

**红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金
招募说明书(更新)摘要
2019 年 1 期**

基金管理人：红土创新基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

二〇一九年十二月

重要提示

红土创新沪深 300 指数增强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 11 月 9 日证监许可[2018]1828 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、基金产品资料概要，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。

本基金投资中的风险包括：证券市场风险、流动性风险、信用风险、管理风险、操作或技术风险、基金投资资产支持证券的风险、基金投资中小企业私募债的风险、基金管理职责终止风险、与指数化投资及股指期货等金融衍生品投资相关的特定风险。本基金是发起式基金，本基金的《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产规模低于 2 亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限，存在着基金合同提前终止的风险。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及基金合同。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（2019 年第 1 期）所载内容截止日期为 2019 年 12 月 05 日，其中投资组合报告与基金业绩截止日期为 2019 年 9 月 30 日，本基金托管人对本招募说明书（2019 年第 1 期）进行了复核。

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

成立日期：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：高峰

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 9 只公募基金。

三、主要人员情况

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（代为履行董事长职务）。

张键先生，董事，硕士学位。曾在深圳市机械设备进出口公司、深圳市逸康医疗仪器有限公司工作；曾任职于深圳市农产品股份有限公司，任人力资源部部长、团委书记、副总经理、党委委员，同时兼任多家农产品下属公司董事长；现任深圳市创新投资集团有限公司党委委员、副总裁、红土创新基金管理有限公司董事。

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

储莽女士（任职时间：2019 年 2 月 25 日-至今）：中国人民大学经济学硕士，历任鹏华基金量化研究员，创金合信基金量化研究员、投资经理。现任红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、红土创新中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。

庞世恩先生（任职时间：2019 年 4 月 19 日-至今）：中国人民大学理学硕士，历任泰康资产管理有限责任公司金融工程研究总监、执行投资经理，创金合信基金量化投资部基金经理。现任红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、红土创新中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。

5、公司投资决策委员会

高峰先生：公司总经理

侯世霞女士：公司基金经理

梁戈伟先生：公司基金经理

盖俊龙先生：公司基金经理

朱然先生：公司基金经理

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资产净值，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、半年度和年度基金报告；

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内发出，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、基金托管人概况

（一）基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987 年 4 月 8 日

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

注册资本：252.20 亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83 号

电话：0755-83199084

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

（二）发展概况

招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于 2002 年 3 月成功地发行了 15 亿 A 股，4 月 9 日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006 年 9 月又成功发行了 22 亿 H 股，9 月 22 日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10 月 5 日行使 H 股超额配售，共发行了 24.2 亿 H 股。截至 2019 年 9 月 30 日，本集团总资产 73,059.25 亿元人民币，高级法下资本充足率 15.44%，权重法下资本充足率 12.86%。

2002 年 8 月，招商银行成立基金托管部；2005 年 8 月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设业务管理团队、产品管理团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、养老金团队、系统与数据团队 7 个职能团队，现有员工 87 人。2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管

（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6 心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，推出国内首个托管大数据平台，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016 年 6 月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获得该奖项的托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7 月荣膺 2016 年中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”。2017 年 6 月招商银行再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”；“全功能网上托管银行 2.0”荣获《银行家》2017 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。2018 年 1 月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2017 年度优秀资产托管机构”奖项；同月，招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获 2016-2017 年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3 月荣膺公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖；5 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12 月荣膺 2018 东方财富风云榜“2018 年度最佳托管银行”、“20 年最值得信赖托管银行”奖。2019 年 3 月招商银行荣获《中国基金报》“2018 年度最佳基金托管银行”奖；6 月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“中国最佳养老金托管机构”“中国最佳零售基金行政外包”三项大奖。

二、主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014 年 7 月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国

国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013 年 5 月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

汪建中先生，本行副行长。1991 年加入本行；2002 年 10 月至 2013 年 12 月历任本行长沙分行行长，总行公司银行部副总经理，佛山分行筹备组组长，佛山分行行长，武汉分行行长；2013 年 12 月至 2016 年 10 月任本行业务总监兼公司金融总部总裁，期间先后兼任公司金融综合管理部总经理、战略客户部总经理；2016 年 10 月至 2017 年 4 月任本行业务总监兼北京分行行长；2017 年 4 月起任本行党委委员兼北京分行行长。2019 年 4 月起任本行副行长。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002 年 9 月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有 20 余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

三、基金托管业务经营情况

截至 2019 年 9 月 30 日，招商银行股份有限公司累计托管 510 只证券投资基金。

四、托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

招商银行确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

（二）内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在招商银行总行风险管控层面对风险进行预防和控制；

二级风险防范是招商银行资产托管部设立稽核监察团队，负责部门内部风险预防和控制；

三级风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时，遵循内控制衡原则，视业务的风险程度制定相应监督制衡机制。

（三）内部控制原则

1、全面性原则。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有团队和岗位。

2、审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风险、审慎经营为出发点，以有效防范各种风险作为内部控制的核心，体现“内控优先”的要求。

3、独立性原则。招商银行资产托管部各团队、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

4、有效性原则。内部控制具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权利，内部控制存在的问题能够得到及时的反馈和纠正。

5、适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要，并能够随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。

6、防火墙原则。招商银行资产托管部配备独立的托管业务技术系统，包括网络系统、应用系统、安全防护系统、数据备份系统。

7、重要性原则。内部控制在实现全面控制的基础上，关注重要托管业务事项和高风险领域。

8、制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

（四）内部控制措施

1、完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务内控管理、产品受理、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

2、经营风险控制。招商银行资产托管部制定托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中

的风险。

3、业务信息风险控制。招商银行资产托管部在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地实时备份，所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

4、客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

5、信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房 24 小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、托管业务网与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护，对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等，保证信息技术系统的安全。

6、人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源管理。

五、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《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》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，基金托管人对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督，对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行，并立即通知基金管理人。

基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定，及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法律法规及基金合同允许的调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。基金管理人对于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。

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：高峰

电话：0755~33011866

传真：0755~33011855

联系人：黄石结

公司网址：www.htxfund.com

2、代销机构

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，增加或者减少基金销售机构。

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：高峰

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

电话：021~23238888

传真：021~23238800

第四部分 基金的名称

红土创新沪深 300 指数增强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

本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.5% 的基础上，追求获得超越标的指数的回报。

二、投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、

公司债、中小企业私募债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款和其他存款）、同业存单、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比为 90%~95%。其中，本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。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

本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.5% 的基础上，追求获得超越标的指数的回报。

1、股票投资策略

本基金股票投资组合的构建以多因子模型为基础框架，并根据预先设定的风险预算、交易成本、投资限制等时机情况的需要进行组合优化。即，本基金股票组合的构建包括多因子模型和投资组合优化两个部分。

（1）多因子模型

多因子模型是一套通用的定量分析框架。在这一框架下，股票收益可分解为一系列因子收益及权重的组合。多因子模型致力于寻找持续稳健的超额收益因子，并进而根据因子收益的预测，形成股票超额收益的预测结果。本基金根据国内证券市场的实际情况，在实证检验的基础上，寻找适合国内市场的因子组合。本基金所采用的多因子模型主要运用包括价值、质量、动量、市场预期等类型的基本因子，并将根据市场状态的变化和因子研究的更新结论，对多因子模型及其所采用的具体因子进行适度调整。在此基础上，基金管理人将根据市场环境的变化，综合因子的实际表现及影响因子收益的众多信息进行前瞻性研判，适时调整各因子类别的具体组合及权重。

（2）投资组合优化模型

在形成股票投资组合的具体结构时，本基金将采取基于风险预算框架、结合交易成本控制的投资组合优化模型。具体而言，根据多因子模型的超额收益预测结果，基金管理人将综合考虑股票超额收益预测值、投资组合整体风险水平、交易成本、冲击成本、流动性以及投资比例限制等因素，通过主动投资组合优化器，构建风险调整后的最优投资组合。

2、债券投资策略

本基金结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。

3、衍生产品投资策略

（1）权证投资策略。权证为本基金辅助性投资工具。权证的投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。

（2）股指期货投资策略。本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。

（3）本基金将关注其他金融衍生产品的推出情况，如法律法规或监管机构允许基金投资其他衍生工具，本基金将按届时有效的法律法规和监管机构的规定，制定与本基金投资目标相适应的投资策略和估值政策，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。

4、其他

未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。

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）本基金股票资产占基金资产的比例为 90%~95%。其中，本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例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) 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%；
- (6) 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%；
- (7) 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%；
- (8) 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%；
- (9) 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%；
- (10) 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%；
- (11) 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%；
- (12) 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；
- (13) 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；
- (14) 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，债券回购到期后不得展期；
- (15) 基金总资产不得超过基金净资产的百分之一百四十；
- (16) 基金参与股指期货交易，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

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，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、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

本基金的标的指数为沪深 300 指数。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+一年期人民币定期存款利率（税后）×5%

如果法律法规发生变化、或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出、或市场上出现更加适用于本基金的业绩基准时，本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，调整基金的业绩比较基准，但应在取得基金托管人同意后报中国证监会备案，并及时公告，无须召开基金份额持有人大会审议。

六、风险收益特征

本基金为股票型基金，理论上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。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。

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 2019 年 9 月 30 日。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	100,984,878.30	93.18
	其中：股票	100,984,878.30	93.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,626,437.30	5.19
	其中：债券	5,626,437.30	5.19
	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	974,360.33	0.90
8	其他资产	790,219.21	0.73
9	合计	108,375,895.14	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

第一，报告期末指数投资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	2,130,414.00	1.98
B	采矿业	2,142,824.00	1.99
C	制造业	32,069,271.30	29.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	314,502.00	0.29
E	建筑业	2,820,458.00	2.62
F	批发和零售业	2,211,404.00	2.05

G	交通运输、仓储和邮政业	1,329,009.00	1.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,859,566.00	1.72
J	金融业	34,500,657.00	31.99
K	房地产业	4,289,950.00	3.98
L	租赁和商务服务业	455,994.00	0.42
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	84,124,049.30	78.00

第二，报告期末积极投资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	206,058.00	0.19
C	制造业	8,274,761.00	7.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,863,780.00	1.73
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,149,353.00	1.99
G	交通运输、仓储和邮政业	897,165.00	0.83
H	住宿和餐饮业	46,300.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	542,487.00	0.50
J	金融业	344,806.00	0.32
K	房地产业	135,587.00	0.13
L	租赁和商务服务业	548,328.00	0.51
M	科学研究和技术服务业	198,440.00	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	337,427.00	0.31
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	1,082,007.00	1.00
S	综合	234,330.00	0.22
	合计	16,860,829.00	15.63

(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股票投资组合。

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

(1) 报告期末指数投资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	601318	中国平安	110,000	9,574,400.00	8.88
2	600519	贵州茅台	7,800	8,970,000.00	8.32
3	000651	格力电器	90,300	5,174,190.00	4.80
4	601398	工商银行	725,400	4,011,462.00	3.72
5	002415	海康威视	103,300	3,336,590.00	3.09
6	600016	民生银行	534,700	3,218,894.00	2.98
7	601288	农业银行	919,100	3,180,086.00	2.95
8	600000	浦发银行	251,800	2,981,312.00	2.76
9	600837	海通证券	174,400	2,493,920.00	2.31
10	600048	保利地产	174,300	2,492,490.00	2.31

(2) 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明

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	603368	柳药股份	9,700	346,872.00	0.32
2	600216	浙江医药	30,000	343,500.00	0.32
3	000878	云南铜业	34,200	343,368.00	0.32
4	601677	明泰铝业	32,100	342,507.00	0.32
5	600327	大东方	99,400	341,936.00	0.32

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	5,626,437.30	5.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	5,626,437.30	5.22
----	----	--------------	------

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019611	19 国债 01	56,270	5,626,437.30	5.22

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
本基金本报告期末无股指期货投资。

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）本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编辑日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

（2）本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,652.39
2	应收证券清算款	694,555.46
3	应收股利	-
4	应收利息	92,691.62
5	应收申购款	319.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	790,219.21

（4）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。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有流通受限股票投资。

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 2019 年 2 月 25 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：

沪深 300 增强 A

阶段	净值增长率①	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
2019.2.25(基金合同生效日)-2019.9.30	5.65%	1.22%	8.05%	1.34%	-2.4%	-0.12%
自基金合同生效至今	5.65%	1.22%	8.05%	1.34%	-2.4%	-0.12%

沪深 300 增强 C

阶段	净值增长率①	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
2019.2.25(基金合同生效日)-2019.9.30	5.39%	1.22%	8.05%	1.34%	-2.66%	-0.12%
自基金合同生效至今	5.39%	1.22%	8.05%	1.34%	-2.66%	-0.12%

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、C 类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《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、仲裁费等；

- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 9、基金的证券、期货交易费用；
- 10、基金的银行汇划费用；
- 11、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 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 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 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。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。

3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，仅就 C 类基金份额所代表的基金资产收取销售服务费。本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

4、标的指数许可使用费

《基金合同》生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定，从基金财产中向中证指数有限公司支付。标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.016% 的年费率计提。具体计算方法如下：；

$$H=E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为本基金前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币壹万元（10,000 元），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

如果标的指数许可使用费的计算方法或费率发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数许可使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒介进行公告，此项调整无须召开基金份额持有人大会审议。

5、上述“一、基金费用的种类中第 5~11 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。

6、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

红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同于 2019 年 2 月 25 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》、《公开募集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《红土创新沪深 300 指数增强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

更新了招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现的截止日。

二、“基金管理人”部分

根据最新信息，更新了基金管理人概况、证券投资基金管理情况、主要人员情况等。

三、“基金托管人”部分

根据最新信息，更新了基金托管人的信息。

四、“相关服务机构”部分

根据最新信息，更新了基金份额发售机构、注册登记机构、会计师事务所和经办注册会计师的信息。

五、“基金的募集”部分

对基金的募集情况进行了说明。

六、“基金合同的生效”部分

增加了“基金合同的生效”。

七、“基金份额的申购与赎回”

更新了基金转换、定期定额投资计划等相关内容。

八、“基金的投资”部分

增加了“基金投资组合报告”。

九、“基金业绩”部分

增加了“基金业绩”报告。

十、“其他应披露事项”部分

增加了“其他应披露事项”部分，并列示了 2019 年 2 月 25 日至 2019 年 12 月 5 日期间相关公告的内容。

红土创新基金管理有限公司

二〇一九年十二月