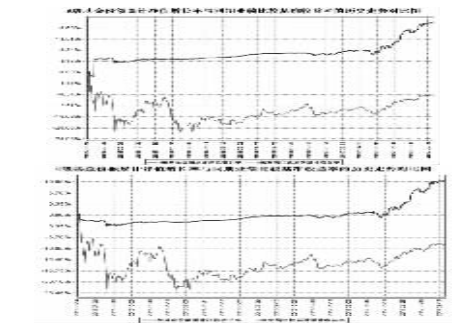


红塔红土盛金新动力灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告



以及不同时间窗口(同日内、3日内、5日内)同向交易的交易价格未发生异常差异,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
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人内部控制管理办法》,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。确保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,需经风险管理部审批并留痕。

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公开竞价同日反向交易,成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%,本基金未发生可能導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
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人内部控制管理办法》,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。确保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,需经风险管理部审批并留痕。

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公开竞价同日反向交易,成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的5%,本基金未发生可能導致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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 1.0186 元,本报告期基金份额净值增长率为 6.42%;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 1.0177 元,本报告期基金份额净值增长率为 6.35%;同期业绩比较基准收益率为 7.20%。

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人或者基金资产净值低于五千万元情形。

5.1 报告期末基金资产组合情况
注:无

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 股,科技,通信 - -

B 股 - -

C 制造业 344,199.38 0.30

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 986,100.00 0.88

F 批发和零售业 26,365.45 0.02

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息技术、软件和信息技术服务业 17,468.03 0.02

J 金融业 - -

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 医药生物、医药和器械制造业 - -

P 教育、文化和体育 - -

Q 互联网和相关服务 - -

R 文化、体育和娱乐业 31,224.45 0.03

S 综合 - -

合计 1,405,377.31 1.24

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:本基金本报告期末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 600086 嘉微斯 95,000 986,100.00 0.87

2 601016 恒顺达 2,786 84,025.76 0.07

3 603055 华信新材 2,656 62,489.58 0.06

4 603367 恒顺达 3,315 55,666.85 0.05

5 603151 恒顺达 2,150 38,119.50 0.03

6 603278 恒顺达 1,626 33,367.02 0.03

7 603103 鼎泰新材 2,021 31,224.45 0.03

8 603963 大博医疗 999 29,140.83 0.03

9 601086 国寿安保 5,769 26,365.45 0.02

10 603303 鼎泰新材 2,486 22,846.34 0.02

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 国债债券 - -

2 央行票据 - -

3 金融债券 9,980,000.00 8.84

其中:政策性金融债 9,980,000.00 8.84

4 企业债券 - -

5 企业短期融资券 - -

6 中期票据 - -

7 可转换(可交换) - -

8 同业存单 - -

9 其他 - -

10 合计 68,091,000.00 60.29

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唐01 100,000 10,049,000.00 8.80

2 170004 17唐04 100,000 9,980,000.00 8.84

3 11169427 16唐02 100,000 9,965,000.00 8.88

4 11179436 17唐01 100,000 9,666,000.00 8.56

5 111714034 17唐03 100,000 9,575,000.00 8.46

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
注:本基金本报告期未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注
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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.12 报告期内,本基金的前十名股票未出现基金合同约定的备选股票库。

5.13 其他资产构成

序号 项目 金额(元)

1 应收货币资金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 3,829,227.31

5 应收申购款 -

6 其他 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 1,678,813.12

5.14 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,本基金所持待转换债券均不处于转股期。

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:报告期内,本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.17 投资组合报告附注
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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.18 报告期内,本基金的前十名股票未出现基金合同约定的备选股票库。

5.19 其他资产构成

序号 项目 金额(元)

1 应收货币资金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 3,829,227.31

5 应收申购款 -

6 其他 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 1,678,813.12

5.14 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,本基金所持待转换债券均不处于转股期。

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:报告期内,本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.17 投资组合报告附注
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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.18 报告期内,本基金的前十名股票未出现基金合同约定的备选股票库。

5.19 其他资产构成

序号 项目 金额(元)

1 应收货币资金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 3,829,227.31

5 应收申购款 -

6 其他 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 1,678,813.12

5.14 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,本基金所持待转换债券均不处于转股期。

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:报告期内,本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.17 投资组合报告附注
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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.18 报告期内,本基金的前十名股票未出现基金合同约定的备选股票库。

5.19 其他资产构成

序号 项目 金额(元)

1 应收货币资金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 3,829,227.31

5 应收申购款 -

6 其他 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 1,678,813.12

5.14 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,本基金所持待转换债券均不处于转股期。

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:报告期内,本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.17 投资组合报告附注
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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.18 报告期内,本基金的前十名股票未出现基金合同约定的备选股票库。

5.19 其他资产构成

序号 项目 金额(元)

1 应收货币资金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 3,829,227.31

5 应收申购款 -

6 其他 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 1,678,813.12

5.14 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,本基金所持待转换债券均不处于转股期。

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:报告期内,本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.17 投资组合报告附注
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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.18 报告期内,本基金的前十名股票未出现基金合同约定的备选股票库。

5.19 其他资产构成

序号 项目 金额(元)

1 应收货币资金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 3,829,227.31

5 应收申购款 -

6 其他 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 1,678,813.12

5.14 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,本基金所持待转换债券均不处于转股期。

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:报告期内,本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.17 投资组合报告附注
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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.18 报告期内,本基金的前十名股票未出现基金合同约定的备选股票库。

5.19 其他资产构成

序号 项目 金额(元)

1 应收货币资金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 3,829,227.31

5 应收申购款 -

6 其他 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 1,678,813.12

5.14 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,本基金所持待转换债券均不处于转股期。

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:报告期内,本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.17 投资组合报告附注
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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.18 报告期内,本基金的前十名股票未出现基金合同约定的备选股票库。

5.19 其他资产构成

序号 项目 金额(元)

1 应收货币资金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 3,829,227.31

5 应收申购款 -

6 其他 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 1,678,813.12

5.14 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,本基金所持待转换债券均不处于转股期。

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:报告期内,本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.17 投资组合报告附注
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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.18 报告期内,本基金的前十名股票未出现基金合同约定的备选股票库。

5.19 其他资产构成

序号 项目 金额(元)

1 应收货币资金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 3,829,227.31

5 应收申购款 -

6 其他 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 1,678,813.12

5.14 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,本基金所持待转换债券均不处于转股期。

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:报告期内,本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.17 投资组合报告附注
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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.18 报告期内,本基金的前十名股票未出现基金合同约定的备选股票库。

5.19 其他资产构成