红塔红土盛通灵活配置混合型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要

（2018年2号）

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

【重要提示】

红塔红土盛通灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2017年9月5日证监许可【2017】1619号文注册。本基金基金合同已于2017年12月7日正式生效,自该日起基金管理人正式开始管理本基金。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资者认购(或申购)基金份额时应认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征,应充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益,但同时也需承担相应的投资风险。本基金投资的主要风险包括政策风险、经济周期风险、利率风险、信用风险、购买力风险、债券收益率曲线变动风险、再投资风险、经营风险、新股价格波动风险等市场风险,此外,还包括由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险等。基金管理人提醒投资者注意基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行负责。

本基金投资于中小企业私募债券,面临信用风险及流动性风险。信用风险主要是由目前国内中小企业的发展状况所导致的发行人违约、不按时偿付本金或利息的风险;流动性风险主要是由债券非公开发行和转让所导致的无法按照合理的价格及时变现的风险。本基金管理人将秉承稳健投资的原则,审慎参与中小企业私募债券的投资,严格控制中小企业私募债券的投资风险。

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。

本基金同时为发起式基金,在基金募集时,基金管理人运用自有资金认购本基金的金额不低于1000 万元,认购的基金份额持有期限不低于三年。基金管理人认购的基金份额持有期限满三年后,基金管理人将根据自身情况决定是否继续持有,届时,基金管理人有可能赎回认购的本基金份额。另外,在《基金合同》生效之日起三年后的对应日,如果本基金的基金资产净值低于2 亿元,基金合同将自动终止,投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

基金管理人管理的其他基金的过往业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本基金不属于定制基金,目标客户不包括特定的机构投资者(由于本基金为发起式基金,基金管理人作为发起资金提供方除外),不存在任何承诺收益安排、合作协议或合作安排。本基金管理人拥有完全、独立的投资决策独立自主权,不受任何投资者的影响。本基金管理人将公平对待所有投资者,不向任何投资者提供额外的投资组合信息或提前披露相关信息。同时,本基金管理人也将采取必要、合理的措施保护中小投资者合法权益。

本招募说明书所载内容截止为2018年12月7日,有关财务数据和净值表现截止日2018年9月30日。本招募说明书所载财务数据未经会计师事务所审计。本基金托管人交通银行股份有限公司已于2018年12月24日复核了本次更新的招募说明书。

一、基金管理人
(一)基金管理人概况
名称:红塔红土基金管理有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区侨香路4068号智慧广场A座801
法定代表人:刘辉
设立日期: 2012年6月12日
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:证监许可【2012】643号
组织形式: 有限责任公司
注册资本:4.96亿元人民币
存续期限: 持续经营
联系电话:0755-36855888
传　　真:0755-33379033
股权结构:

股东名称	出资比例
红塔证券股份有限公司	59.27%
北京市华远集团有限公司	30.24%
深圳市创新投资集团有限公司	10.49%

(二)主要人员情况
1、董事会成员
公司董事会由九名成员组成,设董事长一名、副董事长一名,独立董事三名。

饶雄先生,董事长。工学博士,中共党员;1992年参加工作,曾任东方证券股份有限责任公司研究员、鹏华基金管理有限公司研究员、银河基金管理公司基金经理及投资决策委员会委员、红塔证券股份有限公司总裁助理兼投资管理总部总经理、投资总监、副总裁、党委委员等;现任红塔红土基金管理有限公司董事长。

刘辉先生,董事。经济学硕士、管理学博士,经济师,中共党员;1995年参加工作,曾任云南省对外贸易经济合作厅办公室综合秘书、云南烟草兴云投资股份有限公司财务部审计员、云南省烟草公司国有资产投资管理处项目主管、云南烟草兴云投资股份有限公司投资管理部副总经理、国联基金管理有限公司(后更名为中海基金管理有限公司)总经理助理、副总经理、红塔证券股份有限公司总裁助理等;现任红塔红土基金管理有限公司董事、总经理、法定代表人,深圳市红塔资产管理有限公司董事长。

李凌先生,董事。研究生,中共党员;1987年参加工作,曾任云南省体改委主任科员、云南省证管办期货处副处长、中国证监会昆明特派办稽查处负责人、综合处负责人、处长、中国证监会云南监管局综合处处长、机构处处长、红塔证券股份有限公司副总裁等;现任红塔红土基金管理有限公司董事、督察长,深圳市红塔资产管理有限公司董事。

李夏先生,董事。工学硕士、金融学博士,中共党员;1990年参加工作,曾任中国农村发展信托投资公司项目经理、深圳证券交易所研究员、深圳国际高新技术产权交易所总裁助理、长江商学院案例中心副主任等;现任深圳市创新投资集团有限公司投资决策委员会秘书处秘书长,红塔红土基金管理有限公司董事。

徐骥女士,董事。管理学硕士,经济师,中共党员;2011年参加工作,曾任北京市华远集团有限公司投资部项目经理、副经理,现任北京市华远集团有限公司董事会秘书、投资管理部经理,红塔红土基金管理有限公司董事。

张妮女士,董事。管理学硕士,经济师,中共党员;2011年参加工作,曾任远大能源利用管理有限公司人力资源管理专员、华远集团有限公司人力资源部职员,现任华远集团有限公司人力资源部副经理,红塔红土基金管理有限公司董事。

贺卫,独立董事。经济学博士,教授职称,1983年参加工作,曾任安徽工业大学冶金系教师,昆明理工大学管理工程系教师、副教授,上海交通大学管理学院管理科学与工程流动站博士后研究人员, 东华大学旭日工商管理学院教授、硕士生导师,现已退休,兼任中国世界贸易组织研究院特约研究员、中国工业经济学会理事,为红塔红土基金管理有限公司独立董事。

张铁山,独立董事。工学硕士,教授职称,1983年参加工作,现任北方工业大学经济管理学院管理系教授,工商管理-技术经济及管理硕士点责任教授、管理研究所所长,兼任国际价值工程协会注册价值管理专家,北京市价值工程学会副会长,中国数量经济学会理事,为红塔红土基金管理有限公司独立董事。

傅曦林先生,独立董事。民商法学博士,执业律师;1997年参加工作,曾任江苏三山实业股份有限公司(深市上市公司)董事会秘书、中国平安保险股份有限公司董事会秘书、深圳国际高新技术产权交易所(深圳联合产权交易所)法律与监管部总经理、汉唐证券有限公司风险控制总部副总经理;现任广东华商律师事务所高级合伙人,深圳国际仲裁院仲裁员,世联行(002285)独立董事,红塔红土基金管理有限公司独立董事。

2、监事会成员
公司不设监事会,设监事两名,其中一名为职工监事。

刘珍女士,监事,大学本科学历,法学学士;1983年参加工作,曾任中国民航总局国际司法律官员、广东粤海企业集团公司研究与发展部总经理、深圳金威啤酒有限公司董事国浩律师集团深圳事务所高级顾问、TCL集团股份有限公司平板项目组负责人、深圳市海峡实业有限公司副总经理、中美资本控股集团总裁助理等;现任红塔红土基金管理有限公司监事、深圳市红塔资产管理有限公司总经理。

王靖女士,职工监事。会计学本科学历,会计师;1996年参加工作,曾任西南证券深圳福强路营业部会计、深圳市汉鼎投资公司财务主管、红塔证券股份有限公司营业部财务主管等,现任红塔红土基金管理有限公司总经理助理(兼综合管理部总监),红塔红土基金管理有限公司职工监事。

3、公司高级管理人员及督察长
饶雄先生:工学博士,中共党员;1992年参加工作,曾任东方证券股份有限责任公司研究员、鹏华基金管理有限公司研究员、银河基金管理公司基金经理及投资决策委员会委员、红塔证券股份有限公司总裁助理兼投资管理总部总经理、投资总监、副总裁、党委委员等,红塔红土基金管理有限公司董事长。

刘辉先生:经济学硕士、管理学博士,经济师,中共党员;1995年参加工作,曾任云南省对外贸易经济合作厅办公室综合秘书、云南烟草兴云投资股份有限公司财务部审计员、云南省烟草公司国有资产投资管理处项目主管、云南烟草兴云投资股份有限公司投资管理部副总经理、国联基金管理有限公司(后更名为中海基金管理有限公司)总经理助理、副总经理、红塔证券股份有限公司总裁助理等;现任红塔红土基金管理有限公司董事、总经理、法定代表人。

李凌先生:研究生,中共党员;1987年参加工作,曾任云南省体改委主任科员、云南省证管办期货处副处长、中国证监会昆明特派办稽查处负责人、综合处负责人、处长、中国证监会云南监管局综合处处长、机构处处长、红塔证券股份有限公司副总裁等;现任红塔红土基金管理有限公司董事、督察长,深圳市红塔资产管理有限公司董事。

王园先生:大学本科学历,管理学学士,经济师;1991年参加工作,曾任四川省粮食局办公室秘书、四川省川粮开发公司证券投资部经理、重庆国投深圳证券部投资银行部高级经理、西南证券深圳福强营业部副总经理、西北证券广州营业部总经理等;现任红塔红土基金管理有限公司副总经理,深圳市红塔资产管理有限公司董事长、法定代表人。

4、本基金基金经理
罗薇,澳洲新南威尔士大学会计学硕士,北京大学理学学士,CFAIII级候选人。2012年加入红塔红土基金管理有限公司,曾先后就职于研究部、交易部,历任研究助理、研究员、交易员,负责固定收益及债券信用分析,具有丰富的债券研究及交易经验。现任职投资部,为公司投资决策委员会委员。

赵耀,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、基金工作经历,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。

赵耀先生具有多年证券行业交易、研究、投资领域工作实战经历,是深圳市地方级领军人才,具有深厚的证券研究功底,良好的专业能力以及丰富的行业经验,精通于通过宏观经济分析对大类资产配置、通过行为金融学对市场投资者行为的分析以及通过价值分析对个股的挖掘。

5、投资决策委员会成员的姓名、职务
刘辉先生,投资决策委员会主任,公司董事、总经理、法定代表人。
赵耀先生,投资决策委员会秘书长。
梁钧先生,投资决策委员会成员。
罗薇女士,投资决策委员会成员。
李超明先生,投资决策委员会成员。
6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人
(一)基本情况
公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)
公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人:彭纯
住　　所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
邮政编码:200120
注册时间:1987年3月30日
注册资本:742.62亿元
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号
联系人:陆志俊
电话:95559

交通银行始建于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业,成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行,总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市,2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2017年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告,交通银行一级资本位列第11位,较上年上升2位;根据2017年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜,交通银行营业收入位列第171位。

截至2018年9月30日,交通银行资产总额为人民币93915.37亿元。2018年1-9月,交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币573.04亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心(下文简称“托管中心”)。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

2、主要人员情况
彭纯先生,董事长、执行董事,高级会计师。

彭先生2018年2月起任本行董事长、执行董事。2013年11月起任本行执行董事。2013年11月至2018年2月任本行副董事长、执行董事,2013年10月至2018年1月任本行行长;2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理;2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长;2004年9月至2005年8月任本行副行长;2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理;2001年9月至2004年6月任本行行长助理;1994年至2001年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长,南宁分行行长,广州分行行长。彭先生1986年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

任德奇先生,副董事长、执行董事、行长,高级经济师。

任先生2018年8月起任本行副董事长、执行董事、行长。2014年7月至2016年11月任中国银行副行长,2016年12月至2018年6月任中国银行执行董事、副行长,其中:2015年10月至2018年6月兼任中银香港(控股)有限公司非执行董事,2016年9月至2018年6月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁;2003年8月至2014年5月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、岳阳市中心支行、岳阳分行,中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生1988年于清华大学获工学硕士学位。

袁庆伟女士,资产托管业务中心总裁,高级经济师。

袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁;2007年12月至2015年8月,历任本行资产托管部总经理助理、副总经理,本行资产托管业务中心副总裁;1999年12月至2007年12月,历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长,会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系,获得学士学位,2005年于新疆财经学院获硕士学位。

3、基金托管业务经营情况
截至2018年9月30日,交通银行共托管证券投资基金384只。此外,交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产、RQDII证券投资资产和QDLP资金等产品。

(二)基金托管人的内部风险控制制度说明
1、内部控制目标
交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定,加强内部管理,保证托管中心业务规章的健全和各项规章的贯彻执行, 通过对各种风险的梳理,评估、监控,有效地实现对各项业务风险的管控,确保业务稳健运行,保护基金持有人的合法权益。
2、内部控制原则
(1)合法性原则:托管中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。
(2)全面性原则:托管中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制,覆盖各项业务、各个部门和各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节,建立全面的风险管理监督机制。
(3)独立性原则:托管中心独立负责受托基金资产的保管,保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立,对不同的受托基金资产分别设置账户,独立核算,分账管理。
(4)制衡性原则:托管中心贯彻适当授权、相互制约的原则,从组织结构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互牵制,并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。
(5)有效性原则:托管中心在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上,形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制,通过行之有效的控制流程、控制措施,建立合理的内控程序,保障内控管理的有效执行。
(6)效益性原则:托管中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应,尽量降低经营运作成本,以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。
3、内部控制制度及措施
根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》等法律法规,托管中心制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度,确保基金托管业务运行的规范、安全、高效,包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务系统建设管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务档案管理暂行办法》等,并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工合理,技术系统完整独立,业务管理制度化,核心作业区实行封闭管理,有关信息披露由专人负责。

托管中心通过对基金托管业务各环节的事前指导、事中风控和事后检查措施实现全流程、全链条的风险控制管理,聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

(三)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序
交通银行作为基金托管人,根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定,对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人,发现基金管理人有违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为,及时通知基金管理人予以纠正,基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对交通银行通知的违规事项未能及时纠正的,交通银行有权报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人,发现基金管理人有重大违规行为,有权立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

4、其他事项
最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为,未受到中国人民银行、中国证监会、中国银保监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

三、相关服务机构
(一)基金份额发售机构
1、直销机构:红塔红土基金管理有限公司直销中心
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区侨香路4068号智慧广场A座801
法定代表人:刘辉
电话:(0755)36855888
传真:(0755)33379015
客服电话:4001666916
公司网站:www.htamc.com.cn
2、代销机构
(1)交通银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:彭纯
联系人:王菁
电话:95559
(2)云南红塔银行股份有限公司
注册地址:云南省玉溪市东风南路 2 号
法定代表人:李光林
客服电话:0877-96522
网址: www.yxccb.com.cn
(3) 中泰证券有限公司
注册地址:山东省济南市市中区经七路86号
办公地址:山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人:李玮
客服电话:95538
网址:www.95538.cn
(4) 中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址:北京市东城区朝阳门内大街 188 号
法定代表人:王常青
联系人:权唐
客服电话:400-8888-108
网址:www.csc108.com
(5) 国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
联系人:齐晓燕
客服电话:95536
网址:www.guosen.com.cn/
(6) 安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元
办公地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元
法定代表人:王连志
联系人:陈剑虹
客服电话:4008001001
网址:www.essence.com.cn
(7) 天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园陆2号高科大厦四楼
办公地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园陆2号高科大厦四楼
法定代表人:余磊
联系人:夏旻
客服电话:95391 / 400-800-5000
网址:www.tfzq.com
(8)联讯证券股份有限公司
注册地址:惠州市江北东三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
法定代表人:徐刚
联系人:彭莲
客服电话:95564
网址:www.lxzq.com.cn
(9) 红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:李素明
联系人:高国泽
客服电话:400-871-8880
网址: www.hongtastock.com
(10) 奕丰基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115-1116 室
法定代表人:TEO WEE HOWE
客服电话:400-684-0500
网址:www.ifastps.com.cn
(11) 泰诚财富基金销售(大连)有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:林卓
联系人:张晓辉
客服电话:400-6411-999
网址:www.taichengcaifu.com
(12) 深圳市金斧子基金销售有限公司
注册地址:深证市南山区智慧广场A栋11层1101-02
办公地址:深证市南山区科苑北东方科技大厦18楼
法定代表人:赖任军
联系人:张烨
客服电话:400-9500-888
网址:www.jfz.com
(13) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司
注册地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504
办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504
法定代表人:陈洪生
联系人:梁云波
客服电话:0592-3128888
网址:www.xds.com.cn
(14) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:杭州市文二西路1号903室
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人:凌顺平
联系人:张鹏
客服电话:4008-773-772
网址:fund.10jqka.com.cn
(15) 深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
办公地址: 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
客户服务电话: 4006788887
网址:www.zlfund.cn
(16) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4 栋10 层1006
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28 号富卓大厦16 层
法定代表人:曹伟超
客服电话:400-166-1188
网址:www.new-rand.cn
(17) 大泰金石基金销售有限公司
注册地址:南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼A506 室
法定代表人:姚杨
联系人:何庭宇
客服电话:400-928-2266
网址:www.dtfunds.com
(18) 泛华普益基金销售有限公司
注册地址:成都市成华区建设路9号高地中心1101室
办公地址:成都市成华区建设路9号高地中心1101室
法定代表人:于海锋
联系人:付勇斌
客服电话:4008588588
公司网站:www.pyfund.cn
(19) 五矿证券有限公司
企业地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元
法定代表人:黄海洲
客服电话:40018-40028
网址:www.wkzq.com.cn/
(20) 上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
客服电话:4000891289
网址:www.erichfund.com
(21) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市 徐汇区龙田路 190 号 2号楼 2层
法定代表人:其实
客服电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn
(22)万联证券股份有限公司
企业地址:广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19层
法定代表人:张建军
客服电话:4008888133
网址:http://www.wlzq.cn/main/home/index.shtml
(23)北京汇成基金销售有限公司
企业地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人:王伟刚
客服电话:400-619-9059
网址:http://www.hcjijin.com/
(24)天津万家财富资产管理有限公司
企业地址: 天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦A座5层
法定代表人:李修辞
客服电话:010-59013895
网址:http://www.wanjiawealth.com/index.html
(25)中国银河证券股份有限公司
企业地址:北京市西城区金融大街35号2-6层
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈共炎
客服电话:95551或4008-888-888
网址:http://www.chinastock.com.cn/
(26) 上海联泰资产管理有限公司
企业地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8座3层
法定代表人:燕斌
客服电话:400-166-6788
网址:http://www.66zichan.com/
(27) 爱建证券有限责任公司
企业地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼
法定代表人:祝健
客服电话:4001-962-502
网址:http://www.ajzq.com/
(28) 珠海盈米财富管理有限公司
企业地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔1201-1203室
法定代表人:肖雯
客服电话:020-89629066
网址:https://www.yingmi.cn/
(29) 天津国美基金销售有限公司
企业地址:天津经济技术开发区第一大街79号MSDCI-2801
办公地址:天津经济技术开发区第一大街79号MSDCI-2801
法定代表人:丁东华
客服电话:400-111-0889
网址:https://www.gomefund.com/
(30) 上海基煜基金销售有限公司
企业地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人:王翔
客服电话:400-820-5369
网址: www.jiyufofund.com.cn
(31) 上海好买基金销售有限公司
企业地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室
法定代表人:杨文斌
客服电话: 400-700-9665
网址: www.ehowbuy.com
3、其他代销机构:具体名单详见本基金份额发售公告
(二)登记机构
名称:红塔红土基金管理有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区侨香路4068号智慧广场A座801
法定代表人:刘辉
联系人:许艺然
电话:(0755)36855888
传真:(0755)33379033
(三)律师事务所及经办律师
名称:上海源泰律师事务所
住所:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1405室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人:廖海
电话:(021)51150298
传真:(021)51150398
经办律师:廖海、刘佳
联系人:刘佳
(四)会计师事务所及经办注册会计师
名称: 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
法定代表人:毛鞍宁
电话:(010)58153000　(0755)25028288
传真:(010)85188298　(0755)25026188
签章注册会计师:昌华、乌爱莉
联系人:昌华

四、基金的名称
红塔红土盛通灵活配置混合型发起式证券投资基金
五、基金的类型
混合型证券投资基金
六、基金的投资目标
在有效控制投资组合风险的前提下,通过股票、债券等各类资产的灵活配置,精选财务稳健、业绩良好、管理规范的投资标的,力争获得超越业绩比较基准的收益。
七、基金的投资范围
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、创业板以及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券))、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单及现金、衍生工具(权证、股指期货等)以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

基金的投资组合比例为:
本基金股票投资占基金资产的比例为0% - 95%;权证投资占基金资产净值的比例为0% - 3%,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投资比例合计不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构以后对投资比例要求有变更的,基金管理人在履行适当程序后,可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资组合比例。

八、基金的投资策略
1、大类资产配置策略
本基金主要通过对宏观经济周期进行分析的方法进行大类资产配置,通过投资时钟确定大类资产的总体配置,再结合各个市场趋势分析进行调整,同时综合考虑本基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素,制定本基金资产的大类资产配置比例。
2、股票投资策略
本基金坚持自上而下与自下而上相结合的投资理念,在以整个宏观策略为前提下,把握结构性机会,将行业分析与个股精选相结合,寻找出兼具成长型和盈利能力的子行业和优质个股。
(1)行业分析
在综合考虑行业的周期、竞争格局、技术进步、政府政策、社会习惯的改变等因素后,精选出行业地位高、行业的发展空间大,成长性好的子行业。
(2)个股选择
本基金在选择二级市场上发行上市个股时关注如下几个方面:
1)基本面
成长性:主营业务竞争力强,包括核心技术、品牌、公司管理或者规模、成本等方面;公司所处的行业具备较大的成长空间或稳定的增长空间;若公司所处的行业增长潜力一般,则公司具有不断扩大市场份额提高市场占有率,保持增速的能力。
盈利性:不仅有短期的业绩与盈利支撑,同时盈利和毛利率在未来的稳定性、持续性好,具有长期的投资空间、良好的治理结构、管理层能力强、商业模式优越等。
2)估值水平
本基金除了关注个股的基本面、成长性和盈利能力之外,还要考查个股业绩的增长性和估值的匹配程度,如果估值比较合理或者低估就会选择买入并坚持持有,相反如果估值已透支了未来几年的增长, 即业绩增长的速度与股价和市盈率不相匹配,那么就会相应减持这种股票。
3、债券投资策略
本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略,构建债券投资组合。
(1)久期偏离
本基金通过对宏观经济走势、货币政策和财政政策、市场结构变化等方面的定性分析和定量分析,预测利率的变化趋势,从而采取久期偏离策略,根据对利率水平的预期调整组合久期。
(2)期限结构配置
本基金将根据对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断,适时采用哑铃型或梯型或子弹型投资策略,在长期、中期和短期债券间进行配置,以便最大限度的避免投资组合收益受债券利率变动的负面影响。
(3)类属配置
类属配置指债券组合中各债券种类间的配置,包括债券在国债、央行票据、金融债、企业债、可转换债券等债券品种间的分布,债券在浮动利率债券和固定利率债券间的分布。
(4)个券选择
个券选择是指通过比较个券的流动性、到期收益率、信用等级、税收因素,确定一定期限下的债券品种的过程。
4、股指期货投资策略
本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本。
5、资产支持证券投资策略
本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响,谨慎投资资产支持证券。
6、可转换债、可交换债投资策略
可转换债券和可交换债券兼备权益类证券与固定收益类证券的特性,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。可转换债券和可交换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期权价值。本基金将通过相对价值分析、基本面研究、估值分析等,选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可交换债、可转换债券进行投资。此外,本基金还将根据新发可转债和可交换债券的预计中签率、模型定价结果,积极参与可转债和可交换债券新券的申购。
7、中小企业私募债投资策略
与传统的信用债券相比,中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让,普遍具有高风险和高收益的显著特点。
本基金将运用基本面研究,结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。具体为:①研究债券发行人的公司背景、产业发展趋势、行业政策、盈利状况、竞争地位、治理结构等基本面信息,分析企业的长期运作风险;②运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、成长能力、现金流水平等方面进行综合评价,评估发行人财务风险;③利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息,估算私募债券发行人的违约率及违约损失率;④考察债券发行人的增信措施,如担保、抵押、质押、银行授信、偿债基金、有序偿债安排等;⑤综合上述分析结果,确定信用利差的合理水平,利用市场的相对失衡,选择具有投资价值的品种进行投资。
8、权证投资策略
本基金的权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。在个券层面上,本基金通过对权证标的公司的基本面研究和未来走势预判,估算权证合理价值,同时还充分考虑个券的流动性,谨慎进行投资。

(三)投资限制
1、组合限制
基金的投资组合应遵循下列限制:
(1)本基金股票投资占基金资产的比例为0% - 95%;
(2)每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;
(3)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;
(4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;
(5)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;
(6)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;
(7)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;
(8)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;
(9)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;
(10)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;
(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;
(12) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%。
(13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。
(14) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致。
(15)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;
(16)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
(17) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1 年,债券回购到期后不得展期;
(18)本基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;
(19)本基金若参与股指期货交易,需遵守下列投资比例限制:
1)本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;
2)本基金在任何交易日日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;
3)本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;
4)本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;
5)本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;
(20) 本基金持有单只中小企业私募债, 其市值不得超过本基金资产净值的10%;本基金持有的全部中小企业私募债总市值不得超过基金资产净值的20%;
(21)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。
除(2)、(13)、(14)、(15)之外,因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。
基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。
法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。
2、禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:
(1)承销证券;
(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
(5)向其基金管理人、基金托管人出资;
(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。
基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易的,应当符合本基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。
如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定,基金管理人在履行适当程序后,本基金可不受上述规定的限制或按变更后的规定执行。

九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率×55%+中债总指数(财富)收益率×45%。
沪深300 指数是反映沪深两市A股综合表现的跨市场成份指数,由沪深两市300只规模大、流动性好的股票作为样本编制而成。它涵盖了沪深两市超过六成的市值,具有良好的市场代表性、可投资性和较强的市场影响力。中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国债券指数。该指数同时覆盖了上海证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的主要固定收益类证券,具有广泛的市场代表性,能够反映债券市场总体走势。
随着市场环境的变化,如果上述业绩比较基准不适用本基金或本基金业绩比较基准停止发布时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,报中国证监会备案,无需召开基金份额持有人大会审议。基金管理人应在调整前3个工作日在中国证监会指定的信息披露媒介上刊登公告。

十、基金的风险收益特征
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。

十一、基金投资组合报告
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。
本报告中的财务资料未经审计。
本报告期自2018年7月1日至2018年9月30日
8.1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	33,808,027.34	56.82
	其中:股票	33,808,027.34	56.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	22,195,523.86	37.31
	其中:债券	22,195,523.86	37.31
	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	1,264,516.17	2.13
8	其他资产	2,226,958.06	3.74
9	合计	59,495,025.43	100.00

8.2报告期末按行业分类的股票投资组合
8.2.1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	668,800.00	1.25
C	制造业	20,849,820.60	39.07
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	815,000.00	1.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	980,400.00	1.84
J	金融业	2,453,550.42	4.60
K	房地产业	8,040,456.32	15.07
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	33,808,027.34	63.36

8.2.2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。
8.3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	601155	新城控股	80,013	2,095,540.47	3.93
2	600048	保利地产	170,027	2,069,228.59	3.88
3	002146	荣盛发展	250,202	1,996,611.96	3.74
4	600466	蓝光发展	369,170	1,879,075.30	3.52
5	000858	五粮液	25,000	1,698,750.00	3.18
6	603799	华友钴业	30,005	1,598,966.45	3.00
7	300014	亿纬锂能	100,000	1,420,000.00	2.66
8	600426	华鲁恒升	80,000	1,376,800.00	2.58
9	603986	兆易创新	15,000	1,330,950.00	2.49
10	002008	大族激光	30,000	1,271,100.00	2.38

8.4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	6,233,032.00	11.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,037,500.00	11.31
	其中:政策性金融债	6,037,500.00	11.31
4	企业债券	5,374,000.00	10.07
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	4,550,991.86	8.53
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	22,195,523.86	41.59

8.5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	112196	13苏宁债	40,000	4,064,800.00	7.62
2	108602	国开1704	30,000	3,019,500.00	5.66
3	018005	国开1701	30,000	3,018,000.00	5.66
4	132009	17中油EB	23,500	2,432,250.00	4.56
5	010107	21国债(7)	17,000	1,742,840.00	3.27

8.6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。
8.7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。
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权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。
8.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
8.9.1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。
8.9.2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。
8.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
8.10.1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。
8.10.2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。
8.10.3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。
8.11投资组合报告附注
8.11.1
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。
8.11.2
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。
8.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	54,028.38
2	应收证券清算款	1,805,151.09
3	应收股利	-
4	应收利息	367,678.67
5	应收申购款	99.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,226,958.06

8.11.4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	§1 公允价值(元)	§2 占基金资产净值比例(%)
1	132009	17中油EB	2,432,250.00	4.56
2	110032	三一转债	913,896.00	1.71
3	123009	星源转债	632,099.37	1.18
4	128035	大族转债	104,400.00	0.20
5	128024	宁行转债	80,293.99	0.15
6	128027	崇达转债	60,909.30	0.11
7	128017	金禾转债	37,973.10	0.07

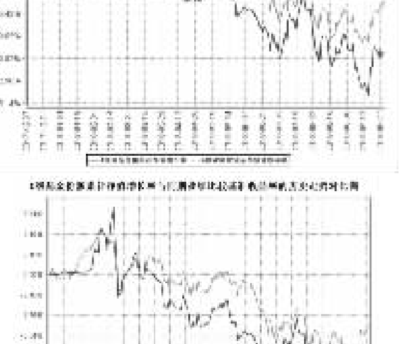
8.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。
8.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾
十二、基金的业绩
本基金基金合同于2017年12月7日生效。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不向投资者保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
(1)基金的净值表现
(1.1)本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
红塔红土盛通混合型发起式A

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	-2.00%	1.01%	-0.54%	0.74%	-1.46%	0.27%

红塔红土盛通混合型发起式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	-2.05%	1.01%	-0.54%	0.74%	-1.51%	0.27%

(1.2) 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



注:本基金的基金合同于2017年12月7日生效,截至2018年9月30日,基金合同生效未满1年。
本基金建仓期自2017年12月7日至2018年6月7日,报告期末基金已完成建仓,报告期末资产配置比例符合本基金基金合同规定。

十三、基金的费用与税收
(一)基金费用的种类
1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、C类基金份额的销售服务费;
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券、期货交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、基金的开户费用、账户维护费用;
10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1、基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下:
$H=E\times1.0\%\div$当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。
2、基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
$H=E\times0.2\%\div$当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。
3、销售服务费
本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.25%。本基金销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.25%年费率计提。
计算方法如下:
$H=E\times0.25\%\div$当年天数
H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日基金资产净值
销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,经基金管理人代付给各个销售机构。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。
销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。
上述“(一)基金费用的种类”中第4-10项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人根据基金管理人指令并参照行业惯例从基金财产中支付。
(三)不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:
1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、基金合同生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
(四)基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明
本招募说明书依据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况,对本基金原招募说明书进行了更新。主要更新内容如下:
1、“重要提示”部分
(1)更新了本招募说明书所载内容的截止日以及有关财务数据和净值表现的截止日期信息
2、“三、基金管理人”部分
(1)根据基金管理人主要人员情况的变化,对基金管理人主要人员情况等内容进行了更新
3、“四、基金托管人”部分
(1)根据基金托管人主要人员情况的变化,对基金托管人主要人员信息进行了更新
(2)以截至2018年9月末数据,更新了基金托管人基本情况信息和证券投资基金托管信息
(3)根据基金托管人内部控制制度及措施内容的变化,更新了基金托管人内部控制及措施
4、“五、相关服务机构”部分
(1)根据基金销售机构情况的变化,更新了基金代销机构基本情况信息
5、“九、基金的投资”部分
(1)更新了基金投资组合报告,报告所载数据截至2018年9月30日
6、“十、基金的业绩”部分
(1)更新了基金业绩表现数据,基金业绩表现数据截至2018年9月30日
7、“二十二、其他应披露事项”部分
(1)更新了影响投资者决策的其他重要信息
(2)更新了2018年6月7日至2018年12月7日期间涉及本基金及基金管理人的相关公告

红塔红土基金管理有限公司
2019年1月14日