南华瑞盈混合型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:南华基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月26日

§1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金基合同规定,于2018年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	南华瑞盈混合发起
基金主代码	004845
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年06月16日
报告期末基金份额总额	24,456,025.93份
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,以自上而下与自下而上相结合的方法,对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中债综合全价(总值)指数收益率×30%
风险收益特征	本基金属于混合基金,风险水平和预期收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。
基金管理人	南华基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	南华瑞盈混合发起A / 南华瑞盈混合发起C
下属分级基金的交易代码	004845 / 004846
报告期末下属分级基金的份额总额	21,311,959.41份 / 3,144,066.52份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年07月01日 - 2018年09月30日)	
	南华瑞盈混合发起A	南华瑞盈混合发起C
1.本期已实现收益	-3,192,807.75	-467,867.45
2.本期利润	-2,732,439.22	-406,387.33
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1271	-0.1292
4.期末基金资产净值	14,279,862.67	2,091,032.15
5.期末基金份额净值	0.6700	0.6651

注:

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

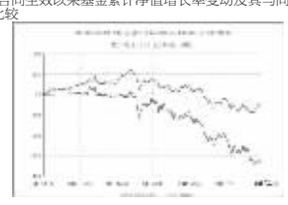
南华瑞盈混合发起A净值表现

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
过去三个月	-15.99%	1.69%	-1.15%	0.95%	-14.84%	0.74%

南华瑞盈混合发起C净值表现

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
过去三个月	-16.11%	1.69%	-1.15%	0.95%	-14.96%	0.74%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:本基金建仓期为2017年8月16日至2018年2月15日,截至本报告期末,本基金已完成建仓,但建仓期结束尚不满1年;建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合基金合同的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘斐	本基金基金经理	2017-08-16	-	9年	硕士研究生,具有基金从业资格。2008年至2009年,任职于天相投资顾问有限公司,担任研究员。2009年至2012年,任职于国都证券有限责任公司,担任研究员。2012年至2013年,任职于长城证券股份有限公司,担任研究员。2013年至2015年,任职于东兴证券股份有限公司,担任研究员。2015年至2017年,任职于弘德基金管理有限公司,担任研究员。2017年3月加入南华基金管理有限公司,现任南华瑞盈混合型发起式证券投资基金基金经理、南华瑞顺混合型证券投资基金基金经理(2017年12月26日起任职)、南华丰淳混合型证券投资基金基金经理(2017年12月26日起任职)。
刘深	本基金基金经理	2017-12-26	-	9年	硕士研究生,具有基金从业资格。2008年至2011年任东海证券有限责任公司研究员,2011年至2016年任长城证券股份有限公司资深研究员,TMT行业组组长,对于成长股具备丰富的研究经验。2016年12月加入南华基金管理有限公司,现任南华瑞盈混合型发起式证券投资基金基金经理。

注:(1)基金经理刘斐的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理刘深的任职日期是指公司作出决定后公告之日;(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》等有关法律法规、中国证监会和《南华瑞盈混合型发起式证券投资基金基金合同》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,为基金份额持有人谋求最大利益。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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《南华基金管理有限公司公平交易管理细则》的规定,通过系统和人工等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。

在投资决策内部控制方面,本基金管理人确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会。健全投资授权制度,明确各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的管理及保密制度,通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式,使不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行控制方面,本基金管理人实行集中交易制度,交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先,价格优先的原则严格执行所有指令,确保公平对待各投资组合。对于一级市场申购等场外交易,按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制及监控制度,报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

今年7月-9月,市场受到中美贸易战持续升级的影响,大盘在2600点至2900点之间震荡下行,风险偏好大幅降低,对此我们采取中性的仓位策略,根据市场涨跌灵活调整仓位,低买高卖。在具体行业选择上,规避受贸易战影响大的、受医疗改革影响大的行业,主要集中在金融、计算机等行业景气度较好,受内外部影响较小的行业上。

虽然对2018年第三季度市场进行提前预判与调整,但市场对于中国经济持续悲观仍在影响股票市场行情,个股跌幅大于指数跌幅,本只基金未能取得较好绝对、相对收益,后续将根据市场情况调整投资策略以应对当前复杂的经济形势。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末南华瑞盈混合发起A基金份额净值为0.6700元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-15.99%,同期业绩比较基准收益率为-1.15%;截至报告期末南华瑞盈混合发起C基金份额净值为0.6651元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-16.11%,同期业绩比较基准收益率为-1.15%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 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	14,409,318.52	79.10
	其中:股票	14,409,318.52	79.10
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	2,827,267.83	15.52
8	其他资产	979,098.64	5.38
9	合计	18,215,684.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	7,352,180.52	44.91
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	48,300.00	0.30
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	3,890,598.00	23.77
J	金融业	2,450,740.00	14.97
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	667,500.00	4.08
S	综合	-	-
	合计	14,409,318.52	88.02

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

5.3 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	002368	太极股份	27,300	835,653.00	5.10
2	002371	北方华创	17,642	830,232.52	5.07
3	000063	中兴通讯	44,500	814,350.00	4.97
4	603799	华友钴业	14,000	746,060.00	4.56
5	002912	中新赛克	7,800	727,428.00	4.44
6	601318	中国平安	10,000	685,000.00	4.18
7	300144	宋城演艺	30,000	667,500.00	4.08
8	601288	农业银行	150,000	583,500.00	3.56
9	002008	大族激光	13,000	550,810.00	3.36
10	601398	工商银行	90,000	519,300.00	3.17

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末,本基金未持有债券。

5.5 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

报告期末,本基金未持有债券。

5.6 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

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

5.7 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

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

5.8 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

报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	38,292.99
2	应收证券清算款	939,763.78
3	应收股利	-
4	应收利息	941.87
5	应收申购款	100.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	979,098.64

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	南华瑞盈混合发起A	南华瑞盈混合发起C
报告期期初基金份额总额	21,719,388.60	3,225,815.76
报告期期间基金总申购份额	1,395.01	213,700.50
减:报告期期间基金总赎回份额	408,824.20	295,449.74
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	21,311,959.41	3,144,066.52

注:总申购份额含转换转入份额;总赎回份额含转换转出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

	南华瑞盈混合发起A	南华瑞盈混合发起C
报告期期初基金份额总额	10,003,950.00	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,003,950.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	46.94	-

§8 报告期末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	10,003,950.00	40.91%	10,003,950.00	40.91%	3年
基金管理人高级管理人员	152,118.38	0.62%	-	-	-
基金经理等人员	51,005.88	0.21%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,207,074.26	41.74%	10,003,950.00	40.91%	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	2018/7/1-2018/9/30	10,003,950.00	-	-		10,003,950.00	40.91%
产品特有风险								

基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则,公平对待投资者、保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%时,由此可能导致的特有风险主要包括:

(1)超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险;

(2)极端市场环境下投资者集中赎回,基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险;

(3)持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险;

(4)持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时,可能拥有较大话语权;

(5)极端情况下,持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后,可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

(1)中国证监会准予南华瑞盈混合型发起式证券投资基金注册的批复文件;

(2)《南华瑞盈混合型发起式证券投资基金基金合同》;

(3)《南华瑞盈混合型发起式证券投资基金招募说明书》;

(4)《南华瑞盈混合型发起式证券投资基金托管协议》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内南华瑞盈混合型发起式证券投资基金在指定报刊披露的各项公告原稿。

10.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街甲3号居然大厦3层南华基金管理有限公司

10.3 查阅方式

(1)书面查询:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查询,也可按工本费购买复印件。

(2)网站查询:基金管理人网址www.nanhuafunds.com

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人南华基金管理有限公司,咨询电话400-810-5599。

南华基金管理有限公司
2018年10月26日

红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:红土创新基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月26日

§1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	红土创新改革红利混合
交易代码	002250
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年1月26日
报告期末基金份额总额	27,242,910.87份
投资目标	我国全面深化改革将对经济和资本市场产生深远影响,改革红利的释放有望带来超额投资收益。本基金主要投资受益于全面深化改革的行业股票,包括受益于国企制度改革、资源要素价格改革、人口制度、户籍制度、土地制度、医药卫生体制、生态文明制度、国防等领域改革的相关行业上市公司,追求超越业绩比较基准的长期回报。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势等因素对各个行业及上市公司的影响以及核心股票资产的估值水平,综合分析证券市场的走势,主动判断市场时机,通过稳健的资产配置,合理确定基金资产在股票、债券等各类资产类别上的投资比例,以最大限度地降低投资组合的风险,提高收益。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金是灵活配置混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中高收益风险特征的基金。
基金管理人	红土创新基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-697,224.59
2.本期利润	-707,484.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0288
4.期末基金资产净值	21,683,917.81
5.期末基金份额净值	0.796

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

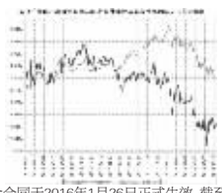
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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
过去三个月	-3.28%	2.01%	-0.97%	0.81%	-2.31%	1.20%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:1、本基金基金合同于2016年1月26日正式生效,截至报告期末已满一年;

2、按照本基金的基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,截至报告期末本基金已完成建仓,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁冬冬	基金经理	2018年3月13日	-	10	10年证券行业投研经验,吉林大学理学硕士。曾在江海证券、华宝兴业基金、鹏华基金从事医药行业研究、投资工作,2014年9月担任鹏华医疗保健股票型证券投资基金基金经理,2015年6月担任鹏华医药科技股票型证券投资基金基金经理。现担任红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。
侯世藏	基金经理	2017年9月5日	-	8	兰州大学MBA。历任平安证券有限责任公司新能源汽车行业研究员;日信证券有限责任公司化工行业首席分析师、证券投资部投资经理、投资部总经理助理、公司投资决策委员会委员。现任红土创新新兴产业混合证券投资基金、红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。
丁硕	基金经理	2016年1月26日	2017年12月29日	12	清华大学工商管理硕士。先后在招商证券股份有限公司、兴证投资公司工作;历任阳光保险集团交易主管、研究员、投资经理,东莞证券资产管理分公司权益投资负责人、投资经理。曾担任红土创新改革红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、红土定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《红土创新增强收益债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本基金为发起式基金,自本基金合同生效之日起至报告期末本基金合同生效未满三年,根据《公开募集证券投资基金动作管理办法》规定,基金管理人不对本基金持有人数及基金资产净值进行监控。

§5 投资组合报告

5.1 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	20,345,644.50	84.18
	其中:股票	20,345,644.50	84.18
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	3,005,741.57	12.44
8	其他资产	817,695.66	3.38
9	合计	24,169,081.73	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	17,308,496.50	79.82
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	2,038,420.00	9.40
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	998,738.00	4.61
J	金融业	-	-
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	20,345,644.50	93.83

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末无沪港通投资。

5.3 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	002422	科伦药业	47,000	1,253,490.00	5.78
2	002024	苏宁云商	81,500	1,098,620.00	5.07
3	000063	中兴通讯	57,300	1,048,590.00	4.84
4	000729	燕京啤酒	156,300	1,030,017.00	4.75
5	600760	中航沈飞	26,500	1,009,650.00	4.66
6	300122	智飞生物	20,500	1,003,680.00	4.63
7	600588	用友网络	35,900	998,738.00	4.61
8	002383	合众思壮	67,700	985,035.00	4.54
9	600271	航天信息	35,200	979,616.00	4.52
10	600967	内蒙一机	69,400	960,496.00	4.43

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末无债券投资。

5.5 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

注:本基金本报告期末无债券投资。

5.6 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

注:本基金本报告期末无资产支持证券投资。

5.7 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

注:本基金本报告期末无贵金属投资。

5.8 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

注:本基金本报告期末无权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.1 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	54,115.06
2	应收证券清算款	689,389.76
3	应收股利	-
4	应收利息	269.43
5	应收申购款	73,921.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	817,695.66

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	21,464,636.13
报告期期间基金总申购份额	12,635,839.98
减:报告期期间基金总赎回份额	6,857,565.24
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	27,242,910.87

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初基金份额总额	10,004,400.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,004,400.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	36.72

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金无交易。

§8 报告期末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	10,004,400.00	36.72	10,004,400.00	36.72	至基金合同生效之日起不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,004,400.00	36.72	-	36.72	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	20180701-20180930	10,004,400.00	-	-		10,004,400.00	36.72%
个人	-	-	-	-	-		-	-
产品特有风险								

1.巨额赎回风险

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

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

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

3.流动性风险

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

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

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准红土创新增强收益债券型证券投资基金设立的文件

(2)红土创新增强收益债券型证券投资基金基金合同

(3)红土创新增强收益债券型证券投资基金托管协议

(4)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(5) 报告期内红土创新增强收益债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

(1)投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

(2)投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人红土创新基金管理有限公司,客户服务电话:4000603333(免长途话费)

红土创新增强收益债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:红土创新基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月26日

§1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	红土创新增强收益债券
交易代码	006061
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年07月25日
报告期末基金份额总额	144,677,313.82份
投资目标	本基金主要投资于债券资产,通过精选信用债券,并适度参与权益类品种投资以增强基金获利能力,提高基金收益水平。在承担合理风险和保持资产流动性的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金所定义的收益增强品指在债券配置基础上,进行适当的权益类品种投资以增强基金获利能力,提高基金收益水平。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*10%+中证全债指数收益率*90%。
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风