红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

基金管理人:红塔红土基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
送出日期:2015年8月28日

§1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载,误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本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。
基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8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2015年1月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	红塔红土盛世普益混合发起式
场内简称	--
基金主代码	000743
前端交易代码	--
后端交易代码	--
基金运作方式	契约型,开放式,发起式
基金合同生效日	2014年9月18日
基金管理人	红塔红土基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,034,648,014.71份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	--
上市日期	--

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金利用数量化模型与定性分析相结合的方法,通过股票资产和债券资产等各类资产的灵活配置,在有效控制投资组合风险的前提下,力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金投资策略包括大类资产配置策略、股票资产投资策略、债券及其它金融工具投资策略几个部分。基金管理人在综合考虑经济周期、市场环境、政策预期的基础上,通过大盘趋势预期模型(MTPM)判断当前市场所处时点,配合以择量Alpha-对冲模型(SAHM)进行大类资产的配置,在股票投资方面,主要依据“股票价格波动-能级波动模型”,并配合以个股的基本面研究,确定当前的行业与个股配置。债券及其它金融工具投资策略上,则采用市场常用的组合平均久期管理等策略。整体来说,本基金采取“量化分析为主,定性分析为辅”的策略,有效控制组合风险,充分挖掘市场机会。
业绩比较基准	沪深300指数×56%+中债总指数(财富)×45%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种,本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金,债券型基金,低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		红塔红土基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李梁	张淑
	联系电话	0755-33379909	0755-22168073
	电子邮箱	liliang@htjamc.com.cn	ZHANGSHU749@pingan.com.cn
客户服务电话		4001-666-916(免长途话费)	95511-3
传真		0755-33379007	0755-82080400-0

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.htjamc.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

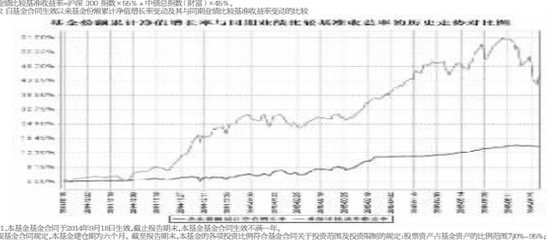
金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日-2015年6月30日)
本期已实现收益	43,759,015.66
本期利润	76,183,193.15
加权平均基金份额本期利润	0.0662
本期基金份额净值增长率	12.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0787
期末基金资产净值	4,639,930,561.54
期末基金份额净值	1.150

注:1.表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,计入费用的记入时间按相关业务规则或合同规定。
2.本期已实现收益是指基金本期利润扣减本期公允价值变动收益后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.本基金基金合同生效日为2014年9月18日,截止报告期末,本基金基金合同生效不满一年。
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的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.88%	0.12%	-3.82%	1.92%	4.70%	-1.80%
过去三个月	4.07%	0.10%	7.23%	1.44%	-3.16%	-1.34%
过去六个月	12.30%	0.31%	16.05%	1.24%	-3.75%	-0.93%
自基金合同生效起至今	15.00%	0.31%	46.58%	1.12%	-31.58%	-0.81%

注:1.本基金基金合同于2014年9月18日生效,截止报告期末,本基金基金合同生效不满一年。
2.业绩比较基准收益率=沪深300指数×56%+中债总指数(财富)×45%。
3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其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2014年9月18日生效,截止报告期末,本基金基金合同生效不满一年。
2.按基金合同规定,本基金建仓期为六个月,截至报告期末,本基金基金合同规定上所持有基金合同规定上限的股票、债券、基金和现金等资产比例,均在建仓期内。
3.本基金投资于债券的比例不低于70%,基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,基金保留的现金,或到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的5%。

§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
本基金管理人为红塔红土基金管理有限公司(简称“公司”),经中国证监会批准,于2012年6月12日在深圳市海正达注册成立,注册资本2亿元人民币,其中,红塔证券股份有限公司出资比例为60%,深圳市创新投资集团有限公司出资比例为28%,北京市华远集团有限公司出资比例为12%。公司业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理及中国证监会许可的其他业务。
作为一家为客户提供专业投资服务的资产管理机构,公司将坚持价值投资理念,以专业服务创造社会、建立并不断完善投研一体化平台,坚持把基金持有人利益放在首位,努力实现基金持有人资产增值。同时,鉴于投资的风险收益特征,建立起一套全面完善的风险控制体系,以风险管理为基础,合法合规运作为前提,将风险控制贯穿于每个投资运作的全过程,进而实现专业机构投资、最大化2015年6月30日,公司管理20只证券投资基金,具体为从2014年9月18日起管理红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金,从2014年6月16日起管理红塔红土金金新动力灵活配置混合型证券投资基金。
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		
赵耀	基金经理	2015年5月6日	-	9	香港中文大学金融财务工商管理硕士,厦门大学经济学学士,CFA(英国注册金融分析师),在3年证券、基金工作经历,历任家安基金交易员,中国国际金融有限公司交易员,具有丰富的大资金证券交易经验,现任基金经理助理。
李雷	-	2014年9月18日	2015年5月21日	15	比立勤国立大学工商管理博士、同济大学工商管理硕士,复旦大学物理学学士,历任证券基金从业资格,历任东北证券行业分析师经理,东方基金公司研究部经理,基金经理助理,研究部经理,基金经理兼金融工程部经理,华富基金产品设计经理,华富策略精选基金经理,华融证券固收基金经理,金融工程负责人;现任新千纪红土基金管理有限公司投资总监,公司投资决策委员会委员。

注:1.证券从业年限的计算标准: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》的规定;
2.本基金的任基金经理的任职日期为本基金合同生效日,离任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告(生效)日期。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
报告期内,本基金管理人管理运作遵规守信,未损害投资者利益。
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》等有关法律法规,以及《红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》、招募说明书等有关基金法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内,本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规及基金合同等规定,未从事内幕交易、操纵市场等违法、违规行为,未开展利用下属投资顾问业务、投资咨询业务、证券经纪业务、证券承销业务等业务开展利益输送行为。
报告期内,基金管理人管理的各投资组合的整体收益率、分投资类别(股票、债券)的收益率以及不同时间窗内(同日内、3日内、5日内)同向交易的交易价格未发现异常差异。各投资组合间不存在违背公平交易原则的行为。

§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
本报告期内,平安银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规,基金合同规定的各项投资原则和约定的各项投资比例,在基金投资方面,所开设的各个证券账户、期货账户、银行间债券账户、银行间外汇交易账户均按照有关法律法规及基金合同的规定,独立开设、独立核算,确保基金资产的安全、独立运作。
报告期内,本基金管理人管理的各投资组合的整体收益率、分投资类别(股票、债券)的收益率以及不同时间窗内(同日内、3日内、5日内)同向交易的交易价格未发现异常差异。各投资组合间不存在违背公平交易原则的行为。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表
会计主体:红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金
报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	1,506,269,375.92	17,600,614.80
结算备付金		2,537,828.48	1,380,660.60
存出保证金		140,943.62	38,152.60
交易性金融资产	6.4.7.2	572,894,496.03	20,697,301.88
其中:股票投资		103,756,594.03	13,026,083.34
基金投资		--	--
债券投资		469,138,102.00	7,671,218.54
资产支持证券投资		--	--
贵金属投资		--	--
衍生金融资产	6.4.7.3	--	--
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,651,207,221.80	21,000,000.00
应收证券清算款		990,144.42	--
应收利息	6.4.7.5	9,724,515.44	1,496,164.84
应收股利		--	--
应收申购款		99.21	--
递延所得税资产		--	--
其他资产	6.4.7.6	--	--
资产总计		4,644,524,822.00	112,616,994.20

负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负债:			
短期借款		--	--
交易性金融负债		--	--
衍生金融负债	6.4.7.3	--	--
卖出回购金融资产款		139,308.00	14,983,000.00
应付证券清算款		241,006.00	680,971.14
应付管理人报酬		3,196,404.22	100,008.26
应付托管费		888,788.02	27,802.40
应付销售服务费		--	--
应付交易费用	6.4.7.7	169,006.44	80,512.04
应交税费		--	--
应付利息		--	--
应付利润		--	--
递延所得税负债		--	--
其他负债	6.4.7.8	300,320.55	25,372.50
负债合计		4,934,827.18	16,417,666.34
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	4,034,648,014.71	94,368,024.27
未分配利润	6.4.7.10	605,942,980.11	2,814,634.48
所有者权益合计		4,639,590,994.82	96,182,658.75
负债和所有者权益总计		4,644,524,822.00	112,616,994.20

6.2 利润表
会计主体:红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入		88,894,328.32	
1.利息收入		18,898,488.20	
其中:存款利息收入	6.4.7.11	3,308,497.86	
债券利息收入		2,894,628.14	
资产支持证券利息收入		--	
买入返售金融资产收入		9,693,334.00	
其他利息收入		--	
2.投资收益(损失以“-”填列)		-49,832,433.04	
其中:股票投资收益	6.4.7.12	40,148,726.27	
基金投资收益		--	
债券投资收益	6.4.7.13	3,381,796.83	
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	--	
贵金属投资收益	6.4.7.14	--	
衍生工具收益	6.4.7.15	--	
股利收益	6.4.7.16	284,903.79	
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	32,494,177.49	
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		--	
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	89,368.02	
减:二、费用		9,969,135.17	
1、管理人报酬	6.4.9.2.1	7,514,728.61	
2、托管费	6.4.9.2.2	1,888,447.74	
3、销售服务费	6.4.9.2.3	--	
4、交易费用	6.4.7.19	336,889.63	
5、利息支出		192,973.80	
其中:卖出回购金融资产支出		192,973.80	
6、其他费用	6.4.7.20	136,095.39	
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		78,925,193.15	
减:所得税费用		--	
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		78,925,193.15	

注:本基金合同于2014年9月18日生效,本基金本期财务报表的实际编制期间系1月1日至6月30日止,因此,无对比期间财务报表数据。
6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金
本报告期:2015年1月1日 至 2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30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)	94,354,024.27	2,364,634.48	96,718,658.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期净利润)	--	76,183,193.15	76,183,193.15
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)	3,940,293,990.44	526,834,793.20	4,467,128,783.64
其中:1.基金申购款	3,992,846,812.60	529,610,284.38	4,522,457,096.98
2.基金赎回款	-52,551,822.16	-2,775,491.18	-55,327,313.34
四、本期末所有者权益(基金净值)	4,034,648,014.71	606,382,620.83	4,639,030,635.54

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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)	--	--	--
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	--	--	--
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)	--	--	--
其中:1.基金申购款	--	--	--
2.基金赎回款	--	--	--
四、本期末所有者权益(基金净值)	--	--	--

注:本基金合同于2014年9月18日生效,本基金本期财务报表的实际编制期间系1月1日至6月30日止,因此,无对比期间财务报表数据。
报表附注为财务报表的组成部分。
本报告 61 至 63 财务报表由下列负责人签署:
公司负责人:胡建 主管会计工作负责人:许芳然 会计机构负责人:邓郝娟
6.4 报表附注
6.4.1 基金基本情况
红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证监会监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]668号《关于核准红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人红塔红土基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2014年9月18日正式生效,首次设立募集规模为140,004,680.20份基金份额,其中认购资金利息折合140,344.42份基金份额。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,托管人为平安银行股份有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司,注册登记人为红塔红土基金管理有限公司。基金托管人与平安银行股份有限公司,基金托管人与平安银行股份有限公司,注册登记人为红塔红土基金管理有限公司。
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以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法律允许中国证监会相关规定。
基金的投资组合比例为:投资资产占基金资产的比例范围为70%-95%,债券等固定收益资产占基金资产的比例不低于5%;基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;基金保留的现金,或到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的投资组合投资期为:沪深300指数×56%+中债总指数(财富)×45%。
本基金的报告期末于2015年06月26日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。
6.4.2 会计报表的编制基础
本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金信息披露的有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则1:招募说明书(不含发行申请)-初稿业务及份额申请(含有关事项的通知)》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则2:招募说明书(不含发行申请)-基金合同、托管协议及招募说明书》和《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号-年度报告和半年度报告》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。
本财务报表以本基金持续经营为基础列报。
6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
本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于2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015年6月30日止期间经营成果和净值变动情况。
6.4.4 重要会计政策和会计特计
本报告期本基金所采用的会计政策与最近一期年度报告保持一致,本报告期,本基金根据中国证券投资基金业协会中基协发[2014]24号关于发布《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度估计收益品种的估值处理标准》的通知的规定,对交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。除此之外,本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告保持一致。
6.4.4.1 会计年度
本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2015年1月1日至2015年6月30日止。
6.4.4.2 记账本位币
本基金记账本位币采用人民币,以人民币为单位列示。除特别说明外,均以人民币元为单位表示。
6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类
金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债)、用形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。
(1)金融资产分类

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
申购资金银行存款余额	--	--
减:现金支付申购款总额	--	--
减:申购资金赎回本息总额	--	--
申购差价收入	--	--

注:本基金本报告期内无资金赎回款项收益。
6.4.7.5 应收利息

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	29,526.95
应收定期存款利息	525,000.00
应收其他存款利息	--
应收结算备付金利息	1,583.00
应收债券利息	7,507,357.94
应收买入返售证券利息	1,660,984.15
应收申购款利息	--
应收黄金合约拆借孳息	--
其他	63.40
合计	9,724,515.44

注:其他为应收结算保证金利息。
6.4.7.6 其他资产

项目	本期末 2015年6月30日
其他应收款	--
待摊费用	--
合计	--

注:本基金于本期末无其他资产。
6.4.7.7 应付交易费用

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	137,694.21
银行间市场应付交易费用	31,311.23
合计	169,006.44

6.4.7.8 其他负债

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	--
应付赎回费	247.98
预提费用	198,972.33
合计	199,220.31

6.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	94,354,024.27	94,354,024.27
本期申购	3,972,846,812.60	3,972,846,812.60
本期赎回(以“-”号填列)	-52,551,822.16	-52,551,822.16
-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	4,034,648,014.71	4,034,648,014.71

注:1.申购含转换入份额,赎回含转换出份额。
2.本基金合同于2014年9月18日生效。
6.4.7.10 未分配利润

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,587,307.28	-322,672.80	2,264,634.48
本期利润	43,759,015.66	32,424,177.49	76,183,193.15
本期基金份额交易产生的变动数	271,291,269.72	255,543,439.48	526,834,709.20
其中:基金申购款	272,937,506.06	256,672,788.32	529,610,294.38
基金赎回款	-1,646,236.34	-1,129,348.84	-2,775,585.18
本期已分配利润	--	--	--
本期末	317,637,592.66	287,644,944.17	605,282,536.83

6.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	818,120.61
定期存款利息收入	--
其他存款利息收入	2,440,286.59
结算备付金利息收入	17,543.18
其他	44,624.87
合计	3,320,587.25

注:其他指6-1.结算保证金利息收入2.直接申购款利息收入。
6.4.7.12 股票投资收益
6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	111,484,628.06
减:卖出股票成本总额	71,338,902.79
买卖股票差价收入	40,145,725.27

6.4.7.13 债券投资收益
6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	1,381,764.93
债券投资收益——赎回差价收入	--
债券投资收益——申购差价收入	--
合计	1,381,764.93

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	92,461,866.31
减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	89,209,225.50
减:应收利息总额	1,870,875.88
买卖债券差价收入	1,381,764.93

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入
本报告期内无赎回差价收入。
6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
申购基金份额证价总额	--
减:现金支付申购款总额	--
减:申购债券成本总额	--
减:申购债券应收利息总额	--
申购差价收入	--

注:本基金本报告期内无债券投资收益申购差价收入。
6.4.7.14 资产支持证券投资收益

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	--
减:卖出资产支持证券成本总额	--
减:应收利息总额	--
资产支持证券投资收益	--

注:本基金本报告期末无资产支持证券投资收益。
6.4.7.15 贵金属投资收益
6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成
注:本基金本报告期内无贵金属投资收益。
6.4.7.15.2 贵金属投资卖出成交总额
注:本基金本报告期内无贵金属投资卖出成交总额。
6.4.7.15.3 贵金属投资卖出成本总额
注:本基金本报告期内无贵金属投资卖出成本总额。
6.4.7.15.4 贵金属投资应收交易费用总额
注:本基金本报告期内无贵金属投资应收交易费用总额。
6.4.7.16 股利收益

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	284,903.79
基金投资产生的股利收益	--
合计	284,903.79

6.4.7.17 公允价值变动收益

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	32,424,177.49
——股票投资	31,911,262.42
——债券投资	512,825.07
——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	--
合计	32,424,177.49

6.4.7.18 其他收入

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	49,308.62
合计	49,308.62

6.4.7.19 交易费用

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	333,712.13
银行间市场交易费用	3,177.50
合计	336,889.63

6.4.7.20 其他费用

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	24,796.19
信息披露费	99,177.14
账户维护费	7,500.00
合计	131,473.33

6.4.7.21 分配报告
截至本期末,本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务,因此,无需作披露的分部报告。
6.4.7.22 关联方关系
6.4.8.1 本报告期内无控股关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
本基金本报告期内没有控股关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。
6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
红塔红土基金管理有限公司(“红塔红土基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构、发起人
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	基金托管人、基金代销机构
红塔证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易
6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
红塔证券股份有限公司	61,255,903.56	28.24%	--	--

注:本基金合同于2014年9月18日生效,本两一年,因此,无对比期间数据。
债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
红塔证券股份有限公司	28,742,699.33	86.94%	--	--

注:本基金合同于2014年9月18日生效,本两一年,因此,无对比期间数据。
债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
红塔证券股份有限公司	92,000,000.00	2.96%	--	--

注:本基金合同于2014年9月18日生效,本两一年,因此,无对比期间数据。
6.4.8.2 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

注:本基金本报告期内未进行关联方交易单元进行权证交易。
6.4.8.3 应付关联方款项

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
红塔证券股份有限公司	56,329.29	28.45%	--	--

关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

注:本基金合同于2014年9月18日生效,本两一年,因此,无对比期间数据。
6.4.8.4 关联方报酬
6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,514,728.61	--
其中:支付销售机构的客户维护费	56,546.51	--

注:基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%年费率计提。计算方法如下:
H=E×1.20%/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
6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,565,567.74	--

注:基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.25%/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
6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
合计	--	
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	

注:本基金产品无销售服务费。
6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。
6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

单位:份

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
基金合同生效日(2014年9月18日)持有的基金份额	10,000,000.00	--
期初持有的基金份额	10,000,000.00	--
期间申购/买入总份额	26,929,084.38	--
期间因拆分变动份额	--	--
减:期间赎回/卖出总份额	--	--
期末持有的基金份额	36,929,084.38	--
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.92%	--

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金情况

单位:份

关联方名称	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国证券登记结算有限责任公司	--	0.00%	--	--
红塔证券股份有限公司	--	0.00%	--	--
中国证券登记结算有限责任公司	--	0.00%	--	--
红塔证券股份有限公司	38,063,879.62	0.92%	10,000,000.00	10.60%
红塔证券股份有限公司	54,062,020.62	1.38%	9,999,999.00	10.60%

6.4.8.5 报告期末持有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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	156,259,375.92	818,120.61	--	--

注:本基金本报告期内存放中国基金托管人平安