富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

【2016】第一季度报告

基金管理人:富安达基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22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2016年4月20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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达策略精选混合
基金主代码	710002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年4月25日
报告期末基金份额总额	106,972,404.20份
投资目标	本基金紧跟中国经济发展趋势,在充分控制风险的前提下,通过投资具有持续增长潜力且具有合理估值的上市公司,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上,采用自上而下的富安达多维经济模型,运用定性与定量分析方法,通过对全球经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析,结合FED模型,判断和预测经济发展周期及趋势,综合比较大类资产的收益及风险情况,确定债券、股票、现金等大类资产配置比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,属于较高风险、较高收益产品。一般情况,其风险和收益高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	富安达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-2,667,915.62
2.本期利润	-1,590,477.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0148
4.期末基金资产净值	199,169,804.27
5.期末基金份额净值	1.8619

注:①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。
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。

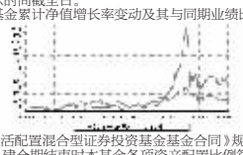
3.2 基金净值表现

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

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	-1.05%	2.13%	-6.84%	1.33%	5.79%	0.80%

注:①本基金业绩比较基准为:55%×沪深300指数+45%×上证国债指数,
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:
Return t =55%×[沪深300指数t / 沪深300指数(t-1)-1]+45%×[上证国债指数t / 上证国债指数(t-1)-1]
Benchmark t =(1+Return t)×Benchmark(t-1)
其中,t =1,2,3,…T,T 表示时间截至日。

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:根据《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》规定,本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2012年10月24日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

§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		
毛矛	本基金的基金经理、富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金基金经理、公司研究发展部高级行业研究员	2015年5月12日	-	10年	历任中华资源(香港)有限公司交易员;易唯思商务咨询有限公司投资分析师;光大保德信基金管理有限公司行业研究员;富安达基金管理有限公司高级行业研究员兼基金经理助理,硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍

注:1、基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日;担任新成立基金的基金经理,即基金的首任基金经理,其任职日期为基金合同生效日,其离职日期为公司作出决定后正式对外公告之日;
2、证券从业的含义遵从行业协会关于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
本基金管理人在本报告期内严格遵守《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》及其各项实施准则、《富安达策略精选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,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》,并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系,涵盖了所有投资组合,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节,确保公平对待旗下的每一个投资组合。
本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。
从管理人旗下第二个投资组合成立之日起,监察稽核部定期对各基金公平交易执行情况进行了统计分析,按照特定计算周期,分1日、3日、5日和10日时间窗分析同向交易中存在价格差异的样本。通过对各投资组合间以及单个组合与组合类别间的公平交易结果分析,在特定时间窗内交易证券的溢价率和溢价金额均在正常范围内,因此不构成潜在利益输送的显著性。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内,本基金不存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
一季度市场下跌幅度较大,沪深300跌幅近14%、创业板指下跌17.5%;资产配置方面,我们在年初、市场下跌初期降低了股票仓位,虽然四次熔断导致我们降仓的

幅度受到了限制,但总体来看已经达到了控制系统性风险的作用;权益类配置方面,我们降低了高贝塔的中小盘股仓位,同时在1月下半月的下跌未期加仓了我们认为行业景气处于上升期的个股,取得了较好的收益;固定收益类的配置方面,我们认为目前的债券市场并未充分反应通胀回升的风险,因此配置以短久期的品种为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截止2016年3月31日,本基金份额净值为1.8619元,本报告期份额净值增长率为-1.05%,同期业绩比较基准增长率为-6.84%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
无

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
从2016年的宏观环境来看,受益于地产的持续热销,经济增速有可能出现止跌回稳的迹象,但整体回升的幅度不会太大。从证券市场来看,经历了从2015年6月股灾以来的几轮下跌,市场的整体估值水平已经有了较大幅度的回落,虽然整体来看并不能算便宜,但部分公司已经进入估值合理甚至偏低的区间,具有一定的投资价值。中期来看,我们认为证券市场面对的主要风险仍是汇率和通胀;人民币的币值仍处于偏高估的水平,同时我国的大类资产价格也偏高,如何调整汇率的同时不导致短期剧烈的资本外流是政府的一个难题;此外,今年以来通胀已经进入了同升通道,肉菜价格以及部分大宗商品的价格出现了显著上涨,后期有可能导致流动性收紧的预期出现并进一步影响证券市场。总体来看,16年后期的市场风险与机遇并存,我们会尽力发掘价值,为持有人创造超额回报。

§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	148,516,249.48	71.04
	其中:股票	148,516,249.48	71.04
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	38,000,000.00	18.18
	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	20,865,054.07	9.98
8	其他资产	1,678,829.84	0.80
9	合计	209,060,133.39	100.00

注:由于四舍五入的原因,各比例的分项与合计可能有尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	22,625,408.66	11.36
B	采矿业	2,465,600.00	1.24
C	制造业	94,438,801.06	47.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,756,019.74	3.89
F	批发和零售业	8,407,998.00	4.22
G	交通运输、仓储和邮政业	1,236,600.00	0.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,474,430.00	2.25
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,736,166.68	0.87
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	2,244,405.34	1.13
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	3,130,820.00	1.57
S	综合	-	-
	合计	148,516,249.48	74.57

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	002299	圣农发展	520,894	14,006,839.66	7.03
2	002714	牧原股份	114,000	7,109,040.00	3.57
3	000418	小天鹅A	184,935	4,688,102.25	2.35
4	600261	阳光照明	556,900	4,494,183.00	2.26
5	002534	杭锅股份	225,000	3,584,250.00	1.80
6	002007	华兰生物	80,243	3,561,986.77	1.79
7	000651	格力电器	175,000	3,363,500.00	1.69
8	300144	宋城演艺	107,000	3,130,820.00	1.57
9	002051	中工国际	135,000	3,090,150.00	1.55
10	000403	ST生化	105,400	2,992,306.00	1.50

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
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
本基金本报告期末未持有债券。
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
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
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
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 报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、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库。
5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	187,412.88
2	应收证券清算款	1,364,068.44
3	应收股利	-
4	应收利息	13,615.92
5	应收申购款	113,732.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,678,829.84

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002714	牧原股份	7,109,040.00	3.57	筹划非公开发行股票事项
2	000651	格力电器	3,363,500.00	1.69	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	106,101,405.86
报告期期间基金总申购份额	10,268,765.55
减:报告期期间基金总赎回份额	9,397,767.21
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	106,972,404.20

§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

报告期期初管理人持有的本基金份额	16,364,372.37
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	16,364,372.37
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	15.30

注:本报告期内,基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况,不存在利益冲突、显失公平的关联交易的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内不存在基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

2016-01-04富安达基金管理有限公司关于2016年1月4日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告
2016-01-04富安达基金管理有限公司2015年12月31日基金净值公告
2016-01-07富安达基金管理有限公司关于2016年1月7日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告
2016-01-20富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金2015年第4季度报告
2016-01-22富安达基金管理有限公司关于收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告
2016-02-04富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加大泰金石投资管理有限公司为代销机构及参与其费率优惠活动的公告
2016-03-08富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海凯石财富基金销售有限责任公司为代销机构及开通定投并参与其费率优惠活动的公告
2016-03-17富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加平安证券有限责任公司为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2016-03-26富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠的公告
2016-03-26富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告摘要
2016-03-26富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
中国证监会批准富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》
基金管理人业务资格批件和营业执照
基金托管人业务资格批件和营业执照
报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告
中国证监会要求的其他文件
9.2 存放地点
上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所,供公众查阅、复制。
9.3 查阅方式
投资者可免费查阅,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件,投资者还可在本基金管理人网站(www.fadfunds.com)查阅。

富安达基金管理有限公司
二〇一六年四月二十二日

红塔红土盛金新动力灵活配置混合型证券投资基金

【2016】第一季度报告

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:2016年4月22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2016年4月20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2016年1月01日起至2016年3月31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	1,142,197,368.71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	100,632,401.63份	1,041,564,967.08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(2016年1月1日-2016年3月31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	504,916.66	4,237,285.42
2. 本期利润	352,751.90	2,768,715.25
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0035	0.0027
4. 期末基金资产净值	106,060,639.62	1,024,056,739.64
5. 期末基金份额净值	1.0539	0.9832

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。

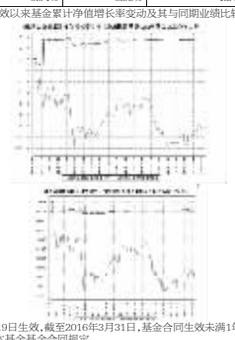
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
红塔红土盛金新动力混合A

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	0.33%	0.05%	-6.95%	1.34%	7.28%	-1.29%

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	0.28%	0.04%	-6.95%	1.34%	7.23%	-1.30%

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:本基金的基金合同于2015年6月19日生效,截至2016年3月31日,基金合同生效未满1年。
报告期末本基金资产配置比例符合本基金基金合同规定。

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		
赵耀	基金经理	2015年6月19日	-	12	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)。

注:1、上述基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日;担任新成立基金的基金经理,即基金的首任基金经理,其任职日期为基金合同生效日,其离职日期为公司作出决定后正式对外公告之日;
2、证券从业的含义遵从行业协会关于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
一季度本基金取得小幅正收益,这得益于基金采取了较为灌辆的投资策略,在年初时基金仓位较低,同时在市场过度悲观的时候对看好的优质成长股进行了加仓,正收益得益于择时收益和优质成长股较好的表现。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截止报告期末,本基金份额净值 1.144 元。本报告期,基金份额净值增长率为 2.47%,同期业绩比较基准收益率为 -6.95%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
-

§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)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	35,401,353.61	3.11
	其中:股票	35,401,353.61	3.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	304,311,000.00	26.75
	其中:债券	304,311,000.00	26.75
	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	335,001,775.00	29.45
	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	454,348,704.37	39.94
8	其他资产	8,553,598.66	0.75
9	合计	1,137,616,431.64	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	9,970,922.18	0.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,035,000.00	0.09
E	建筑业	201,618.28	0.02
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	2,424,960.25	0.21
J	金融业	21,768,852.90	1.93
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	35,401,353.61	3.13

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
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	000001	平安银行	1,000,000	10,640,000.00	0.94
2	601939	建设银行	1,373,114	6,659,602.90	0.59
3	601398	工商银行	800,000	3,432,000.00	0.30
4	002563	森马服饰	200,000	2,200,000.00	0.19
5	600703	三安光电	80,000	1,572,800.00	0.14
6	000858	五粮液	50,000	1,405,500.00	0.12
7	603508	思维列控	14,605	1,256,760.25	0.11
8	300017	网宿科技	20,000	1,168,200.00	0.10
9	002008	大族激光	50,000	1,112,500.00	0.10
10	600886	国投电力	150,000	1,035,000.00	0.09

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,229,000.00	5.33
	其中:政策性金融债	60,229,000.00	5.33
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	191,497,000.00	16.94
6	中期票据	51,916,000.00	4.59
7	可转债(可交换债)	669,000.00	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	304,311,000.00	26.93

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	041558027	15苏通桥CP001	600,000	60,594,000.00	5.36
2	130228	13国开28	500,000	50,225,000.00	4.44
3	011599440	15广州港股SCP002	300,000	30,150,000.00	2.67
4	041558026	15赤湾港CP001	200,000	20,200,000.00	1.79
5	1382037	13杭交投MTN1	100,000	10,528,000.00	0.93

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持有股指期货。
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除五粮液(000858)、13吉高速MTN1(1382065)与15国电南自CP001(041552025)外,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。
宜宾五粮液股份有限公司于2015年6月3日发布《宜宾五粮液股份有限公司关于高管违规减持公司股票的公告》,公告称公司于2015年6月1日收到深圳证券交易所《关于对宜宾五粮液股份有限公司的监管函》以及四川证监局《关于高管减持股票相关事项的关注函》,公司副总经理叶伟泉先生于2015年4月22日违规减持其持有的16,000股公司股票。公司已对叶伟泉先生违规减持股票的行为进行了严肃的批评教育,并责成其进行书面检讨。公司于2015年5月4日向深圳证券交易所公司监管员汇报了此事项的相关情况;叶伟泉先生于2015年5月9日专程到四川证监局说明相关情况。公司董事会将此事件通报全体董事、监事和高级管理人员,要求立即开展证券账户自查,并加强教育监督。
吉林省高速公路集团有限公司于2015年4月2日发布《吉林省高速公路集团有限公司关于董事长接受组织调查的公告》,吉林省高速公路集团有限公司(以下简称"本公司")通过吉林省纪委网站获悉:本公司董事长韩增义涉嫌严重违纪,正接受组织调查。目前,公司生产经营情况正常。
国电南京自动化股份有限公司于2015年11月16日收到中国证监会江苏监管局下达的《关于对国电南京自动化股份有限公司采取出具警示函措施的决定》([2015]20号),对公司无偿拆借资金给控股股东使用、与控股股东的非经营性资金往来发生额披露不准确、经营管理独立性存在缺陷等问题采取出具监管警示函的监管措施,并计入证券期货市场诚信档案。公司于2015年12月12日发布《国电南京自动化股份有限公司关于江苏证监局行政监管措施决定书相关问题的整改报告》,对决定书中提出的问题逐项制定具体的整改措施、责任人和完成时间。
5.11.2 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	63,604.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,489,993.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,553,598.66

5.11.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:报告期内,本基金所持可转换债券均不处于转股期。
5.11.4 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。
5.11.5 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	100,909,486.05	1,046,680,204.47
报告期期间基金总申购份额	-	1,147.57
减:报告期期间基金总赎回份额	277,084.42	5,116,384.96
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	100,632,401.63	1,041,564,967.08

§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

报告期期初管理人持有的本基金份额	20,316,944.33
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	20,316,944.33
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.78

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