员、风控委委员；现任红土创新基金管理有限公司执行监事。

刘晓东，职工监事，硕士研究生学历，历任鹏华基金管理有限公司监察稽核部副总监，金鹰基金管理有限公司监察稽核部总监；现任红土创新基金管理有限公司监察稽核部总监、职工监事。

公司未设立监事会。

## 3、公司高级管理人员：

高峰先生，总经理，简历同上。

张洗尘先生，督察长，本科学士，曾任新疆奎屯市外贸公司总经理、书记，兵团外经贸委处长，新疆新天集团公司纪委书记、监事会主席，新疆大明矿业集团有限公司监事会主席，深圳市创新投资集团有限公司新疆代表处副主任。现任红土创新基金管理有限公司督察长。

#### 4、本基金基金经理

朱然先生：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；现任红土创新转型精选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、红土创新新科技股票型发起式证券投资基金的基金经理。

#### 5、公司投资决策委员会

高峰先生：公司总经理；

盖俊龙先生：公司基金经理

侯世霞女士：公司基金经理

梁戈伟先生：公司基金经理

朱然先生：本基金的基金经理

上述人员之间不存在亲属关系。

#### 四、基金管理人的职责

按照《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人必须履行以下职责：

1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记手续；

2、办理基金备案手续；

3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；

6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7、依法接受基金托管人的监督；

8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金

合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

- 9、进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- 10、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 11、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 12、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不向他人泄露；
- 13、按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- 14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 15、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上，法律法规另有规定的从其规定；
- 17、确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资人能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；
- 18、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- 20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21、监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- 22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；
- 23、以基金管理人的名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- 24、执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- 25、建立并保存基金份额持有人名册；
- 26、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## 五、基金管理人承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《证券法》，并建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺严格遵守《基金法》、《运作办法》，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止以下《基金法》、《运作办法》禁止的行为发生：

- (1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 除按本公司制度进行基金投资外，直接或间接进行其他股票交易；
- (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 故意损害基金投资人及其他同业机构、人员的合法权益；
- (12) 以不正当手段谋求业务发展；
- (13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (14) 信息披露不真实，有误导、欺诈成分；
- (15) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

4、本基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限

制等全权处理本基金的投资。

5、本基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证基金财产不用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （5）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （6）法律法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## 六、基金经理的承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

2、不利用职务之便为自己及其被代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

3、不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## 七、基金管理人的内部控制制度

公司内部控制是指公司为防范和化解风险，保证经营运作符合公司的发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制措施而形成的系统。公司建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，制定科学完善的内部控制制度。

公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，公司管理层对内部控制制度的有效执行承担责任。

1、公司内部控制遵循以下原则

（1）健全性原则。内部控制涵盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并包括决策、执行、监督、反馈等各个环节。



（2）有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

（3）独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责的设置保持相对独立，公司基金财产、自有资产与其他资产的运作相互分离。

（4）相互制约原则。公司设置的各部门、各岗位权责分明、相互制衡。

（5）成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的成本控制达到最佳的内部控制效果。

## 2、内部控制的主要内容

### （1）控制环境

控制环境构成公司内部控制的基础，包括经营理念、内控文化、公司治理结构、组织结构和员工道德素质等内容。公司坚守诚信原则，树立内控优先的思想和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。公司建立了法人治理结构，确定公司董事会、监事和督察长的职责权限；明确董事会的组成结构和决策程序，充分发挥独立董事在公司治理中的作用；专门设计了防范与股东方利益输送的机制和实施细则，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资人利益和公司的合法权益。公司依照职责明确、相互制约的原则设置运作高效又互相制衡的内部组织架构，各部门授权分工明确，操作相互独立。公司建立了有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人员具备和保持与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。

### （2）风险评估

公司定期和不定期对风险和内部控制进行评估，做好事前、事中和事后的风险管理，并根据市场环境、新的金融工具和新的法律法规等情况，适时改进。

### （3）控制体系

#### 1) 内部控制机制

公司依据自身经营特点，设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线，涵盖决策、执行、监督三个层面。

决策层面：由董事会及下设专门委员会构成，专事负责公司经营管理、受托投资等重大事项的决策；

执行层面：由经理层及下设的投资决策委员会、风险管理委员会等专业委员会和公司各部门组成，负责落实决策层制定的战略部署；

监督层面：由督察长和稽核监察部门等组成，承担监督和管理职责，确保公司经营管理、受托投资、员工行为等符合有关法律法规和公司各项规章制度。

## 2) 内部控制制度

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度和具体部门规章等部分组成。

公司建立了完善的资产分离制度，受托资产与公司资产、不同受托资产之间独立运作，分别核算。

公司建立了科学的岗位分离制度，明确划分各岗位职责，重要岗位不得有人员的重叠。重要业务部门和岗位应进行物理隔离。

公司建立了重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡。

公司制定了切实可行的紧急应变制度，建立了危机处理机制和程序。

公司建立了明确的授权制度，并将其贯穿于公司经营活动的始终。

## (4) 控制活动

控制活动主要包括投资管理业务控制、运营管理业务控制、销售业务控制、信息披露控制、会计系统控制、监察稽核控制等。

公司要求自觉遵守有关法律法规和行业监管规则，按照经营管理和受托投资的性质、特点，严格制定各项制度、规章、操作流程和岗位手册，明确揭示不同业务可能存在的风险点并采取控制措施。

## 3、基金管理人关于内部控制制度的声明

(1) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确。

(2) 本公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

## 第二部分 基金托管人

### 一、基金托管人的情况

#### 1、基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

#### 2、主要人员情况

截至 2018 年 6 月，中国工商银行资产托管部共有员工 212 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

#### 3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2018 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 874 只。自 2003 年以来，本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 61 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

## 二、基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继 2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014 年八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的 SAS70（审计标准第 70 号）审阅后，2015 年、2016 年、2017 年中国工商银行资产托管部均通过 ISAE3402（原 SAS70）审阅，迄今已第十一次获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### 3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演

练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

#### 5、资产托管部内部风险控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知

事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

## 第三部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

红土创新基金管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址：深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦6层

法定代表人：邵钢

联系人：夏芳

联系电话：0755-33011983

传真电话：0755-33011877

客服电话：400-060-3333

电子邮箱：service@htcfund.com

网址：www.htcfund.com

#### 2、代销机构

##### （1）中国工商银行股份有限公司

注册、办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：易会满

联系人：刘秀宇

联系电话：010-66108327

客服电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

##### （2）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号2-6层

办公地址：中国北京西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈有安

联系人：辛国政

客服电话：95551

电话：4008-888-888



网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(3) 中信证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：郑慧

电话：010-60838888

客服电话：95548

公司网站：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(4) 申万宏源证券有限公司

注册、办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：李玉婷

电话：021-33389888

客服电话：95523

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(5) 申万宏源西部证券有限公司

注册、办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国

际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：王怀春

联系人：李玉婷

联系电话：021-33388229

客服电话：0991-5801913

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(6) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲 127 号大成大厦 6 层

法定代表人：张志刚

联系人：付婷

联系电话：010-83252185

客服电话：95321

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

（7）西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：拉萨市北京中路 101 号

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号 16 楼

法定代表人：陈宏

联系人：付佳

联系电话：021-23586603

客服电话：95357

网址：[www.18.cn](http://www.18.cn)

（8）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 2 层

法定代表人：姜晓林

联系人：孙秋月

联系电话：0532-85022326

客服电话：95548

网址：[www.zxzqsd.com.cn](http://www.zxzqsd.com.cn)

（9）中信期货有限公司

注册、办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层  
1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

电话：010-60833754

客服电话：400-990-8826

网址：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

（10）深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元  
11 层

办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 7

层

法人代表：赖任军

联系人：刘昕霞

电话：0755-29330513

客服电话：400-930-0660

公司网址：www.jfzinv.com

（11）上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：唐诗洋

联系电话：021-20691926

客服电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

（12）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

联系人：陈孜明

联系电话：021-61101846

客服电话：400-921-7755

网址：www.leadfund.com.cn

（13）天津万家财富资产管理有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

办公地址：北京市西城区太平桥大街丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 A 座 5 层

法定代表人：李修辞

联系人：李明然

联系电话：010-59013825

客服电话：010-59013895

网址：www.wanjiawealth.com

（14）北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 19 号 A 座 1504/1505 室

法定代表人：张冠宇

联系人：王丽敏

联系电话：010-85932810

客服电话：400-819-9868

网址：[www.tdyhfund.com](http://www.tdyhfund.com)

（15）北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号嘉盛 SOHO 25 层 2507

法定代表人：周斌

联系人：陈霞

联系电话：15249236571

客服电话：400-8980-618

网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

（16）上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发  
展区）

办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室-A1003 室

法定代表人：王翔

联系人：吴鸿飞

客服电话：400-820-5369

网址：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

（17）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册（办公）地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼

法定代表人：汪静波

联系人：王皓

联系电话：021-80358230

客服电话：400-821-5399

网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

（18）珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室—3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东路 1 号保利国际广场南塔 1201-1203 室

法定代表人：肖雯

联系人：梁文燕

联系电话：020-89629025

客服电话：020-89629066

网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

（19）上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

客户服务电话：400-821-0203

网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

（20）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：潘世友

客服电话：400-1818-188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

（21）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市余杭区同顺街 18 号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

联系人：刘宁

客服电话：4008-773-772

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

（22）深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 6 号 HALO 广场 4 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

客服：4006-788-887

网址：www.jjmmw.com

（23）大泰金石基金销售有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：姚杨

联系人：赵明

客服电话：400-928-2266

网址：www.dtfunds.com

（24）上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海浦东新区陆家嘴环路 1333 号

法定代表人：王之光

联系人：宁博宇

客户服务电话：400-821-9031

网址：www.lufunds.com

（25）奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

客户服务电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

（26）北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部 A 座 15 层

法定代表人：江卉

联系人：韩锦星

客户服务电话：95118

网址：<http://jr.jd.com>

（27）上海中正达广基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

办公地址：上海徐汇区龙腾大道 2815 号 302

法定代表人：黄欣

联系人：戴珉微

客户服务电话：400-6767-523

网址：[www.zhongzhengfund.com](http://www.zhongzhengfund.com)

（28）北京汇成基金销售有限公司

公司名称：北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

公司网址：[www.hcjijin.com](http://www.hcjijin.com)

（29）深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

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）

办公地址：深圳市福田区福华路 355 号岗厦皇庭中心 8 楼 DE

法定代表人：高峰

联系人：廖嘉琦

客户服务电话：400-804-8688

网址：[www.foreseakeyenes.com](http://www.foreseakeyenes.com)

（30）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

联系人：张慧

客户服务电话：95177

网址：[www.snjijin.com](http://www.snjijin.com)

（31）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客户服务电话：4000-766-123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

（32）上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼 01、02、03 室

办公地址：海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 5 楼

法定代表人：冷飞

联系人：李娟

联系电话：021-50810687

客服电话：021-50810673

网址：[www.wacaijijin.com](http://www.wacaijijin.com)

（33）济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法定代表人：杨健

联系人：宋静

联系电话：010-65309516-812

客服电话：400-673-7010

网址：[www.jianfortune.com/](http://www.jianfortune.com/)

（34）通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室



办公地址：上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 10 楼

法定代表人：沈丹义

联系人：沈达

联系电话：021-60818423

客服电话：95193

网址：[www.tonghuafund.com](http://www.tonghuafund.com)

（35）北京君德汇富基金销售有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号 2-2-1

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 F 座 12 层 B 室

法定代表人：许宁

联系人：彭雪琳

联系电话：010-85610733

客服电话：400-829-1218

网址：[www.kstreasure.com](http://www.kstreasure.com)

（36）扬州国信嘉利基金销售有限公司

注册地址：广陵新城信息产业基地 3 期 20B 栋

办公地址：扬州市邗江区文昌西路 56 号公元国际大厦 320

法定代表人：刘晓光

联系人：苏曦

联系电话：0514-82099618-805

客服电话：400-021-6088

网址：[www.gxjlc.com](http://www.gxjlc.com)

（37）嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层 4609-10 单元

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

网址：<http://www.harvestwm.cn/>

（38）大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

联系人：辛志辉

联系电话：0411-3902 7817

客服电话：4000-899-100

网址：www.yibaijin.com

（39）上海钜派钰茂基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区泥城镇新城路2号24幢N3187室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路379号金穗大厦14楼C座

法定代表人：胡天翔

联系人：刘方欣

客服电话：400-096-3866

网址：<http://www.jp-fund.com/>

## 二、注册登记机构

名称：红土创新基金管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址：深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦6层

法定代表人：邵钢

联系人：焦小川

电话：0755~33011866

传真：0755~33011855

## 三、律师事务所和经办律师

广东岭南律师事务所

注册、办公地址：广东省广州市海珠区新港西路135号海珠中大科技综合楼601室

负责人：黄添顺

经办律师：欧阳兵

电话：020~84115022

传真：020~84113152

#### 四、会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册、办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：陈熹、曹阳

联系人：曹阳

电话：021-23238888

传真：021-23238800

## 第四部分 基金的名称

红土创新新科技股票型发起式证券投资基金

## 第五部分 基金的类型

股票型、契约型、开放式基金

## 第六部分 基金的投资

### 一、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。

### 二、投资范围

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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

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。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

### 三、投资策略

#### （一）资产配置策略

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。

#### （二）股票投资策略

##### 1、新科技产业上市公司股票的界定

新科技产业利用新技术，空前地活跃了信息沟通和信息融合，代表了未来电信、媒体科技（互联网）、信息技术的融合趋势，是我国信息化升级进程的主要受益产业。本基金根据申银万国证券研究所的行业分类方法，将电子，通信，计算机和传媒等四个申万一级行业界定为新科技产业。

本基金为主题型基金，投资新科技产业上市公司股票的比例不少于非现金资产的 80%。

本基金将充分发挥研究团队的选股能力，基于对个股深入的基本面研究和细致的实地调研，精选股票构建股票投资组合。

##### 2、个股投资策略

###### A、定性分析

本基金对上市公司的竞争优势进行定性评估。上市公司在行业中的相对竞争力是决定投资价值的重要依据，主要包括以下几个方面：

（1）公司的竞争优势：重点考察公司的市场优势，包括市场地位和市场份额，在细分市场是否占据领先地位，是否具有品牌号召力或较高的行业知名度，在营销渠道及营销网络方面的优势和发展潜力等；资源优势，包括是否拥有独特优势的物资或非物质资源，比如市场资源、专利技术等；产品优势，包括是否拥有创新和受专利保护的具有市场竞争力的产品，对产品的定价能力等以及其他优势，例如是否受到中央或地方政府政策的扶持等因素；

（2）公司的盈利模式：对企业盈利模式的考察重点关注企业盈利模式的属性以及成熟程度，考察核心竞争力的不可复制性、可持续性、稳定性；

（3）公司治理方面：考察上市公司是否有清晰、合理、可执行的发展战略；是否具有合理的治理结构，管理团队是否团结高效、经验丰富，是否具有进取精神等。

###### B、定量分析

本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标和估值指标等进行定

量分析，以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。

（1）成长性指标：收入增长率、营业利润增长率和净利润增长率等；

（2）财务指标：毛利率、营业利润率、净利率、净资产收益率、经营活动净收益/利润总额等；

（3）估值指标：市盈率（PE）、市盈率相对盈利增长比率（PEG）、市销率（PS）和总市值。

### （三）债券投资策略

本基金采用的债券投资策略包括：期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、可转换债券投资策略等。

#### 1、期限结构策略

通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对各类型债券进行久期配置。具体策略又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。

#### 2、信用策略

信用债收益率等于基准收益率加信用利差，信用利差收益主要受两个方面的影响，一是该信用债对应信用水平的市场平均信用利差曲线走势；二是该信用债本身的信用变化。基于这两方面的因素，本基金管理人分别采用（1）基于信用利差曲线变化策略和（2）基于信用债信用变化策略。

#### 3、互换策略

不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面存在差别，投资管理人可以同时买入和卖出具有相近特性的两个或两个以上券种，赚取收益级差。

#### 4、息差策略

通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，从而获得杠杆放大收益。

#### 5、可转换债券投资策略

本基金利用宏观经济变化和上市公司的盈利变化，判断市场的变化趋势，选择不同的行业，再根据可转换债券的特性选择各行业不同的转债券种。本基金利用可转换债券的债券底价和到期收益率来判断转债的债性，增强本金投资的相对安全性；利用可转换债券溢价率来判断转债的股性，在市场出现投资机会时，优先选择股性强的品种，获取超额收益。

#### 6、中小企业私募债券投资策略

针对中小企业私募债券，本基金以持有到期、获得本金和票息收入为主要投资策略，同时，密切关注债券的信用风险变化，力争在控制风险的前提下，获得较高收益。基金管理人

应当在基金投资中小企业私募债券后 2 个交易日内,在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。基金管理人应当在基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

#### （四）金融衍生品投资策略

##### 1、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具,投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,立足于无风险套利,力求稳健的投资收益。

##### 2、股指期货投资策略

本基金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,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。

#### （五）资产支持证券投资策略

本基金将通过资产支持证券基础资产及结构设计的研究,结合多种定价模型,根据基金资产组合情况适度进行资产支持证券的投资。未来随着证券市场投资工具的发展和丰富,在符合有关法律法规规定的前提下,本基金可相应调整和更新相关投资策略。

### 四、投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

（1）本基金股票投资比例为基金资产的 80%-95%；投资于本基金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%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的 10%；

（5）基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

（6）本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（7）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%；

（8）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

（9）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（10）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

（11）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（12）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（13）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

（14）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（15）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

（16）本基金参与股指期货交易后，需遵守下列规定：

1）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

2）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

4）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关规定；

（17）本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；

（18）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发



行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

（19）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

（20）基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（21）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（13）、（19）、（20）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其他有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按相关法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联

交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制，或以变更后的规定为准。

## 五、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%。

本基金将电子，通信，计算机和传媒等四个申万一级行业界定为新科技产业，中证 TMT 产业主题指数涵盖了中证全指样本股中 100 只属于信息技术、电信业务以及消费电子产品、媒体中与新科技产业相关的行业的优质公司股票，代表了沪深两市新科技产业相关股票的整体表现。中证综合债指数的选样债券的信用类别覆盖全面，期限构成宽泛，适于做基金债券资产的业绩比较基准。基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金管理人在与基金托管人协商一致，并履行适当程序后调整或变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

## 六、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。

## 七、基金管理人代表基金行使债权人权利的处理原则及方法

- 1、有利于基金资产的安全与增值；
- 2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- 3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## 八、基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载内容不存在虚假记载、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。

本基金的托管人根据基金合同的规定，复核了本报告的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2018 年 12 月 31 日。

### 1、报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	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	其他资产	25,455.29	0.16
9	合计	15,936,339.73	100.00

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

#### （1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	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

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无港股通投资。

3、报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	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

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末无债券投资。

5、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债券投资明细

本基金本报告期末无债券投资。

6、报告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

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

7、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

本基金本报告期末无贵金属投资。

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权证投资明细

本基金本报告期末无权证投资。

#### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### （1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

##### （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。

#### 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 11、投资组合报告附注

##### （1）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
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

##### （2）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

##### （3）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## 第七部分基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。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。

本基金合同生效日为2018年9月14日，基金合同生效以来的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

红土创新新科技股票型发起式证券投资基金

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
2018.9.14(基金合同生效日)-2018.12.31	-5.45%	0.85%	-10.57%	16.61%	5.12%	-15.76%
自基金合同生效至今(2018.12.31)	-5.45%	0.85%	-10.57%	1.61%	5.12%	-0.76%

## 第八部分基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金运作相关的或者为维护基金份额持有人利益支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费和财产保全费等；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

上述“一、基金费用的种类”中第 3-9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人根据基金管理人指令并参照行业惯例从基金财产中支付。

3、证券账户开户费用：证券账户开户费由基金管理人先行垫付，自本基金成立一个月内由基金托管人从基金财产中划付给基金管理人，如资产余额不足支付该开户费用，基金托管人不承担垫付开户费用义务。

证券账户开户费的支付，由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于 5 个工作日内从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。



## 第九部分对招募说明书更新部分的说明

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”）基金合同于 2018 年 9 月 14 日起生效，根据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法律法规及《红土创新新科技股票型发起式证券投资基金基金合同》，结合本公司对本基金实施的投资管理活动，对本基金的招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

### 一、“重要提示”部分

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》，更新了“重要提示”部分。

### 二、“释义”部分

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定更新了基金产品资料概要、指定媒介等释义。

三、根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》，更新了“基金管理人”中“基金管理人的职责”等内容。

### 四、“基金份额的申购与赎回”

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》更新了申购和赎回场所、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告等相关内容。

### 五、“基金收益与分配”部分

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》更新了“基金收益与分配”中的相关内容。

### 六、“基金的会计与审计”部分

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》更新了“基金的会计与审计”中的相关内容。

### 七、“基金的信息披露”部分

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定更新了信息披露部分。

红土创新基金管理有限公司

二〇一九年十二月