红塔红土长益定期开放债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:红塔红土基金管理有限公司
基金托管人:渤海银行股份有限公司
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。

基金托管人渤海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	红塔红土长益定期开放债券	
场内简称	–	
交易代码	002688	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年10月26日	
报告期末基金份额总额	146,686,687.23份	
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金主要通过投资于精选的优质债券和价值被明显低估的个股,经过严谨的利差分析、对利率曲线变动趋势的判断以及积极主动的投资管理,适时规划与调整组合目标久期和行业配置,力求实现基金资产的长期稳定增值,为投资者实现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、固定收益类资产投资策略、资产支持证券投资策略、股票投资策略、权证投资策略几个部分。	
业绩比较基准	中国债券总指数(财富)×90%+沪深300指数×10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于中等风险收益的产品。	
基金管理人	红塔红土基金管理有限公司	
基金托管人	渤海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	红塔红土长益定期开放债券A	红塔红土长益定期开放债券C
下属分级基金的场内简称	–	–
下属分级基金的交易代码	002688	002689
下属分级基金的前端交易代码	–	–
下属分级基金的后端交易代码	–	–
报告期末下属分级基金的份额总额	146,327,314.87份	359,372.36份
下属分级基金的风险收益特征	–	–

§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)	
	红塔红土长益定期开放债券A	红塔红土长益定期开放债券C
1. 本期已实现收益	1,661,690.98	4,202.97
2. 本期利润	2,731,281.59	6,966.25
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0190	0.0172
4. 期末基金资产净值	146,925,549.01	360,821.84
5. 期末基金份额净值	1.0041	1.0040

注:1、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。

2、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。

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

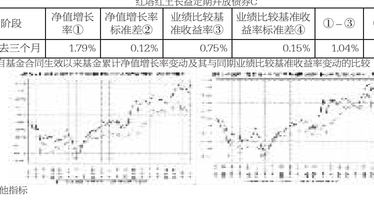
红塔红土长益定期开放债券A

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
过去三个月	1.90%	0.12%	0.75%	0.15%	1.15%	-0.03%

红塔红土长益定期开放债券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
过去三个月	1.79%	0.12%	0.75%	0.15%	1.04%	-0.03%

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



3.3 其他指标

注:无

§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		
罗薇	基金经理	2018年9月14日	–	6	澳洲新南威尔士大学会计学硕士,北京大学理学学士,2012年加入红塔红土基金研究部,现任职于公司投资部,为公司投资决策委员会委员。
梁钧	基金经理	2018年9月29日	–	18	上海交通大学博士,2000年7月参加工作。曾担任湘财证券研究所研究员、太平洋保险资金中心债券投资经理、泰达宏利基金管理有限公司固定收益部总经理和基金经理、上投摩根基金管理有限公司基金经理、上海原君投资公司总经理、太平资产管理有限公司债券投资经理。2018年5月起任职于红塔红土基金管理有限公司,现任固定收益部总经理、研究部总监、总经理助理。
罗薇	基金经理	2016年10月26日	2018年7月27日	6	澳洲新南威尔士大学会计学硕士,北京大学理学学士,2012年加入红塔红土基金研究部,现任职于公司投资部,为公司投资决策委员会委员。
胡文波	基金经理	2017年12月8日	2018年9月29日	10	北京大学金融专业硕士,加拿大多伦多大学金融学士。3年海外金融从业经历与7年国内金融研究投资经验。曾任职华泰证券研究所机构销售经理,金元证券资产管理部投资经理职务,具有较丰富的债券研究投资经验。2017年加入红塔红土基金研究部,现任职于公司投资部,为公司投资决策委员会委员。

注:1、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定等。

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,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》、《红塔红土长益定期开放债券型证券投资基金基金合同》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,未开展有损于基金份额持有人利益的关联交易,整体运作合法合规。

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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《红塔红土基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定,通过制度、流程和系统等在研究分析、投资决策、交易执行等各业务环节严格控制,公平对待旗下所有投资组合。

公司建立研究管理平台向所有投资部门人员开放,确保各投资组合公平获得研究资源,通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的分析评估,保证公平交易原则的实现。公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,重点投资的股票必须来源于核心股票库。在公司备选股票库的基础上,各投资组合应根据不同投资组合的投资目标、投资风格和投资范围,建立不同投资组合的备选股票库。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的逐级审批程序。针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易,由集中交易室通过投资交易系统中的公平交易程序,按照"价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡"的原则,对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对以公司名义开展的场外网下交易,严格按照价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。监察稽核部通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易的原则,定期针对旗下所有投资组合的交易记录,进行交易时机和价差的专项统计分析,以排查异常交易。

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了《红塔红土基金管理有限公司异常交易监控管理办法》,除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合外,同一投资组合禁止同日反向交易,不同投资组合之间严格限制同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易,需经严格审批并留痕备查。

报告期内,本基金与基金管理人管理的其他投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易中,成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%,本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度国内货币政策转向中性偏松,央行于7月5日定向降准,释放7000亿流动性;7月末中央政治局会议中提出坚持实施积极的财政政策和稳健的货币政策。三季度市场流动性整体保持充裕,债券市场行情出现分化,利率债受资金面推动呈现牛市行情,而市场对信用违约的担忧仍未解除,三季度信用违约事件仍维持高频,信用债市场仍相对较清淡。本基金在三季度内降低了信用债持仓比例,同时提高了利率债和可转债持仓;在货币市场回购利率较低的情况下,充分利用杠杆策略取得了利润增强,整体债券组合久期保持在3左右。股票方面,基金保持中性仓位,在反弹行情中适当参与。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末红塔红土长益定期开放债券A基金份额净值为1.0041元,本报告期基金份额净值增长率为1.90%;截至本报告期末红塔红土长益定期开放债券C基金份额净值为1.0040元,本报告期基金份额净值增长率为1.79%;同期业绩比较基准收益率为0.75%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§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	15,247,987.40	7.09
	其中:股票	15,247,987.40	7.09
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	193,725,007.61	90.09
	其中:债券	193,725,007.61	90.09
	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	1,998,355.99	0.93
8	其他资产	4,053,371.14	1.89
9	合计	215,024,722.14	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	163,600.00	0.11
B	采矿业	509,360.00	0.35
C	制造业	7,684,860.40	5.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	160,380.00	0.11
F	批发和零售业	1,273,625.00	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	423,800.00	0.29
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	479,182.00	0.33
J	金融业	1,817,330.00	1.23
K	房地产业	931,700.00	0.63
L	租赁和商务服务业	680,200.00	0.46
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	516,900.00	0.35
R	文化、体育和娱乐业	607,050.00	0.41
S	综合	–	–
	合计	15,247,987.40	10.35

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:本基金本报告期内未通过沪港通投资股票。

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	601318	中国平安	16,100	1,102,850.00	0.75
2	600585	海螺水泥	25,500	938,145.00	0.64
3	600048	保利地产	70,000	851,900.00	0.58
4	002024	苏宁易购	53,600	722,528.00	0.49
5	601888	中国国旅	10,000	680,200.00	0.46
6	000858	五粮液	9,100	618,345.00	0.42
7	000681	视觉中国	22,500	607,050.00	0.41
8	600519	贵州茅台	800	584,000.00	0.40
9	601233	桐昆股份	31,800	522,792.00	0.35
10	002044	美年健康	30,000	516,900.00	0.35

5.4 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	1,649,150.00	1.12
2	央行票据	–	–
3	金融债券	60,279,000.00	40.93
	其中:政策性金融债	50,218,000.00	34.10
4	企业债券	66,943,620.00	45.45
5	企业短期融资券	30,360,000.00	20.61
6	中期票据	30,532,000.00	20.73
7	可转债(可交换债)	3,961,237.61	2.69
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	193,725,007.61	131.53

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

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	170210	17国开10	200,000	19,548,000.00	13.27
2	180205	18国开05	100,000	10,459,000.00	7.10
3	1280352	12湘高速债	100,000	10,367,000.00	7.04
4	1282435	12闽高速MTN2	100,000	10,333,000.00	7.02
5	180204	18国开04	100,000	10,291,000.00	6.99

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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

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:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金尚未开设国债期货交易单元,未进行国债期货操作。

未来一段时期,本基金没有进行国债期货操作的计划。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本报告期内,本基金尚未开设国债期货交易单元,未进行国债期货操作。

未来一段时期,本基金没有进行国债期货操作的计划。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.10.2

报告期内,本基金的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	46,535.06
2	应收证券清算款	38,673.11
3	应收股利	–
4	应收利息	3,968,162.97
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,053,371.14

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110032	三一转债	1,525,698.60	1.04
2	132009	17中油EB	1,190,250.00	0.81
3	128035	大族转债	222,372.00	0.15
4	123009	星源转债	188,819.00	0.13
5	128017	金禾转债	138,242.61	0.09
6	128024	宁行转债	113,570.00	0.08
7	128027	崇达转债	59,715.00	0.04

5.10.5 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。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,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

项目	红塔红土长益定期开放债券A	红塔红土长益定期开放债券C
报告期期初基金份额总额	143,782,903.11	409,695.48
报告期期间基金总申购份额	488.59	–
减:报告期期间基金总赎回份额	6,130.07	56,206.37
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	2,550,053.24	5,883.25
报告期期末基金份额总额	146,327,314.87	359,372.36

§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

项目	红塔红土长益定期开放债券A	红塔红土长益定期开放债券C
报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00	0.00
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	0.00	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00	0.00

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未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	2018-07-01至2018-09-30	143,102,470.90	2,538,085.06	0.00	145,640,555.96	99.29%
个人	–	–	–	–	–	–	–
产品特有风险							
本报告期内,本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形,可能出现大额赎回导致基金净值波动的风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产导致投资者赎回申请延期办理的风险。敬请投资者留意。							

注:上表申购份额包含报告期内份额折算调增的份额,赎回份额包含报告期内份额折算调减的份额。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、红塔红土长益定期开放债券型证券投资基金基金合同;

3、红塔红土长益定期开放债券型证券投资基金托管协议;

4、红塔红土长益定期开放债券型证券投资基金招募说明书;

5、报告期内披露的各项公告。

9.2 存放地点

广东省深圳市南山区侨香路4068号智慧广场A栋801

9.3 查阅方式

投资者可通过基金管理人网站,或在营业期间到基金管理人、基金托管人的办公场所免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人。

客服热线:4001-666-916(免长途话费)

公司网址:www.htamc.com.cn

红塔红土基金管理有限公司

2018年10月26日

红塔红土人人宝货币市场基金

2018年第三季度报告

基金管理人:红塔红土基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	红塔红土人人宝货币	
场内简称	–	
交易代码	002709	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年6月2日	
报告期末基金份额总额	666,597,543.25份	
投资目标	在控制投资组合风险,保持流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金在保持组合高度流动性的前提下,结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析,合理安排组合期限结构,积极选择投资工具,采取主动性的投资策略和精细化的操作手法,发现和捕捉市场的机会,实现基金的投资目标。	
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
基金管理人	红塔红土基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	红塔红土人人宝货币A	红塔红土人人宝货币B
下属分级基金的场内简称	–	–
下属分级基金的交易代码	002709	002710
下属分级基金的前端交易代码	–	–
下属分级基金的后端交易代码	–	–
报告期末下属分级基金的份额总额	46,395,490.70份	620,202,052.55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7月1日 – 2018年9月30日)	
	红塔红土人人宝货币A	红塔红土人人宝货币B
1. 本期已实现收益	349,051.81	4,167,568.32
2. 本期利润	349,051.81	4,167,568.32
3. 期末基金资产净值	46,395,490.70	620,202,052.55

注: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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

红塔红土人人宝货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7696%	0.0018%	0.3456%	0.0000%	0.4240%	0.0018%

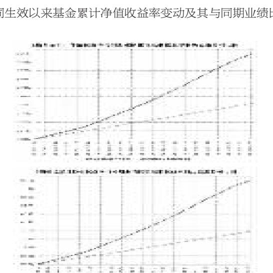
注:本基金收益分配按日结转份额。

红塔红土人人宝货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8306%	0.0018%	0.3456%	0.0000%	0.4850%	0.0018%

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§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		
罗薇	基金经理	2016年6月21日	–	6	澳洲新南威尔士大学会计学硕士,北京大学理学学士,2012年加入红塔红土基金研究部,现任职于公司投资部,为公司投资决策委员会委员。
赵耀	基金经理	2016年6月2日	2018年7月27日	14	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(美国注册金融分析师)。近14年证券、基金从业经历,历任诺安基金交易员、中国国际金融有限公司交易员,具有丰富的大资金运作交易经验。现任职公司投资部,为公司投资决策委员会委员。

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,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》、《红塔红土人人宝货币市场基金基金合同》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,未开展有损于基金份额持有人利益的关联交易,整体运作合法合规。

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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《红塔红土基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定,通过制度、流程和系统等在研究分析、投资决策、交易执行等各业务环节严格控制,公平对待旗下所有投资组合。

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在2018年三季度以同业存款、同业存单、回购为主要投资方向。三季度国内货币政策转向中性偏松,央行于7月5日定向降准,释放7000亿流动性;7月末中央政治局会议中提出坚持实施积极的财政政策和稳健的货币政策;三季度市场流动性整体保持充裕,资金价格持续下行,银行间隔夜利率一度跌破2%。由于货币传导机制尚不通畅,过量流动性滞留在银行体系,银行间收益率维持低位,全市场货币基金收益率出现整体下行。本基金在三季度内规模获得较快增长,基金持仓品种及发行人评级均为AAA级及以上,投资期限较为合理。基金选择高信用评级股份制银行、证券公司、公募基金作为主要交易对手,保证资金安全度,并通过分散资产到期限以保证基金流动性要求。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期红塔红土人人宝货币A的基金份额净值收益率为0.7696%,本报告期红塔红土人人宝货币B的基金份额净值收益率为0.8306%,同期业绩比较基准收益率为0.3456%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§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	固定收益投资	247,613,162.26	37.12
	其中:债券	247,613,162.26	37.12
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	274,201,264.55	41.11
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	141,870,591.42	21.27
4	其他资产	3,322,008.00	0.50
5	合计	667,007,026.23	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.51	
	其中:买断式回购融资	–	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	–	–
	其中:买断式回购融资	–	–

注:报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数,报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	91
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	70

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:本报告期内,本货币基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	45.99	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	1.50	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	2.99	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—120天	7.48	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)—397天(含)	41.68	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	99.64	–

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注:本报告期内,本货币基金投资组合平均剩余存续期限未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	50,047,003.43	7.51
	其中:政策性金融债	50,047,003.43	7.51
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	50,002,662.70	7.50
6	中期票据	–	–
7	同业存单	147,563,496.13	22.14
8	其他	–	–
9	合计	247,613,162.26	37.15
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180404	18农发04	200,000	20,042,724.55	3.01
2	180201	18国开01	200,000	19,995,442.80	3.00
3	180207	18国开07	100,000	10,008,836.08	1.50
4	011801173	18兖州煤业SCP004	100,000	10,000,962.62	1.50
5	011801198	18大唐发电SCP003	100,000	10,000,606.31	1.50
6	011801178	18中电投SCP016	100,000	10,000,500.90	1.50
7	011801405	18大唐发电SCP005	100,000	10,000,495.07	1.50
8	011801413	18招商局SCP007	100,000	10,000,097.80	1.50
9	111714282	17江苏银行CD282	100,000	9,984,830.74	1.50
10	111817137	18光大银行CD137	100,000	9,902,630.68	1.49

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1739%
报告期内偏离度的最低值	0.0690%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1058%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注:本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到0.5%。

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十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价和折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值为1.0000 元。

5.9.2

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	528,034.24
3	应收利息	2,650,256.76
4	应收申购款	143,717.00
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	3,322,008.00

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,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

项目	红塔红土人人宝货币A	红塔红土人人宝货币B
报告期期初基金份额总额	44,988,529.14	330,180,672.21
报告期期间基金总申购份额	48,503,618.55	561,160,688.16
报告期期间基金总赎回份额	47,096,656.99	271,139,307.82
报告期期末基金份额总额	46,395,490.70	620,202,052.55

注:总申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额,总赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2018年9月30日	23,108.71	23,108.71	–
合计			23,108.71	23,108.71	

注:表中红利再投指本报告期内管理人固有资金红利再投合计数。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

注:报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、红塔红土人人宝货币市场基金基金合同;

3、红塔红土人人宝货币市场基金托管协议;

4、红塔红土人人宝货币市场基金招募说明书;

5、报告期内披露的各项公告。

9.2 存放地点

广东省深圳市南山区侨香路4068号智慧广场A栋801

9.3 查阅方式

投资者可通过基金管理人网站,或在营业期间到基金管理人、基金托管人的办公场所免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人。

客服热线:4001-666-916(免长途话费)

公司网址:www.htamc.com.cn

红塔红土基金管理有限公司

2018年10月26日

红塔红土盛金新动力灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:红塔红土基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
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。

基金托管人中国光大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	红塔红土盛金新动力混合	
场内简称	–	
交易代码	001283	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年6月19日	
报告期末基金份额总额	120,943,030.86份	
投资目标	把握不同时期股票市场、债券市场、银行间市场的收益率,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。	
业绩比较基准	沪深300指数×55%+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。	
基金管理人	红塔红土基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	红塔红土盛金新动力混合A	红塔红土盛金新动力混合C
下属分级基金的场内简称	–	–
下属分级基金的交易代码	001283	001284
下属分级基金的前端交易代码	–	–
下属分级基金的后端交易代码	–	–
报告期末下属分级基金的份额总额	100,592,803.05份	20,350,227.81份
下属分级基金的风险收益特征	–	–

§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)	
	红塔红土盛金新动力混合A	红塔红土盛金新动力混合C
1. 本期已实现收益	719,927.08	133,462.72
2. 本期利润	-1,413,516.03	-296,837.83
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0141	-0.0146
4. 期末基金资产净值	92,118,836.06	18,571,019.27
5. 期末基金份额净值	0.9158	0.9126

注:1、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。

2、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。

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

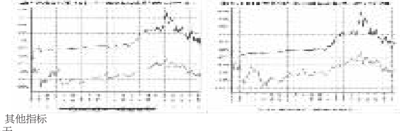
红塔红土盛金新动力混合A

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
过去三个月	-1.51%	0.82%	-0.54%	0.74%	-0.97%	0.08%

红塔红土盛金新动力混合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
过去三个月	-1.57%	0.82%	-0.54%	0.74%	-1.03%	0.08%

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



3.3 其他指标

注:无

§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		
罗薇	基金经理	2016年5月4日	–	6	澳洲新南威尔士大学会计学硕士,北京大学理学学士,具有六年医药/传媒等行业研究经验,2012年加入红塔红土基金研究部,现任职于公司投资部,为公司投资决策委员会委员。
赵耀	基金经理	2015年6月19日	2017年3月2日	14	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(美国注册金融分析师)。近14年证券、基金从业经历,历任诺安基金交易员、中国国际金融有限公司交易员,具有丰富的大资金运作交易经验。现任职公司投资部,为公司投资决策委员会委员。
林睿	基金经理	2017年3月2日	2017年8月31日	6	美国范德堡大学经济学专业硕士,北京师范大学电子、经济双学士。近6年证券从业经历,历任中国证券登记结算公司北京分公司信息服务部经理助理、深圳市新智达投资管理有限公司资产管理部经理,2015年加入红塔红土基金研究部,曾任职于公司投资部,为公司投资决策委员会委员。

注:1、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定等。

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,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》、《红塔红土盛金新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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,未开展有损于基金份额持有人利益的关联交易,整体运作合法合规。

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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《红塔红土基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定,通过制度、流程和系统等在研究分析、投资决策、交易执行等各业务环节严格控制,公平对待旗下所有投资组合。

公司建立研究管理平台向所有投资部门人员开放,确保各投资组合公平获得研究资源,通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的分析评估,保证公平交易原则的实现。公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,重点投资的股票必须来源于核心股票库。在公司备选股票库的基础上,各投资组合应根据不同投资组合的投资目标、投资风格和投资范围,建立不同投资组合的备选股票库。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的逐级审批程序。针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易,由集中交易室通过投资交易系统中的公平交易程序,按照"价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡"的原则,对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对以公司名义开展的场外网下交易,严格按照价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。监察稽核部通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易的原则,定期针对旗下所有投资组合的交易记录,进行交易时机和价差的专项统计分析,以排查异常交易。

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了《红塔红土基金管理有限公司异常交易监控管理办法》,除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合外,同一投资组合禁止同日反向交易,不同投资组合之间严格限制同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易,需经严格审批并留痕备查。

报告期内,本基金与基金管理人管理的其他投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易中,成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%,本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在三季度内择机提升了股票和债券持仓,在市场环境整体疲弱的情况下,选择了相对稳健的投资策略。贸易战带来的外部冲击对三季度股票市场造成了较大冲击,而国内货币政策转向中性偏松,资金面的宽裕对债券市场形成利好。股票投资方面,本基金在三季度以地产/金融/消费类低估值绩优股为主要投资方向,通过自上而下结合自下而上的研究方式,精选估值便宜安全边际高,与此同时还具备业绩增长的个股;债券投资方面,组合增加了利率债的投资比例,适当提升债券组合久期,并积极投资可转债标的;基金以网上申购的方式参与新股发行,并积极参与可转债申购,以提升基金收益水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末红塔红土盛金新动力混合A基金份额净值为0.9158元,本报告期基金份额净值增长率为-1.51%;截至本报告期末红塔红土盛金新动力混合C基金份额净值为0.9126元,本报告期基金份额净值增长率为-1.57%;同期业绩比较基准收益率为-0.54%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§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	57,762,997.58	50.85
	其中:股票	57,762,997.58	50.85
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	47,454,873.90	41.78
	其中:债券	47,454,873.90	41.78
	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	2,300,000.00	2.02
	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	2,545,319.08	2.24
8	其他资产	3,526,677.87	3.10
9	合计	113,589,868.43	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	1,307,700.00	1.18
C	制造业	35,166,139.78	31.77
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	1,630,000.00	1.47
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	857,850.00	0.78
J	金融业	6,639,699.10	6.00
K	房地产业	12,161,608.70	10.99
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	57,762,997.58	52.18

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:本基金本报告期内未通过沪港通投资股票。

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	600048	保利地产	280,646	3,415,461.82	3.09
2	601155	新城控股	130,024	3,405,328.56	3.08
3	002146	荣盛发展	350,357	2,795,848.86	2.53
4	600426	华鲁恒升	160,000	2,753,600.00	2.49
5	000858	五粮液	40,000	2,718,000.00	2.46
6	603799	华友钴业	49,993	2,664,126.97	2.41
7	603156	养元饮品	52,804	2,644,952.36	2.39
8	600466	蓝光发展	499,994	2,544,969.46	2.30
9	000333	美的集团	60,000	2,418,000.00	2.18
10	603986	兆易创新	24,000	2,129,520.00	1.92

5.4 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	12,121,790.00	10.95
2	央行票据	–	–
3	金融债券	9,055,500.00	8.18
	其中:政策性金融债	9,055,500.00	8.18
4	企业债券	22,128,000.00	19.99
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	4,149,583.90	3.75
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	47,454,873.90	42.87

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

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	1680017	16奥德01	100,000	10,069,000.00	9.10
2	112196	13苏宁债	80,000	8,129,600.00	7.34
3	018005	国开1701	60,000	6,036,000.00	5.45
4	010107	21国债(7)	37,000	3,793,240.00	3.43
5	108602	国开1704	30,000	3,019,500.00	2.73

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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内,本基金尚未开设股指期货交易单元,未进行股指期货操作。

未来一段时期,本基金没有进行股指期货操作的计划。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金尚未开设国债期货交易单元,未进行国债期货操作。

未来一段时期,本基金没有进行国债期货操作的计划。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内,本基金尚未开设国债期货交易单元,未进行国债期货操作。

未来一段时期,本基金没有进行国债期货操作的计划。

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,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

报告期内,本基金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	94,715.93
2	应收证券清算款	2,424,519.32
3	应收股利	–
4	应收利息	1,007,442.62
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	3,526,677.87

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132009	17中油EB	1,656,000.00	1.50
2	110032	三一转债	1,053,519.00	0.95
3	123009	星源转债	715,957.22	0.65
4	128024	宁行转债	111,752.88	0.10
5	128035	大族转债	104,400.00	0.09
6	128027	崇达转债	59,715.00	0.05
7	128017	金禾转债	29,762.70	0.03

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603156	养元饮品	2,644,952.36	2.39	网下申购锁定期
2	000333	美的集团	2,418,000.00	2.18	重大事项

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

项目	红塔红土盛金新动力混合A	红塔红土盛金新动力混合C
报告期期初基金份额总额	100,601,293.27	20,350,713.39
报告期期间基金总申购份额	654.22	1,045.52
减:报告期期间基金总赎回份额	9,144.44	1,531.10
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	100,592,803.05	20,350,227.81

§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

项目	红塔红土盛金新动力混合A	红塔红土盛金新动力混合C
报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00	10,316,944.33
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	0.00	10,316,944.33
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00	8.53

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未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	2018-07-01至2018-09-30	100,017,900.00	–	–	100,017,900.00	82.70%
个人	–	–	–	–	–	–	–
产品特有风险							
本报告期内,本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形,可能出现大额赎回导致基金净值波动的风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产导致投资者赎回申请延期办理的风险。敬请投资者留意。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、红塔红土盛金新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同;

3、红塔红土盛金新动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议;

4、红塔红土盛金新动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书;

5、报告期内披露的各项公告。

9.2 存放地点

广东省深圳市南山区侨香路4068号智慧广场A栋801

9.3 查阅方式

投资者可通过基金管理人网站,或在营业期间到基金管理人、基金托管人的办公场所免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人。

客服热线:4001-666-916(免长途话费)

公司网址:www.htamc.com.cn

红塔红土基金管理有限公司

2018年10月26日