红塔红土长益定期开放债券型证券投资基金

【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:渤海银行股份有限公司
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。

基金托管人渤海银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年1月17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10月26日起至2016年12月31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	255,770,250.18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
基金保证人	-
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	235,534,025.05份 / 20,236,225.13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10月26日 - 2016年12月31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	1,425,490.06	107,964.16
2. 本期利润	-4,405,462.66	-392,823.89
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0187	-0.0194
4. 期末基金资产净值	231,128,562.39	19,843,401.24
5. 期末基金份额净值	0.9813	0.9806

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	-1.87%	0.15%	-2.47%	0.23%	0.60%	-0.08%

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	-1.94%	0.15%	-2.47%	0.23%	0.53%	-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

注:本基金的基金合同于2016年10月26日生效,截至2016年12月31日,基金合同生效未满1年。

本基金建仓期自2016年10月26日至2017年4月6日。报告期末基金尚未完成建仓。

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10月26日	-	4	澳洲新南威尔士大学会计学硕士,北京大学理学学士,具有四年医药/传媒等行业研究经验,2012年加入红塔红土基金研究部,现任职于红塔红土基金管理有限公司投资部。

注:1.本基金合同生效起至目前披露时点不满一年;此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日;

2.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。

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

本基金在四季度保持稳健的投资风格,大类资产配置方面,以债券等固定收益资产为主要投资标的,并采用一级市场申购与二级市场投资相结合的策略以增强收益,四季度债券市场出现了较大幅度的调整,但由于新动力基金债券组合在久期上已经大幅缩短,因此整体来说受损较小。在未来的投资上我们将继续采用稳健的投资策略,在通过固定收益积累收益的前提下,寻找权益资产的投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金A级份额净值1.0684元,C级份额净值0.9962元。本报告期A级基金份额净值增长率为-0.26%,同期业绩比较基准收益率为0.10%;C级基金份额净值增长率为-0.18%,同期业绩比较基准收益率为0.10%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金已连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。报告期内未出现基金资产净值低于五千万的情形。基金管理人已持续关注并拟采取适当措施。

§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	8,547,625.23	6.66
	其中:股票	8,547,625.23	6.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	82,778,826.40	64.50
	其中:债券	82,778,826.40	64.50
	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	30,000,165.00	23.38
	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	5,191,837.16	4.05
8	其他资产	1,813,029.35	1.41
9	合计	128,331,483.14	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

序号	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	3,566,900.00	1.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	551,400.00	0.22
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	756,360.00	0.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,072,200.00	0.43
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,241,500.00	0.49
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	1,051,200.00	0.42
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	8,239,560.00	3.28

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港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	300017	网宿科技	20,000	1,072,200.00	0.43
2	300070	碧水源	60,000	1,051,200.00	0.42
3	600584	长电科技	50,000	882,500.00	0.35
4	300207	欣旺达	60,000	834,000.00	0.33
5	002563	森马服饰	80,000	821,600.00	0.33
6	002146	荣盛发展	100,000	785,000.00	0.31
7	002236	大华股份	50,000	684,000.00	0.27
8	600068	葛洲坝	60,000	551,400.00	0.22
9	002627	宜昌交运	20,000	494,800.00	0.20
10	600048	保利地产	50,000	456,500.00	0.18

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	161,420,000.00	64.32
5	企业短期融资券	10,059,000.00	4.01
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,979,200.00	0.79
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	173,458,200.00	69.11

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	1580116	15新余城水债	200,000	21,054,000.00	8.39
2	139063	16温港城	200,000	20,414,000.00	8.13
3	127370	16奥德01	200,000	20,344,000.00	8.11
4	122478	14粤运01	200,000	20,126,000.00	8.02
5	1580314	15仁寿债	200,000	20,092,000.00	8.01

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持有国债期货。

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	53,064.91
2	应收证券清算款	1,792.78
3	应收股利	-
4	应收利息	4,423,861.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,478,718.93

5.10.4 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。

5.10.5 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
基金合同生效日(2016年10月26日)基金份额总额	235,534,025.05	20,236,225.13
报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	235,534,025.05	20,236,225.13

§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

红塔红土长益定期开放债券A

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	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
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

红塔红土长益定期开放债券C

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	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
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	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

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
2017年1月20日

红塔红土人人宝货币市场基金

【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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年1月17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10月1日起至2016年12月31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	177,628,732.72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	8,330,807.01份 / 169,297,925.71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(2016年10月1日 - 2016年12月31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	40,075.71	921,078.77
2. 本期利润	40,075.71	921,078.77
3. 期末基金资产净值	8,330,807.01	169,297,925.71

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	0.5807%	0.0015%	0.3456%	0.0000%	0.2351%	0.0015%

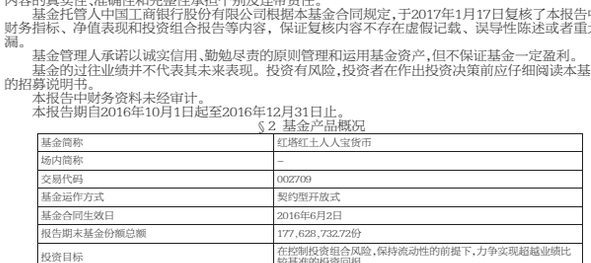
注:本基金收益分配按日结转份额。

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	0.6413%	0.0015%	0.3456%	0.0000%	0.2957%	0.0015%

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



注:本基金的基金合同于2016年6月2日生效,截至2016年12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。

§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	2016年6月2日	-	13	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13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。
罗薇	基金经理	2016年6月21日	-	4	澳洲新南威尔士大学会计学硕士,北京大学理学学士,具有四年医药/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。

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》、《红塔红土基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。

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

截止报告期末,本基金A级份额净值0.5807%,业绩比较基准收益率0.3456%;B级份额净值收益率为0.6413%,业绩比较基准收益率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	33,493,954.21	18.84
	其中:债券	33,493,954.21	18.84
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	67,010,554.72	37.69
	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	76,782,423.91	43.19
4	其他资产	500,054.74	0.28
5	合计	177,786,987.58	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		0.01
	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	82
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	106
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	75

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	40.42	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	5.63	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	19.14	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	8.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	26.18	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.81	-

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	4,998,677.48	2.81
	其中:政策性金融债	4,998,677.48	2.81
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	28,495,276.73	16.04
8	其他	-	-
9	合计	33,493,954.21	18.86
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	111621071	16渤海银行CD071	190,000	18,681,003.92	10.52
2	111611360	16平安CD360	100,000	9,814,272.81	5.53
3	160209	16国开09	50,000	4,998,677.48	2.81

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	-
报告期内偏离度的最高值	-0.0014%
报告期内偏离度的最低值	-0.2415%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0837%

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	2,567.50
3	应收利息	448,630.91
4	应收申购款	48,856.33
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	500,054.74

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	7,226,738.75	167,976,041.72
报告期期间基金总申购份额	3,003,835.52	65,821,897.99
报告期期间基金总赎回份额	1,899,767.26	64,500,014.00
报告期期末基金份额总额	8,330,807.01	169,297,925.71

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	申购	2016年12月22日	10,000,000.00	10,000,000.00	-
2	赎回	2016年10月11日	-20,000,000.00	-20,000,000.00	-
3	赎回	2016年12月29日	-20,000,000.00	-20,000,000.00	-
4	红利再投	2016年12月30日	248,665.82	248,665.82	-
合计			-	-	

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

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
2017年1月20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:中国光大银行股份有限公司
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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2017年01月17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10月01日起至2016年12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	111,081,691.98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	100,519,655.73份 / 10,562,036.25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10月1日 - 2016年12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	330,072.48	1,078,763.88
2. 本期利润	-285,372.24	707,167.07
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0028	0.0013
4. 期末基金资产净值	107,390,905.48	10,522,184.41
5. 期末基金份额净值	1.0684	0.9962

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