

# 红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券 投资基金 2020 年年度报告

2020 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。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 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
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.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	26
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>55</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	55
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	55
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	66
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.....	66
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	66

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 .....	66
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 .....	67
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	67
8.12 投资组合报告附注 .....	67
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>69</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	69
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 .....	69
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	70
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>71</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>72</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	72
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 .....	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	72
11.4 基金投资策略的改变 .....	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	72
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 .....	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	72
11.8 其他重大事件 .....	73
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>76</b>
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 .....	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	76
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>77</b>
13.1 备查文件目录 .....	77
13.2 存放地点 .....	77
13.3 查阅方式 .....	77

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	红土创新沪深 300 增强	
基金主代码	006698	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 2 月 25 日	
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	
报告期末基金份额总额	30,171,640.12 份	
下属分级基金的基金简称:	沪深 300 增强 A	沪深 300 增强 C
下属分级基金的交易代码:	006698	006699
报告期末下属分级基金的份额总额	17,097,884.56 份	13,073,755.56 份

### 2.2 基金产品说明

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。
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。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。
业绩比较基准	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%
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。

	沪深 300 增强 A	沪深 300 增强 C
--	-------------	-------------

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张洗尘	张燕
	联系电话	0755-33011878	0755-83199084
	电子邮箱	zhangxc@htcfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		0755-33011866	95555
传真		0755-33011855	0755-83195201
注册地址		广东省深圳市前海深港合 作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室	深圳市深南大道 7088 号招商银 行大厦
办公地址		深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银 行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		高峰	缪建民

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网 址	<a href="http://www.htcfund.com">http://www.htcfund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊 普通合伙)	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号 星展银行大厦 6 楼

注册登记机构	红土创新基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 层
--------	--------------	----------------------------

### § 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	2020 年		2019 年 2 月 25 日 (基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日	
	沪深 300 增强 A	沪深 300 增强 C	沪深 300 增强 A	沪深 300 增强 C
本期已实现收益	5,295,532.91	4,305,175.85	1,442,086.93	2,894,275.29
本期利润	7,232,016.36	2,167,772.27	2,185,338.95	4,976,772.91
加权平均基金份额本期利润	0.3976	0.0637	0.1476	0.1740
本期加权平均净值利润率	31.02%	5.31%	13.78%	16.16%
本期基金份额净值增长率	37.02%	36.59%	14.20%	13.68%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末	
期末可供分配利润	6,831,617.10	5,078,648.38	2,328,608.36	7,593,738.66
期末可供分配基金份额利润	0.3996	0.3885	0.0910	0.0859
期末基金资产净值	26,753,969.00	20,300,936.75	29,207,330.30	100,450,410.62
期末基金份额净值	1.5648	1.5528	1.1420	1.1368
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末	
基金份额累计净值增长率	56.48%	55.28%	14.20%	13.68%



## 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

沪深 300 增强 A

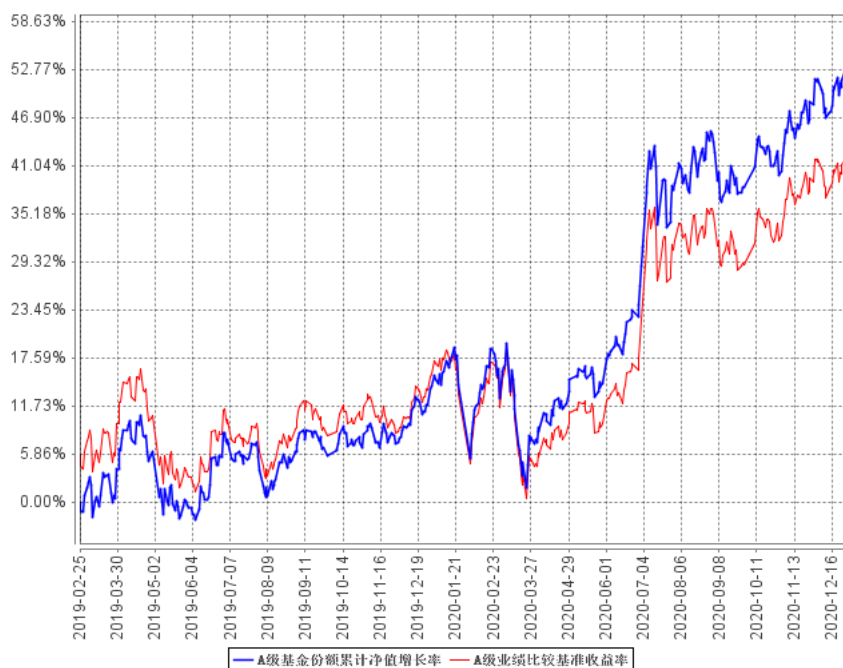
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.12%	0.93%	12.92%	0.94%	0.20%	-0.01%
过去六个月	26.13%	1.29%	23.87%	1.28%	2.26%	0.01%
过去一年	37.02%	1.38%	25.94%	1.36%	11.08%	0.02%
自基金合同生效起至今	56.48%	1.25%	45.66%	1.28%	10.82%	-0.03%

沪深 300 增强 C

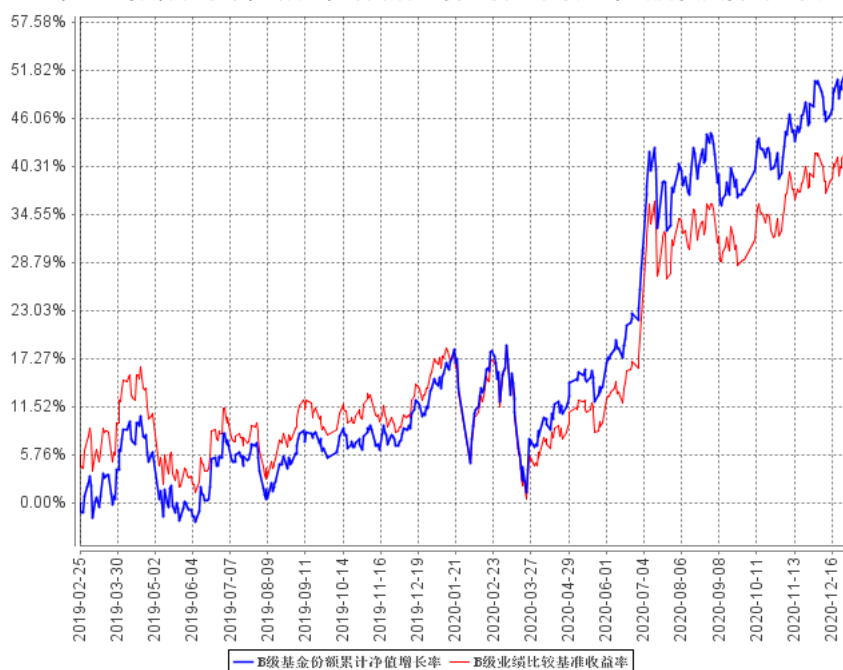
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.03%	0.93%	12.92%	0.94%	0.11%	-0.01%
过去六个月	25.94%	1.29%	23.87%	1.28%	2.07%	0.01%
过去一年	36.59%	1.38%	25.94%	1.36%	10.65%	0.02%
自基金合同生效起至今	55.28%	1.25%	45.66%	1.28%	9.62%	-0.03%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

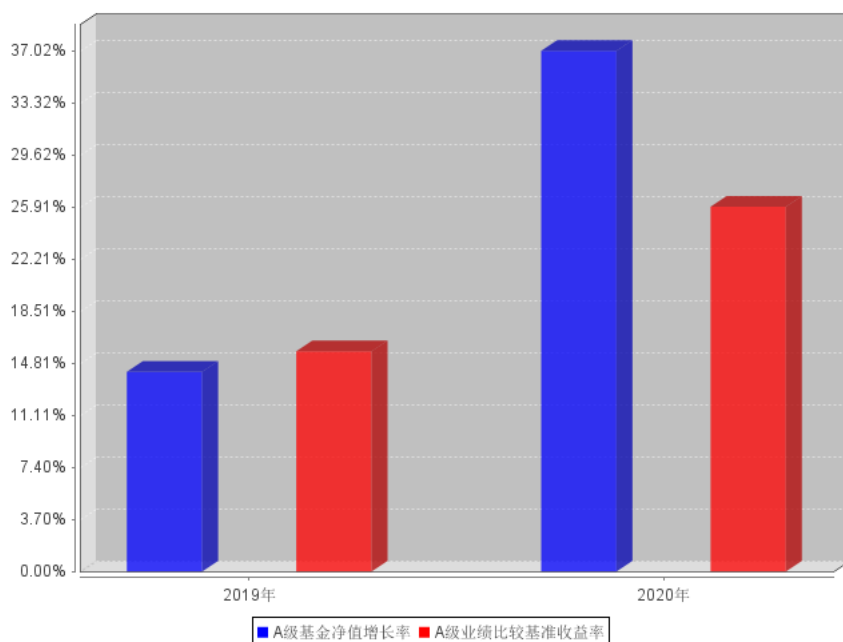


B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

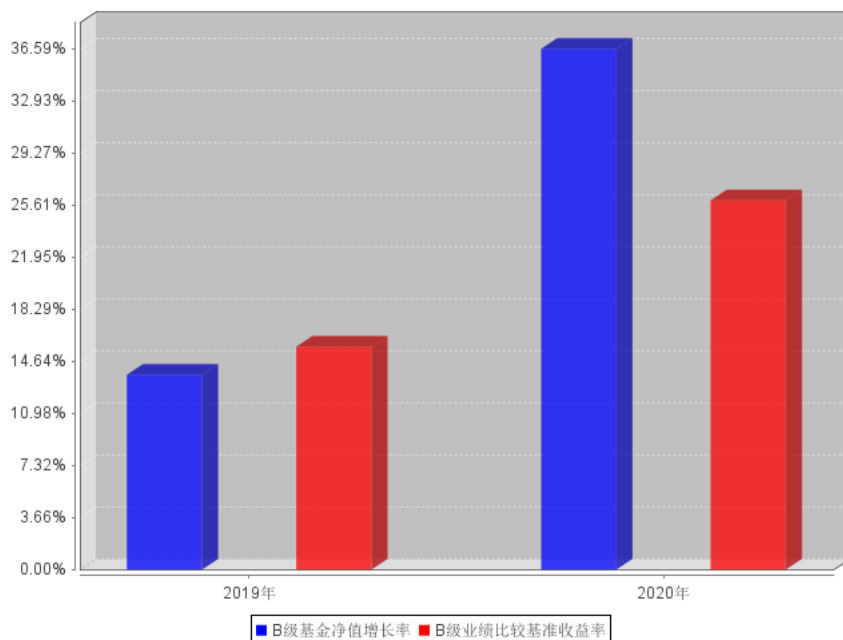


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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



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



### 3.3 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 4 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 2020 年 12 月 31 日，红土创新基金共管理 13 只公募基金，资产管理规模 76.99 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		
储荞	基金经理	2019年2月25日	-	7	中国人民大学经济学硕士，历任鹏华基金管理有限公司量化研究员，创金合信基金管理有限公司量化研究员、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	基金经理	2019年4月19日	-	6	中国人民大学理学硕士。曾任泰康资产

				<p>管理有限责任公司          金融工程研究总监、          执行投资经理；创金          合信基金管理有限          公司量化投资部基          金经理，管理过创金          合信沪深 300 指数          增强型发起式证券          投资基金、创金合信          中证 500 指数增强          型发起式证券投资          基金、创金合信量          化多因子股票型证          券投资基金、创金          合信鑫回报灵活配          置混合型证券投资          基金、创金合信          中证 1000 指数          增强型发起式证          券投资基金。现任          红土创新基金管理          有限公司量化投资          部负责人，担任红          土创新沪深 300 指          数增强型发起式证          券投资基金、中证          500 指数增强型          发起式证券投资基金          基金经理。</p>
--	--	--	--	---

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。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、《红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金合同》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（2011 年修订）》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及分析手段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投资组合，切实防范利益输送。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 30 次，该基金为量化选股策略基金，发生反向交易行为的原因：基金在调仓时点，多个选股模型在少数股票上产生分歧，产生了反向交易信号而发生反向交易。交易时采用算法交易，全天匀速缓慢成交，未对当天的股票价格产生冲击。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 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

回顾 2020 年，我们严格依据量化选股模型进行投资，并严格进行风险管理。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末沪深 300 增强 A 基金份额净值为 1.5648 元，本报告期基金份额净值增长率为 37.02%；截至本报告期末沪深 300 增强 C 基金份额净值为 1.5528 元，本报告期基金份额净值增长率为 36.59%；同期业绩比较基准收益率为 25.94%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球刺激计划不断进行，推动经济复苏。从拜登的 1.9 万亿刺激计划有望到 3 月初正式落地，到耶伦号召 G7 加大财政支持力度。我们可以看到全球从美国、欧洲、日本，进入经济复苏+刺激计划双催化阶段；全球经济复苏，全球大宗价格上涨，PPI 提升，A 股中上游周期行业受益。当前我国宏观经济基本面持续复苏，中上游顺周期业绩有望迎来全球共振。

去年疫情对于实体经济的负面影响仍未完全消除，我们认为在国内宏观经济完全恢复之前，央行对于短期通胀的容忍度较高，货币政策大概率不会转向。相对宽松的货币环境有利于股市。

所以，我们对 A 股市场未来的走势持乐观的态度。我们较为看好今年上半年的股市行情，而下半年股市最大的不确定性在于中美关系的走向，预计下半年股市有一定的动荡风险。在投资管理上，我们坚持严格采用量化模型进行投资运作。

## 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**

遵照本基金合同约定，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**

本基金为发起式基金，不适用本项说明。



## § 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 22415 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“红土创新沪深 300 指数增强型发起式基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了红土创新沪深 300 指数增强型发起式基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于红土创新沪深 300 指数增强型发起式基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	红土创新沪深 300 指数增强型发起式基金的基金管理人红土创新基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、

	<p>执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估红土创新沪深 300 指数增强型发起式基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算红土创新沪深 300 指数增强型发起式基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督红土创新沪深 300 指数增强型发起式基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p>

	<p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能导致对红土创新沪深 300 指数增强型发起式基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致红土创新沪深 300 指数增强型发起式基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波   曹阳
会计师事务所的地址	中国·上海市
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	790,513.56	3,700,316.52
结算备付金		243,000.67	783,219.19
存出保证金		21,574.94	61,184.40
交易性金融资产	7.4.7.2	47,427,746.81	125,566,925.10
其中：股票投资		44,458,901.81	120,013,842.90
基金投资		-	-
债券投资		2,968,845.00	5,553,082.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,157,037.10
应收利息	7.4.7.5	57,582.04	123,366.05
应收股利		-	-
应收申购款		12,047.66	2,797.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		48,552,465.68	131,394,845.72
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2019 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		900,000.00	-
应付证券清算款		198,305.05	-
应付赎回款		25,380.78	1,329,725.99
应付管理人报酬		30,194.90	78,933.34
应付托管费		5,661.55	14,799.98
应付销售服务费		4,772.91	21,767.24
应付交易费用	7.4.7.7	82,838.47	191,590.33
应交税费		-	-
应付利息		400.89	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	250,005.38	100,287.92
负债合计		1,497,559.93	1,737,104.80
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	30,171,640.12	113,941,575.88
未分配利润	7.4.7.10	16,883,265.63	15,716,165.04
所有者权益合计		47,054,905.75	129,657,740.92
负债和所有者权益总计		48,552,465.68	131,394,845.72

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 30,171,640.12 份，A 类基金份额 17,097,884.56 份，基金份额净值 1.5648 元；C 类基金份额 13,073,755.56 份，基金份额净值 1.5528 元。

## 7.2 利润表

会计主体：红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 2 月 25 日(基 金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		11,375,207.32	8,585,598.29
1.利息收入		141,643.65	64,703.23
其中：存款利息收入	7.4.7.11	24,586.83	19,741.29
债券利息收入		117,056.82	44,881.15
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	80.79
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,311,212.02	5,635,336.69
其中：股票投资收益	7.4.7.12	10,617,708.53	5,335,803.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-43,940.02	-770.05
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	42,990.29	-
股利收益	7.4.7.16	694,453.22	300,302.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-200,920.13	2,825,749.64
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	123,271.78	59,808.73
<b>减：二、费用</b>		1,975,418.69	1,423,486.43
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	526,164.96	324,348.38
2. 托管费	7.4.10.2.2	98,655.90	60,815.29
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	127,250.58	80,234.03

4. 交易费用	7.4.7.19	986,819.27	828,573.44
5. 利息支出		20,585.84	3,970.27
其中：卖出回购金融资产支出		20,585.84	3,970.27
6. 税金及附加		154.76	-
7. 其他费用	7.4.7.20	215,787.38	125,545.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>9,399,788.63</b>	<b>7,162,111.86</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>9,399,788.63</b>	<b>7,162,111.86</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	113,941,575.88	15,716,165.04	129,657,740.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,399,788.63	9,399,788.63
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）	-83,769,935.76	-8,232,688.04	-92,002,623.80
其中：1. 基金申购款	96,572,530.64	17,317,958.76	113,890,489.40



2. 基金赎回款	-180,342,466.40	-25,550,646.80	-205,893,113.20
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）	30,171,640.12	16,883,265.63	47,054,905.75
项目	上年度可比期间		
	2019年2月25日(基金合同生效日)至2019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）	12,759,948.62	-	12,759,948.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,162,111.86	7,162,111.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	101,181,627.26	8,554,053.18	109,735,680.44
其中：1. 基金申购款	162,078,766.96	13,638,579.49	175,717,346.45
2. 基金赎回款	-60,897,139.70	-5,084,526.31	-65,981,666.01
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）	113,941,575.88	15,716,165.04	129,657,740.92

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：

<u>        阮菲        </u>	<u>        周厚桥        </u>	<u>        焦小川        </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]第 1828 号《关于准予红土创新沪深 300 指数增强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《红土创新沪深 300 指数增强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 12,759,006.28 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(2019)第 0117 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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》于 2019 年 2 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 12,759,948.62 份基金份额,其中认购资金利息折合 942.34 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,基金托管人为招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 10,000,800.08 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《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》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定,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)、存托凭证、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)。本基金持有的股票、存托凭证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%;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的投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+一年期人民币定期存款利率(税后) $\times$ 5%。

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 2021 年 3 月 29 日批准报出。

#### 7.4.2 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<年度报告和中期报告>》、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》、《红土创新沪深 300 指数增强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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 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。比较财务报表的实际编制期间为 2019 年 2 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 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、债券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的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。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）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。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（3）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，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》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及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、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。



(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	790,513.56	3,700,316.52
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	790,513.56	3,700,316.52

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	41,812,209.20	44,458,901.81	2,646,692.61
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	2,990,708.10	2,968,845.00	-21,863.10
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,990,708.10	2,968,845.00	-21,863.10
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		44,802,917.30	47,427,746.81	2,624,829.51
项目	上年度末			
	2019年12月31日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		117,195,054.46	120,013,842.90	2,818,788.44
贵金属投资-金交所 黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	5,546,121.00	5,553,082.20	6,961.20
	银行间市场	-	-	-
	合计	5,546,121.00	5,553,082.20	6,961.20
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		122,741,175.46	125,566,925.10	2,825,749.64

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无余额。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	72.47	1,083.22
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	118.25	387.75
应收债券利息	57,380.65	121,864.72
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	10.67	30.36
合计	57,582.04	123,366.05

**7.4.7.6 其他资产**

无余额。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	82,838.47	191,590.33
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	82,838.47	191,590.33

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	5.38	287.92
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	250,000.00	100,000.00
合计	250,005.38	100,287.92

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

沪深 300 增强 A		
项目	本期	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,575,450.19	25,575,450.19
本期申购	16,499,695.04	16,499,695.04
本期赎回（以“-”号填列）	-24,977,260.67	-24,977,260.67
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	17,097,884.56	17,097,884.56

金额单位：人民币元

沪深 300 增强 C		
项目	本期	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	88,366,125.69	88,366,125.69
本期申购	80,072,835.60	80,072,835.60
本期赎回（以“-”号填列）	-155,365,205.73	-155,365,205.73
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	13,073,755.56	13,073,755.56

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

沪深 300 增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,328,608.36	1,303,271.75	3,631,880.11
本期利润	5,295,532.91	1,936,483.45	7,232,016.36
本期基金份额交易产生的变动数	-792,524.17	-415,287.86	-1,207,812.03
其中：基金申购款	2,087,618.58	904,696.95	2,992,315.53
基金赎回款	-2,880,142.75	-1,319,984.81	-4,200,127.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,831,617.10	2,824,467.34	9,656,084.44

单位：人民币元

沪深 300 增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,593,738.66	4,490,546.27	12,084,284.93
本期利润	4,305,175.85	-2,137,403.58	2,167,772.27
本期基金份额交易产生的变动数	-6,820,266.13	-204,609.88	-7,024,876.01

其中：基金申购款	8,172,347.24	6,153,295.99	14,325,643.23
基金赎回款	-14,992,613.37	-6,357,905.87	-21,350,519.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,078,648.38	2,148,532.81	7,227,181.19

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年 12月31日	2019年2月25日(基金合同生效日) 至2019年12月31日
活期存款利息收入	16,715.75	13,517.92
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	6,850.53	5,990.59
其他	1,020.55	232.78
合计	24,586.83	19,741.29

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020 年12月31日	2019年2月25日(基金 合同生效日)至2019年12月 31日
卖出股票成交总额	540,006,813.64	422,475,532.32
减：卖出股票成本总额	529,389,105.11	417,139,728.50
买卖股票差价收入	10,617,708.53	5,335,803.82

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年2月25日(基金合 同生效日)至2019年12月31 日
卖出债券(、债转股及债券到期兑 付)成交总额	20,600,164.67	2,501,106.43
减:卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成本总额	20,054,364.08	2,450,375.79
减:应收利息总额	589,740.61	51,500.69
买卖债券差价收入	-43,940.02	-770.05

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

单位:人民币元

项目	本期收益金额 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间收益金额 2019年2月25日(基金合同生效 日)至2019年12月31日
股指期货-投资收益	42,990.29	-

#### 7.4.7.16 股利收益

单位:人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年2月25日(基金合同生效 日)至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	694,453.22	300,302.92
其中:证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-

合计	694,453.22	300,302.92
----	------------	------------

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年2月25日(基金合同 生效日)至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	-200,920.13	2,825,749.64
——股票投资	-172,095.83	2,818,788.44
——债券投资	-28,824.30	6,961.20
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-200,920.13	2,825,749.64

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年2月25日(基金合同生 效日)至2019年12月31日
基金赎回费收入	113,478.68	59,804.88
基金转换费收入	9,793.10	3.85
合计	123,271.78	59,808.73

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费



的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 2 月 25 日(基金合同生 效日)至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	986,819.27	828,573.44
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	986,819.27	828,573.44

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 2 月 25 日(基金合同 生效日)至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	50,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	40,000.00	33,777.78
银行费用	5,787.38	1,767.24
合计	215,787.38	125,545.02

注：指数使用费按前一日基金资产净值的 0.016% 的年费率计提，收取下限为每季度 10,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

无。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 7.4.9 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
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
深创投红土资产管理(深圳)有限公司（“深创投红土资管”）	基金管理人的全资子公司

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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年2月25日(基金合同生效日)至2019年12月31日
当期发生的基金应支付	526,164.96	324,348.38

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	87,377.10	66,282.59

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 0.80%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 × 0.80% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年2月25日(基金合同生效日)至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	98,655.90	60,815.29

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%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 × 0.15% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020年1月1日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	沪深 300 增强 A	沪深 300 增强 C	合计
红土创新	-	92,284.09	92,284.09
合计	-	92,284.09	92,284.09
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019年2月25日(基金合同生效日)至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	沪深 300 增强 A	沪深 300 增强 C	合计
红土创新	-	39,478.68	39,478.68
合计	-	39,478.68	39,478.68

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给红土创新，再由红土创新计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	沪深 300 增强 A	沪深 300 增强 C
基金合同生效日（2019 年 2 月 25 日）持有的基金份额	5,000,400.08	5,000,400.00
报告期初持有的基金份额	5,000,400.08	5,000,400.00
报告期间申购/买入总份额	9,545,138.13	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	14,545,538.21	5,000,400.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	48.21%	16.57%

项目	上年度可比期间	
	2019 年 2 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日	
	沪深 300 增强 A	沪深 300 增强 C
基金合同生效日(2019 年 2 月 25 日)持有的基金份额	5,000,400.08	5,000,400.08
报告期初持有的基金份额	5,000,400.08	5,000,400.08
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,400.08	5,000,400.08
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.39%	4.39%

注: 基金管理人红土创新投资本基金适用的交易费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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

无。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		2019 年 2 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 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
招商银行	790,513.56	16,715.75	3,700,316.52	13,518.03

注: 本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管, 按银行同业利率计息。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况**

无。

**7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
605277	新亚电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未上市	16.95	16.95	316	5,356.20	5,356.20	-
003030	祖名股份	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未上市	15.18	15.18	336	5,100.48	5,100.48	-
003031	中瓷电子	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 4 日	新股未上市	15.27	15.27	285	4,351.95	4,351.95	-
600919	江苏银行	2020 年 12 月 17 日	2021 年 1 月 14 日	配股未上市	4.59	5.46	37,320	171,298.80	203,767.20	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 900,000.00 元,截至 2021 年 1 月 8 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金,主要投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股,其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内,使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会,负责制定风险管理的宏观政策,审议通过风险控制的总体措施等;在管理层层面设立风险管理委员会,讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施;在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估,督察长负责组织指导监察稽核工作。

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

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2019 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.03%)。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 900,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性



风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同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%，本基金与由本基金的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%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.46%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在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时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	790,513.56	-	-	-	790,513.56
结算备付金	243,000.67	-	-	-	243,000.67
存出保证金	21,574.94	-	-	-	21,574.94
交易性金融资产	2,968,845.00	-	-	44,458,901.81	47,427,746.81
应收利息	-	-	-	57,582.04	57,582.04
应收申购款	-	-	-	12,047.66	12,047.66
资产总计	4,023,934.17	-	-	44,528,531.51	48,552,465.68
负债					
卖出回购金融资产款	900,000.00	-	-	-	900,000.00
应付证券清算款	-	-	-	198,305.05	198,305.05
应付赎回款	-	-	-	25,380.78	25,380.78
应付管理人报酬	-	-	-	30,194.90	30,194.90
应付托管费	-	-	-	5,661.55	5,661.55
应付销售服务费	-	-	-	4,772.91	4,772.91
应付交易费用	-	-	-	82,838.47	82,838.47
应付利息	-	-	-	400.89	400.89
其他负债	-	-	-	250,005.38	250,005.38
负债总计	900,000.00	-	-	597,559.93	1,497,559.93
利率敏感度缺口	3,123,934.17	-	-	43,930,971.58	47,054,905.75
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2019 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	3,700,316.52	-	-	-	3,700,316.52
结算备付金	783,219.19	-	-	-	783,219.19
存出保证金	61,184.40	-	-	-	61,184.40
交易性金融资产	5,520,310.20	-	32,772.00	120,013,842.90	125,566,925.10
应收证券清算款	-	-	-	1,157,037.10	1,157,037.10
应收利息	-	-	-	123,366.05	123,366.05
应收申购款	-	-	-	2,797.36	2,797.36
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,065,030.31	-	32,772.00	121,297,043.41	131,394,845.72
负债					
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	1,329,725.99	1,329,725.99
应付管理人报酬	-	-	-	78,933.34	78,933.34
应付托管费	-	-	-	14,799.98	14,799.98
应付销售服务费	-	-	-	21,767.24	21,767.24
应付交易费用	-	-	-	191,590.33	191,590.33
其他负债	-	-	-	100,287.92	100,287.92
负债总计	-	-	-	1,737,104.80	1,737,104.80
利率敏感度缺口	10,065,030.31	-	32,772.00	119,559,938.61	129,657,740.92

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 6.31% (2019 年 12 月 31 日：4.28%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2019 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票、存托凭证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%；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的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	44,458,901.81	94.48	120,013,842.90	92.56
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	44,458,901.81	94.48	120,013,842.90	92.56

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末（2020 年 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	223.50	599.16
2. 沪深 300 指数下降 5%	-223.50	-599.16	

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 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 2020 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 44,240,325.98 元，属于第二层次的余额为 3,187,420.83 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 119,408,577.83 元，第二层次 6,158,347.27 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和债券，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和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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 2020 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(2019 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。

(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。

## § 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	44,458,901.81	91.57
	其中：股票	44,458,901.81	91.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,968,845.00	6.11
	其中：债券	2,968,845.00	6.11
	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	1,033,514.23	2.13
8	其他各项资产	91,204.64	0.19
9	合计	48,552,465.68	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资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	801,840.00	1.70
B	采矿业	1,766,101.00	3.75
C	制造业	19,463,890.82	41.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	746,524.00	1.59
E	建筑业	706,433.00	1.50
F	批发和零售业	729,167.00	1.55
G	交通运输、仓储和邮政业	1,182,282.00	2.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务	241,430.00	0.51

	业		
J	金融业	12,551,781.20	26.67
K	房地产业	1,318,153.00	2.80
L	租赁和商务服务业	1,104,789.00	2.35
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	259,962.00	0.55
Q	卫生和社会工作	981,059.00	2.08
R	文化、体育和娱乐业	152,250.00	0.32
S	综合	-	-
	合计	42,005,662.02	89.27

### 8.2.2 期末积极投资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	2,116,264.97	4.50
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	-	-
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	13,409.82	0.03
J	金融业	323,565.00	0.69



K	房地产业	-	-
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	2,453,239.79	5.21

### 8.2.3 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所有股票投资明细

### 8.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	31,700	2,757,266.00	5.86
2	000333	美的集团	20,000	1,968,800.00	4.18
3	600887	伊利股份	37,600	1,668,312.00	3.55
4	601166	兴业银行	79,400	1,657,078.00	3.52
5	600000	浦发银行	163,000	1,577,840.00	3.35
6	000568	泸州老窖	5,500	1,243,880.00	2.64
7	002475	立讯精密	22,009	1,235,145.08	2.62
8	300059	东方财富	38,400	1,190,400.00	2.53
9	002352	顺丰控股	13,400	1,182,282.00	2.51
10	300015	爱尔眼科	13,100	981,059.00	2.08

11	600809	山西汾酒	2,600	975,754.00	2.07
12	600031	三一重工	26,800	937,464.00	1.99
13	601899	紫金矿业	99,000	919,710.00	1.95
14	600438	通威股份	22,000	845,680.00	1.80
15	300124	汇川技术	8,900	830,370.00	1.76
16	600837	海通证券	63,800	820,468.00	1.74
17	002714	牧原股份	10,400	801,840.00	1.70
18	000725	京东方 A	126,800	760,800.00	1.62
19	601211	国泰君安	40,500	709,965.00	1.51
20	600900	长江电力	33,200	636,112.00	1.35
21	601888	中国中免	2,000	564,900.00	1.20
22	300142	沃森生物	14,500	559,120.00	1.19
23	002027	分众传媒	54,700	539,889.00	1.15
24	000661	长春高新	1,200	538,692.00	1.14
25	600028	中国石化	129,900	523,497.00	1.11
26	600309	万华化学	5,500	500,720.00	1.06
27	000895	双汇发展	10,600	497,564.00	1.06
28	601988	中国银行	142,000	451,560.00	0.96
29	600104	上汽集团	18,300	447,252.00	0.95
30	600741	华域汽车	15,300	440,946.00	0.94
31	300408	三环集团	11,400	424,650.00	0.90
32	002736	国信证券	31,000	422,840.00	0.90
33	601398	工商银行	81,800	408,182.00	0.87
34	001979	招商蛇口	30,200	401,358.00	0.85
35	000776	广发证券	24,500	398,860.00	0.85
36	002236	大华股份	20,000	397,800.00	0.85
37	300003	乐普医疗	14,400	391,392.00	0.83
38	601377	兴业证券	43,400	376,712.00	0.80

39	002008	大族激光	8,100	346,275.00	0.74
40	000786	北新建材	8,500	340,425.00	0.72
41	601818	光大银行	83,000	331,170.00	0.70
42	002179	中航光电	4,200	328,818.00	0.70
43	600600	青岛啤酒	3,300	328,020.00	0.70
44	600522	中天科技	30,200	327,368.00	0.70
45	688036	传音控股	2,041	310,517.74	0.66
46	601607	上海医药	15,900	305,280.00	0.65
47	600015	华夏银行	44,000	275,000.00	0.58
48	002414	高德红外	6,500	271,375.00	0.58
49	300033	同花顺	2,100	260,358.00	0.55
50	002607	中公教育	7,400	259,962.00	0.55
51	600872	中炬高新	3,900	259,935.00	0.55
52	601225	陕西煤业	27,800	259,652.00	0.55
53	601117	中国化学	42,300	248,301.00	0.53
54	600998	九州通	13,600	246,976.00	0.52
55	600845	宝信软件	3,500	241,430.00	0.51
56	600019	宝钢股份	39,700	236,215.00	0.50
57	601231	环旭电子	12,100	234,014.00	0.50
58	000002	万科 A	8,000	229,600.00	0.49
59	000671	阳光城	34,500	224,940.00	0.48
60	600958	东方证券	18,900	219,807.00	0.47
61	600068	葛洲坝	33,000	217,140.00	0.46
62	601288	农业银行	68,000	213,520.00	0.45
63	600606	绿地控股	35,700	208,131.00	0.44
64	600919	江苏银行	37,320	203,767.20	0.43
65	002271	东方雨虹	5,100	197,880.00	0.42
66	000538	云南白药	1,700	193,120.00	0.41

67	600655	豫园股份	19,900	176,911.00	0.38
68	002508	老板电器	4,200	171,276.00	0.36
69	002422	科伦药业	8,600	167,184.00	0.36
70	601390	中国中铁	31,300	164,951.00	0.35
71	600383	金地集团	11,600	156,600.00	0.33
72	300413	芒果超媒	2,100	152,250.00	0.32
73	300122	智飞生物	1,000	147,910.00	0.31
74	000783	长江证券	16,900	141,960.00	0.30
75	603833	欧派家居	900	121,050.00	0.26
76	002304	洋河股份	500	117,995.00	0.25
77	601238	广汽集团	8,400	111,636.00	0.24
78	601216	君正集团	21,400	105,930.00	0.23
79	601155	新城控股	2,800	97,524.00	0.21
80	600690	海尔智家	3,000	87,630.00	0.19
81	600299	安迪苏	6,800	78,268.00	0.17
82	600585	海螺水泥	1,500	77,430.00	0.16
83	601668	中国建筑	15,300	76,041.00	0.16
84	600886	国投电力	6,800	58,752.00	0.12
85	600705	中航资本	12,500	54,750.00	0.12
86	601985	中国核电	10,500	51,660.00	0.11
87	002202	金风科技	3,600	51,300.00	0.11
88	600085	同仁堂	2,100	50,190.00	0.11
89	600332	白云山	1,700	49,725.00	0.11
90	600177	雅戈尔	6,400	46,016.00	0.10
91	600489	中金黄金	5,200	45,812.00	0.10
92	601169	北京银行	9,400	45,496.00	0.10
93	601336	新华保险	600	34,782.00	0.07
94	300529	健帆生物	300	20,346.00	0.04

95	000625	长安汽车	800	17,504.00	0.04
96	601857	中国石油	4,200	17,430.00	0.04
97	600487	亨通光电	300	4,197.00	0.01

### 8.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002726	龙大肉食	65,100	833,280.00	1.77
2	300723	一品红	9,900	397,782.00	0.85
3	000999	华润三九	13,100	326,714.00	0.69
4	601997	贵阳银行	40,700	323,565.00	0.69
5	300639	凯普生物	6,600	248,028.00	0.53
6	002382	蓝帆医疗	8,200	172,938.00	0.37
7	300502	新易盛	700	38,836.00	0.08
8	300394	天孚通信	700	37,331.00	0.08
9	601222	林洋能源	1,800	14,256.00	0.03
10	003029	吉大正元	513	13,409.82	0.03
11	003028	振邦智能	320	13,340.80	0.03
12	605155	西大门	350	10,668.00	0.02
13	605179	一鸣食品	469	8,282.54	0.02
14	605277	新亚电子	316	5,356.20	0.01
15	003030	祖名股份	336	5,100.48	0.01
16	003031	中瓷电子	285	4,351.95	0.01

## 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	601166	兴业银行	14,789,678.54	11.41
2	000858	五粮液	10,431,320.38	8.05
3	601318	中国平安	10,094,384.00	7.79
4	600519	贵州茅台	8,936,933.68	6.89
5	002475	立讯精密	8,914,210.86	6.88
6	000333	美的集团	8,718,812.80	6.72
7	601997	贵阳银行	7,892,901.01	6.09
8	601288	农业银行	7,593,141.00	5.86
9	600276	恒瑞医药	7,380,501.00	5.69
10	601398	工商银行	6,992,381.00	5.39
11	601816	京沪高铁	6,319,848.88	4.87
12	600048	保利地产	6,239,237.00	4.81
13	600000	浦发银行	6,042,587.00	4.66
14	600031	三一重工	5,855,329.62	4.52
15	600030	中信证券	5,715,428.00	4.41
16	300059	东方财富	5,413,622.62	4.18
17	601899	紫金矿业	5,246,492.00	4.05
18	600016	民生银行	5,220,293.00	4.03
19	601601	中国太保	4,996,337.00	3.85
20	002415	海康威视	4,806,372.00	3.71
21	600837	海通证券	4,747,566.00	3.66
22	600919	江苏银行	4,628,444.80	3.57
23	601211	国泰君安	4,520,413.91	3.49
24	000776	广发证券	4,426,203.00	3.41
25	600104	上汽集团	4,314,843.36	3.33
26	000661	长春高新	4,098,758.00	3.16
27	000568	泸州老窖	3,900,450.00	3.01

28	000157	中联重科	3,716,571.00	2.87
29	601688	华泰证券	3,705,603.18	2.86
30	000002	万科 A	3,627,214.00	2.80
31	601668	中国建筑	3,509,464.00	2.71
32	002714	牧原股份	3,473,760.40	2.68
33	600887	伊利股份	3,427,177.00	2.64
34	601390	中国中铁	3,256,828.75	2.51
35	002726	龙大肉食	3,245,202.00	2.50
36	600690	海尔智家	3,201,378.33	2.47
37	600015	华夏银行	3,159,564.55	2.44
38	601009	南京银行	3,068,779.34	2.37
39	601818	光大银行	3,060,805.90	2.36
40	300498	温氏股份	2,998,731.00	2.31
41	000100	TCL 科技	2,976,918.00	2.30
42	601012	隆基股份	2,932,461.00	2.26
43	000895	双汇发展	2,909,544.00	2.24
44	603288	海天味业	2,876,097.00	2.22
45	600809	山西汾酒	2,875,548.50	2.22
46	002352	顺丰控股	2,868,861.00	2.21
47	601628	中国人寿	2,863,929.12	2.21
48	002555	三七互娱	2,818,120.16	2.17
49	600741	华域汽车	2,755,246.00	2.13
50	600011	华能国际	2,711,074.26	2.09

#### 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	000858	五粮液	17,109,683.79	13.20
2	601166	兴业银行	15,602,642.64	12.03
3	600276	恒瑞医药	15,362,586.52	11.85
4	601318	中国平安	14,901,412.54	11.49
5	600519	贵州茅台	13,686,369.70	10.56
6	000333	美的集团	13,292,149.97	10.25
7	600030	中信证券	11,275,724.00	8.70
8	002475	立讯精密	10,825,228.64	8.35
9	601288	农业银行	10,031,422.00	7.74
10	601398	工商银行	8,750,919.00	6.75
11	002415	海康威视	8,592,191.00	6.63
12	600000	浦发银行	8,299,782.01	6.40
13	601816	京沪高铁	8,288,499.69	6.39
14	600919	江苏银行	7,526,320.93	5.80
15	601997	贵阳银行	7,372,839.79	5.69
16	600048	保利地产	6,926,586.68	5.34
17	600016	民生银行	5,986,572.00	4.62
18	600031	三一重工	5,862,481.36	4.52
19	601012	隆基股份	5,846,898.00	4.51
20	600837	海通证券	5,527,059.00	4.26
21	601688	华泰证券	5,496,961.12	4.24
22	300498	温氏股份	5,231,440.72	4.03
23	000002	万科 A	5,137,149.40	3.96
24	300059	东方财富	4,740,665.60	3.66
25	601601	中国太保	4,728,550.00	3.65
26	600104	上汽集团	4,702,344.66	3.63
27	601899	紫金矿业	4,642,142.47	3.58
28	601628	中国人寿	4,408,531.00	3.40



29	601390	中国中铁	4,149,099.00	3.20
30	000568	泸州老窖	4,056,460.42	3.13
31	000776	广发证券	3,895,313.00	3.00
32	000661	长春高新	3,869,375.00	2.98
33	601211	国泰君安	3,758,687.99	2.90
34	000157	中联重科	3,731,533.60	2.88
35	601818	光大银行	3,597,694.00	2.77
36	601006	大秦铁路	3,525,164.00	2.72
37	600585	海螺水泥	3,490,307.90	2.69
38	601668	中国建筑	3,334,743.00	2.57
39	601009	南京银行	3,304,262.00	2.55
40	000100	TCL 科技	3,181,975.00	2.45
41	002555	三七互娱	3,138,481.62	2.42
42	601186	中国铁建	3,067,381.00	2.37
43	600741	华域汽车	3,050,234.00	2.35
44	600690	海尔智家	2,910,137.00	2.24
45	600015	华夏银行	2,866,641.35	2.21
46	603288	海天味业	2,860,963.90	2.21
47	002726	龙大肉食	2,795,404.00	2.16
48	603160	汇顶科技	2,786,502.00	2.15
49	601229	上海银行	2,775,312.60	2.14
50	300433	蓝思科技	2,760,042.00	2.13
51	600011	华能国际	2,618,739.17	2.02

### 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	458,430,155.53
卖出股票收入（成交）总额	544,430,709.32

**8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	2,768,925.00	5.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	199,920.00	0.42
	其中：政策性金融债	199,920.00	0.42
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	2,968,845.00	6.31

**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	010107	21 国债(7)	16,000	1,619,040.00	3.44
2	019627	20 国债 01	11,500	1,149,885.00	2.44
3	018013	国开 2004	2,000	199,920.00	0.42

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

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****8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					0.00
股指期货投资本期收益（元）					44,280.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					0.00

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

**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**

无。

**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**

无。

**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	21,574.94

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	57,582.04
5	应收申购款	12,047.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	91,204.64

#### 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

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份 额比例
沪 深 300 增 强 A	384	44,525.74	14,545,538.21	85.07%	2,552,346.35	14.93%
沪 深 300 增 强 C	312	41,903.06	5,000,400.00	38.25%	8,073,355.56	61.75%
合计	669	45,099.61	19,545,938.21	64.78%	10,625,701.91	35.22%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	沪深 300 增强 A	369.20	0.0000%
	沪深 300 增强 C	210.14	0.0000%
	合计	579.34	0.0000%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持 有本开放式基金	沪深 300 增强 A	0~10
	沪深 300 增强 C	0
	合计	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	沪深 300 增强 A	0
	沪深 300 增强 C	0
	合计	0

#### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	19,545,938.21	64.78	10,000,800.08	78.38	36 个月
基金管理人高级管理人员	99.27	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	19,546,037.48	64.78	10,000,800.08	78.38	36 个月

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	沪深 300 增强 A	沪深 300 增强 C
基金合同生效日（2019 年 2 月 25 日）基金份额总额	6,836,918.08	5,923,030.54
本报告期期初基金份额总额	25,575,450.19	88,366,125.69
本报告期基金总申购份额	16,499,695.04	80,072,835.60
减:本报告期基金总赎回份额	24,977,260.67	155,365,205.73
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	17,097,884.56	13,073,755.56

## § 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

2020 年 9 月 18 日，公司第二届董事会第十三次会议决议，同意张键先生辞去公司董事长职务，同时选举阮菲女士为公司新董事长。2020 年 10 月 09 日，公司在《证券时报》上刊登《红土创新基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

2020 年 10 月 30 日，公司第二届董事会第十四次会议通过决议，同意高峰同志辞去总经理职务，同时由公司董事长阮菲女士代为行使总经理职责。2020 年 11 月 4 日，公司发布了《红土创新基金管理有限公司关于总经理离职及董事长代为履行职务的公告》。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

自 2020 年 8 月 28 日起，刘波先生担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 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。

### 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

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	



东方证券	2	591,281,762.76	60.04%	195,950.12	55.51%	-
银河证券	2	347,934,004.88	35.33%	142,829.34	40.46%	-
中银国际	1	45,644,922.29	4.63%	14,206.15	4.02%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	6,888,518.00	28.50%	35,100,000.00	66.73%	-	-
银河证券	17,279,568.64	71.50%	17,500,000.00	33.27%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	关于红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金限制大额申购业务的公告	证券时报、公司网站	2020 年 1 月 11 日
2	红土创新基金管理有限公司关于董事长变更的公告	证券时报、公司网站	2020 年 1 月 18 日
3	红土创新基金管理有限公司关于使用自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	证券时报、公司网站	2020 年 3 月 19 日
4	红土创新沪深 300 指数增强发起式证券投资基金取消大额申购限制的公告	证券时报、公司网站	2020 年 3 月 24 日
5	红土创新基金管理有限公司关于旗下基金新增汇林保大为销售机构的公告	证券时报、公司网站	2020 年 3 月 25 日
6	红土创新基金管理有限公司关于旗下基金新增海银基金为销售机构的公告	证券时报、公司网站	2020 年 6 月 12 日
7	红土创新基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、公司网站	2020 年 8 月 28 日
8	红土创新基金管理有限公司关于设立子公司的公告	证券时报、公司网站	2020 年 9 月 8 日
9	红土创新基金管理有限公司关于董事长变更的公告	证券时报、公司网站	2020 年 10 月 1 日
10	红土创新基金管理有限公司关于总经理离职及董事长代为履行职务的公告	证券时报、公司网站	2020 年 11 月 4 日
11	红土创新基金管理有限公司	证券时报、公司网站	2020 年 12 月 22 日

	关于高级管理人员变更的公告		
--	---------------	--	--

## § 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	20200320-20201231	10,000,800.08	9,545,138.13	-	19,545,938.21	64.78%
个人	-	20200430-20200608	9,366,424.65	0.00	9,366,424.65	0.00	0.00%
	1	20200609-20200824	0.00	12,256,084.20	8,000,000.00	4,256,084.20	14.11%
产品	1	20200101-20200106	29,250,574.78	0.00	29,250,574.78	0.00	0.00%
	2	20200101-20200326	38,312,656.83	9,256,624.89	47,569,281.72	0.00	0.00%

#### 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. 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；

3. 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

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金设立的文件
- (2) 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
- (3) 红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议
- (4) 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
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (6) 报告期内红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原

稿

### 13.2 存放地点

深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 楼

### 13.3 查阅方式

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