

# 信息披露 Disclosure

## 红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金

### [2016] 第四季度报告

基金管理人:红塔红土基金管理有限公司

基金托管人:平安银行股份有限公司

报告送出日期:2017年1月20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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、持有人信息等数据，确认本报告的内容与基金实际情况相符。

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及其摘要。

本报告期内基金利润总额为-1,043,564.00元，其中：本期利润-1,043,564.00元，期末可供分配利润-1,043,564.00元。

本报告期内基金份额总额106,581,268.92份，期末基金份额净值1.00元。

§ 2 基金产品概况

基金简称 红塔红土盛世普益灵活配置发起式

场内简称 -

交易代码 000743

前端交易代码 -

后端交易代码 -

基金份额总额 106,581,268.92

基金成立日期 2014年9月18日

基金合同生效日 2014年9月18日

报告期末基金份额总额 107,562,778.16份

投资目标 本基金采用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，追求超越业绩基准的稳定回报。

投资策略 本基金将主要通过量化模型，结合Alpha-对冲模型（MTM）进行大类资产配置。在股票投资方面，主要依靠量化模型对上市公司的行业属性、估值水平、盈利能力、成长性等要素进行综合评判，筛选出基本面优秀的上市公司，同时利用对冲机制降低组合的系统性风险，从而实现超额收益。

业绩比较基准 上证综指×60%+中债国债指数×40%

风险收益特征 本基金属于风险收益中等的基金，风险收益水平高于货币市场基金，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 平安银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标/基金净值表现

(单位:人民币元)

报告期(2016年10月1日 - 2016年12月31日)

1.本期已实现收益 -1,043,564.00

2.本期利润 -3,079,318.00

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0354

4.期末基金资产净值 218,344,720.18

5.期末基金份额净值 1.00

6.期末可供分配基金份额利润 1.00

7.期末基金资产净值 218,344,720.18

8.期末基金份额净值 1.00

9.期末基金份额总额 107,562,778.16份

10.期末基金资产总值 218,344,720.18元

11.上证综指 ×60% + 中债国债指数 ×40% = 1.00

12.本期基金份额变动率 -0.43%

13.期末基金份额净值 1.00

14.报告期净值增长率 -0.43%

15.报告期净值增长率标准差 0.03%

16.报告期净值增长率相对标准差 0.10%

17.报告期净值增长率偏离度 -0.53%

18.报告期净值增长率偏离度标准差 -0.08%

19.报告期净值增长率偏离度绝对值 0.43%

20.报告期净值增长率偏离度绝对值标准差 0.08%

21.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

22.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

23.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

24.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

25.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

26.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

27.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

28.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

29.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

30.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

31.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

32.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

33.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

34.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

35.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

36.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

37.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

38.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

39.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

40.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

41.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

42.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

43.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

44.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

45.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

46.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

47.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

48.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

49.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

50.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

51.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

52.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

53.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

54.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

55.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

56.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

57.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

58.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

59.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

60.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

61.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

62.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

63.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

64.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

65.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

66.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

67.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

68.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

69.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

70.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

71.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

72.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

73.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

74.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

75.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

76.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

77.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

78.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

79.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

80.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

81.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

82.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

83.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

84.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

85.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

86.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

87.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

88.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

89.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

90.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

91.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

92.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

93.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

94.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

95.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

96.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

97.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

98.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

99.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

100.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

101.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

102.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

103.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

104.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

105.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

106.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

107.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

108.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

109.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

110.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

111.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

112.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%

113.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.10%

114.报告期净值增长率偏离度绝对值相对标准差 0.08%</