

# 红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式 证券投资基金 2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 日

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

送出日期：2016 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料经审计, 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
<b>4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明</b> .....	<b>16</b>
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
8.6 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.....	54

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	55
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贵金属投资明细 .....	55
8.9 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 .....	55
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	55
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
8.12 投资组合报告附注 .....	55
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>56</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	57
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	57
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>57</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>58</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	58
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
11.4 基金投资策略的改变 .....	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
11.8 其他重大事件 .....	59
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>63</b>
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>64</b>
13.1 备查文件目录 .....	64
13.2 存放地点 .....	64
13.3 查阅方式 .....	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	红塔红土盛世普益混合发起式
场内简称	-
基金主代码	000743
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 9 月 18 日
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
报告期末基金份额总额	856,700,529.27 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金利用数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，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。基金管理人在综合考虑经济周期、市场环境、政策预期的基础上，通过大盘趋势预测模型（MTFM）判断当前市场所处时点，配合以择量 Alpha-对冲模型（SAHM）进行大类资产的配置。在股票投资方面，主要依据“股票价格波动-能级弦动模型”，并配合以个股的基本面研究，确定当前的行业与个股配置。债券及其它金融工具投资策略上，则采用市场常用的组合平均久期管理等策略。整体来说，本基金采取“量化分析为主、定性分析为辅”的策略，有效控制组合风险，充分挖掘市场机会。
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。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		红塔红土基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李凌	张波
	联系电话	0755-33379079	0755-22168073
	电子邮箱	liling@htamc.com.cn	ZHANGB0746@pingan.com.cn
客户服务电话		4001-666-916（免长途话费）	95511-3
传真		0755-33379007	0755-82080400-0
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）	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址		深圳市南山区侨香路4068号智慧广场A栋801	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
邮政编码		518052	518001
法定代表人		饶雄	孙建一

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.htamc.com.cn">http://www.htamc.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
注册登记机构	红塔红土基金管理有限公司	深圳市南山区侨香路4068号智慧广场A栋801

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014年9月18日(基金合同生效日)-2014年12月31	2013 年
---------------	--------	--------------------------------	--------

		日	
本期已实现收益	77,625,062.91	2,972,864.19	-
本期利润	118,318,646.68	2,656,990.33	-
加权平均基金份额本期利润	0.0740	0.0224	-
本期加权平均净值利润率	6.46%	2.22%	-
本期基金份额净值增长率	14.94%	2.40%	-
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2015 年末</b>	<b>2014 年末</b>	<b>2013 年末</b>
期末可供分配利润	84,544,247.91	2,264,634.48	-
期末可供分配基金份额利润	0.0987	0.0240	-
期末基金资产净值	1,008,075,489.07	96,618,658.75	-
期末基金份额净值	1.177	1.024	-
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2015 年末</b>	<b>2014 年末</b>	<b>2013 年末</b>
基金份额累计净值增长率	17.70%	2.40%	-

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、本期已实现收益是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；

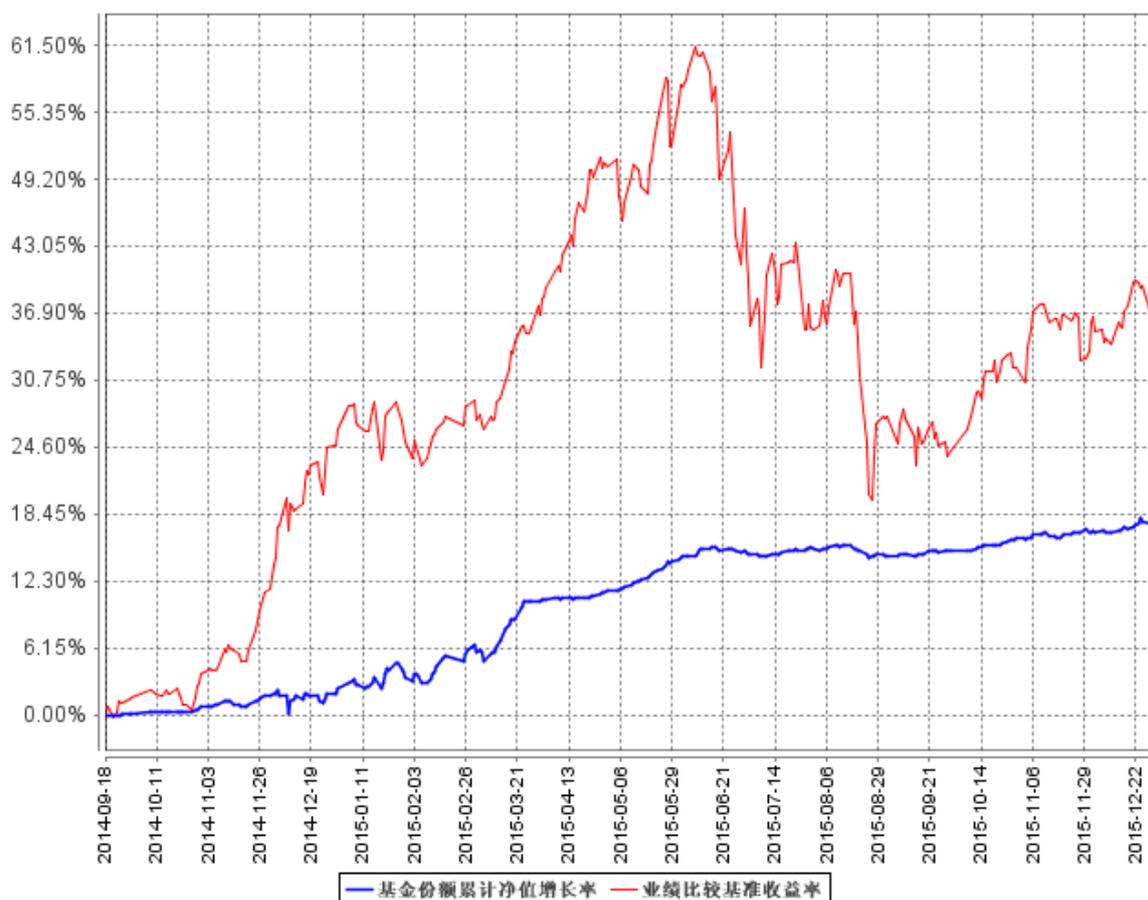
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	2.35%	0.13%	10.50%	0.91%	-8.15%	-0.78%
过去六个月	2.35%	0.12%	-6.32%	1.47%	8.67%	-1.35%
过去一年	14.94%	0.24%	8.72%	1.37%	6.22%	-1.13%
自基金合同生效起至今	17.70%	0.25%	37.32%	1.28%	-19.62%	-1.03%

### 3.2.2 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

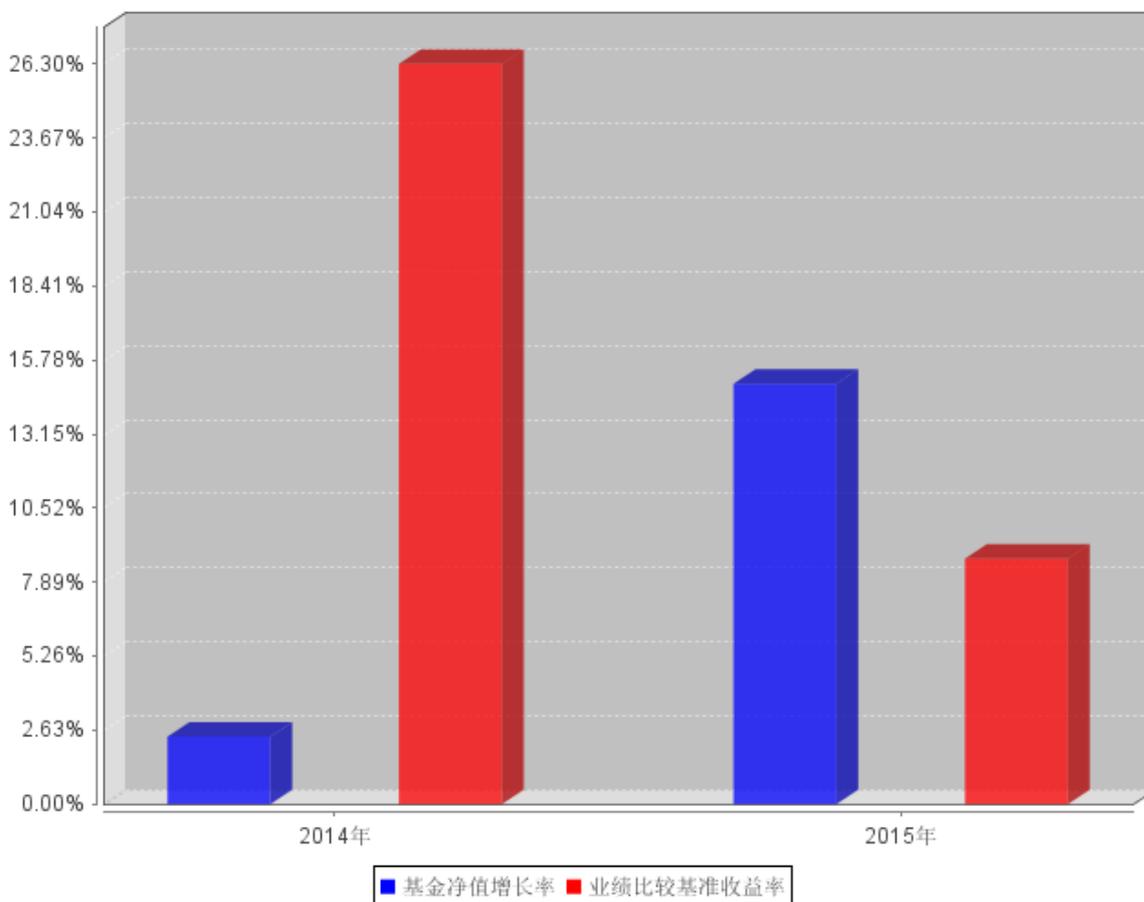
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：股票资产占基金资产的比例范围为 0%–95%；债券等固定收益资产占基金资产的比例不低于 5%；基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；基金保留的现金，或到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：至报告期末未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为红塔红土基金管理有限公司（简称“公司”），经中国证券监督管理委员会批准，于 2012 年 6 月 12 日在深圳前海正式注册成立，注册资本 2 亿元人民币。其中，红塔证券股份有限公司出资比例为 49%，深圳市创新投资集团有限公司出资比例为 26%，北京市华远集团有限

公司出资比例为 25%。公司业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理及中国证监会许可的其他业务。

作为一家为客户提供专业投资服务的资产管理机构，公司将坚持价值投资理念，以专业服务回馈社会，建立并不断完善投研一体化平台，坚持把基金持有人利益放在首位，努力实现基金持有人资产增值。同时，重视投资的风险控制，建立起一套全面完善的风险管理体系，以风险预算为基础，合法合规运作为前提，将风险控制贯穿于整个投资运作的全过程，进而实现专业组合投资。截止 2015 年 12 月 31 日，公司有员工 30 人，其中 17 人具有硕士或博士学位；截止 2015 年 12 月 31 日，公司管理 3 只证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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5月6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）。近12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。
季雷	-	2014 年 9 月 18 日	2015 年 5 月 21 日	13	比立勤国立大学工商管理博士、同济大学工商管理硕士、复旦大学物理学学士，13 年证券基金从业经历。历任东北证券行业公司部经理；东方基金公司研究部副经理、基金经理助理、研究部经理、基金经理兼金融工程部经理；华富基金产品设计经理、华富策略精选基金经理、华富价值增长基金经理、金融工程负责人；红塔红土基金管理有限公司投资部基金经理，公司投资决策委员会委

					员。
--	--	--	--	--	----

注：1、证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；

2、本基金无基金经理助理。

## 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投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规，以及《红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》、招募说明书等有关基金法律文件的规定，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规，制定了《红塔红土基金管理有限公司公平交易管理办法》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。为确保交易的公平执行，公司交易管理实行集中交易制度，将公司所有投资组合的投资决策过程和交易执行过程分开，各投资组合的所有证券买卖活动须通过集中交易室集中统一完成。该公平交易管理方法规范的范围涵盖一级市场分销、二级市场交易和公司内部证券分配等所有投资管理活动；以及研究、授权、决策和执行等投资管理活动的各个环节。

公司建立研究管理平台向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独立、自主、审慎决策，超过投资权限的操作需要经过严格的逐级审批程序。基金经理不得兼任投资经理，且各投资组合的基金经理、投资经理投资系统权限要严格分离。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模块，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。对于银行间市场交易、交易所大宗交易、非公开发行股票申购、债券一级市场申购等非集中竞价交易，涉及到两个或以上投资组合参与同一证券交易的情况，各投资组合经理在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。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在交易所公开竞价交易中的同日同向、临近交易日同向、反向交易记录，进行交易时机和交易价差的专项统计分析，以排查异常交易。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年股票市场波动非常大，上半年指数的大幅上涨和下半年突然的大幅下跌使得基金的投资操作难度加大；而债券市场整年基本都处于慢牛行情当中，使得固定收益投资全年有较好的投

资收益。

红塔红土盛世普益基金作为红塔红土基金的第一只基金，成立以来一直采用稳健的投资策略，在以稳健为基础的操作思路下，基金份额净值表现稳定。在大类资产的配置上，一季度加仓股票分享股市场上行的收益之后，针对二季度开始的股票上行过快市场风险增加的局面，基金的投资策略再度转为谨慎，通过加仓债券和采用打新策略等稳健的投资策略来增加组合的收益，从而使得虽然错过了 5-6 月份股市的非理性大涨，但使得基金在随之而来的下半年的下跌中净值仍保持增长。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值 1.177 元。本报告期基金份额净值增长率为 14.94%，同期业绩比较基准收益率为 8.72%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 是“十三五”开局之年，然而中国经济所面对的内部压力与外部挑战与过去相比却有增无减，这使得 2016 年充满了未知与不确定性，不论是美联储加息给全球新兴市场带来的压力还是我国经济信用风险的暴露，都给资本市场增添扰动因素。为了应对 2016 年所面临的考验，在 12 月召开的年度经济会议中提出了 2016 年的经济工作五大任务：去产能、去杠杆、去库存、降成本、补短板，提出了供给侧改革和需求端并举的工作重心。从实际内容来看，其本质是在保持经济一定增速，不发生系统性风险的前提下进行经济结构性改革。在这样的背景下，预示着经济虽然下行压力较大，但仍然有底线，会保持一个适中速度的合理增长，而在经济有所好转时，供给侧的改革则可能加速，为未来经济的增长提供内生动力。在最新的政府工作报告中，2016 年的经济增长目标在 6.5%-7%，经济增长的底线在 6.5%；CPI 上限为 3%；并自 2010 年以来首次提高 M2 增速为 13%，并增加了社会融资总量的目标为增长 13%；积极的财政政策进一步加大，今年的预算赤字率目标从去年的 2.3%上调到 3%，整体来看稳增长力度有所加强，若中国经济能保持 6.5%以上的增速，中国经济将会成为新兴市场中的一盏明灯。

年初 A 股及海外资本市场以及原油等大宗商品的下跌，反应了美元加息对全球经济，特别是新兴经济体的负面影响，但短期内如此巨大的波动也反应了市场投资在面对看不清 2016 年全球经济情况、不确定性增加的情况下情绪因素对市场影响加大。对于中国经济，我们预计在年终会完成 6.5%-7%这个区间的的目标，总理在春节后的讲话也表明了当经济下行压力加大时，政策面仍会有稳经济的支持，以确保在供给项平衡经济结构的时候不发行系统性风险。因此，反应到 A 股 2016 年的投资，面对美元加息以及中国经济增长压力给市场带来的风险现实，我们在投资时将

更加谨慎，严守自己的投资能力边界，但也不必过度恐慌，不要在情绪支配的市场价格大幅波动中迷失了对价值的判断，反而可以稍加利用市场的情绪为投资找到更好的买点和卖点。

债券市场在年初有所回调，我们仍然保持对于债券市场 2016 年走势谨慎的观点，债券市场的收益率经过两年的大幅下行，当前时间段下行的空间有限，而同时面临的上行风险在增长，不论是美元加息的压力还是过度投放货币带来的资产以及食品价格上行的压力，都会导致债券市场收益率的上行。中国经济当前的主要任务还是平衡经济结构，只有当经济下行压力较大时，才会有宽松的货币政策出台，而且总量放松对于结构性改革的作用有限，今年的稳增长可能更多的还需要财政政策发力。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人内部开展的有关本基金的监察稽核工作包括，严格事前的监督审查，通过系统和人工相结合，开展事中监控、事后检查稽核，保障业务运作的合法合规性。监察稽核部对基金募集和持续营销、基金等各受托资产的投资管理、基金信息披露等方面进行事先合规审核，通过投资交易系统预设风控指标阈值对相关投资组合的合规风险实现事前控制，通过公平交易模块对本基金及基金管理人管理的其他投资组合之间的公平交易情况进行每日监控和定期分析，对各投资组合的潜在异常交易进行每日监测和分析；定期、不定期地对本基金投资、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行全面检查，对控制手段提出改进建议和督促业务部门改进存在问题。此外，监察稽核部还根据新出台的法律法规和行业的新要求，督促公司各部门及时制定、更新规章制度和业务流程，有计划、有针对性针对全体员工、投资管理人员及其他相关业务人员进行多种形式的法律合规培训，每当新法规出台时，及时向公司员工发送并对有关新法规的主要条款进行解释或培训，促进公司合规文化的建设。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

(1) 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。

基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基

金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

根据中国证监会的相关规定，本公司针对停牌股票、债券不活跃市场报价等投资品种启用特殊估值流程，由基金估值小组确定相应证券的估值方法。

估值小组成员包括公司领导、运营部门、法律、监察稽核部、研究部等相关人员。

#### (2) 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与公司启用特殊估值的流程，发表相关意见和建议，与运营部门、公司领导、研究部相关人员共同商定估值原则和政策。

#### (3) 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### (4) 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议

的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由红塔红土基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2016）审字第 61014670_H01 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表，2015 年度的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人红塔红土基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控

	制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	乌爱莉
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层	
审计报告日期	2016 年 3 月 27 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	15,842,236.11	17,500,614.92
结算备付金		311,962.67	1,306,659.53
存出保证金		233,739.65	35,153.52
交易性金融资产	7.4.7.2	536,585,546.36	70,597,361.88
其中：股票投资		73,861,443.96	13,025,061.14
基金投资		-	-
债券投资		462,724,102.40	57,572,300.74
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	455,002,952.50	21,000,000.00
应收证券清算款		388,805.88	-
应收利息	7.4.7.5	7,408,445.77	1,596,154.44
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-

资产总计		1,015,773,688.94	112,035,944.29
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年12月31日</b>	<b>上年度末 2014年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,407,392.67	14,991,099.30
应付赎回款		196.35	148,371.14
应付管理人报酬		1,525,016.19	100,908.29
应付托管费		317,711.68	21,022.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	287,882.98	80,512.03
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	160,000.00	75,372.22
负债合计		7,698,199.87	15,417,285.54
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	856,700,529.27	94,354,024.27
未分配利润	7.4.7.10	151,374,959.80	2,264,634.48
所有者权益合计		1,008,075,489.07	96,618,658.75
负债和所有者权益总计		1,015,773,688.94	112,035,944.29

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.177 元，基金份额总额 856,700,529.27 份。

## 7.2 利润表

会计主体：红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年9月18日(基 金合同生效日)至 2014年12月31日
<b>一、收入</b>		146,900,120.04	3,392,090.70
1. 利息收入		53,681,613.64	1,410,807.85
其中：存款利息收入	7.4.7.11	6,929,718.15	226,051.03
债券利息收入		35,552,231.71	678,114.84
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,199,663.78	506,641.98
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		41,017,974.42	2,087,671.38
其中：股票投资收益	7.4.7.12	41,752,353.88	1,581,159.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,023,049.19	506,511.43
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	288,669.73	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	40,693,583.77	-315,873.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	11,506,948.21	209,485.33
<b>减：二、费用</b>		28,581,473.36	735,100.37
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	21,491,113.86	414,866.78
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,477,315.23	86,430.59
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,064,310.64	130,436.45
5. 利息支出		1,263,233.63	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,263,233.63	-
6. 其他费用	7.4.7.20	285,500.00	103,366.55
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		118,318,646.68	2,656,990.33
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		118,318,646.68	2,656,990.33

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	94,354,024.27	2,264,634.48	96,618,658.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	118,318,646.68	118,318,646.68
三、本期基金份额交易产	762,346,505.00	30,791,678.64	793,138,183.64

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	4,146,961,897.32	555,210,692.61	4,702,172,589.93
2. 基金赎回款	-3,384,615,392.32	-524,419,013.97	-3,909,034,406.29
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	856,700,529.27	151,374,959.80	1,008,075,489.07
项目	上年度可比期间 2014年9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	149,004,696.76	-	149,004,696.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,656,990.33	2,656,990.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-54,650,672.49	-392,355.85	-55,043,028.34
其中: 1. 基金申购款	1,248,379.31	14,734.59	1,263,113.90
2. 基金赎回款	-55,899,051.80	-407,090.44	-56,306,142.24
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	94,354,024.27	2,264,634.48	96,618,658.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>刘辉</u>	<u>许艺然</u>	<u>郑希栋</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]658号《关于核准红塔红土盛世

普益灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人红塔红土基金管理有限公司(以下简称“红塔红土基金公司”)向社会公开发行募集，基金合同于 2014 年 9 月 18 日正式生效，首次设立募集规模为 149,004,696.76 份基金份额，其中认购资金利息折合 13,124.13 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为红塔红土基金公司，注册登记机构为红塔红土基金公司，基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%；债券等固定收益资产占基金资产的比例不低于 5%；基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；基金保留的现金，或到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×55%+中债总指数（财富）×45%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票、债券、基金和衍生工具等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

##### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

##### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融

负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

#### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

#### 金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未调整的报价作为公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了

重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

(3) 其他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，由基金托管人从基金财产中支付。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

本基金收益分配应遵循下列原则：

(1) 基金收益分配采用现金或红利再投资方式，投资人可选择获取现金红利，投资人可选择获取现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；基金份额持有人事先未做出选择的，默认分红方式为现金红利；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

(3) 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 在符合上述基金收益分配的前提下，本基金每年收益分配至多六次，每次基金收益分配比例不得低于可供分配利润的 30%；

(5) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(6) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发〔2014〕24 号）的要求，自 2015 年 3 月 27 日起，对基金持有的上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期无需要说明的重大会计差错和更正。

### 7.4.6 税项

#### (1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## (2) 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

## (3) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	15,842,236.11	17,500,614.92
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	15,842,236.11	17,500,614.92

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	32,247,390.64	73,861,443.96	41,614,053.32
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,960,631.44	8,322,102.40
	银行间市场	455,999,814.37	454,402,000.00
	合计	463,960,445.81	462,724,102.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	496,207,836.45	536,585,546.36	40,377,709.91
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	12,657,461.84	13,025,061.14	367,599.30
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,623,574.96	6,942,833.14
	银行间市场	51,632,198.94	50,629,467.60
	合计	58,255,773.90	57,572,300.74
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	70,913,235.74	70,597,361.88	-315,873.86

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末及上年度末均无衍生金融资产/负债。

**7.4.7.4 买入返售金融资产****7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	395,002,952.50	-
交易所市场	60,000,000.00	-
合计	455,002,952.50	-
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	-	-
交易所市场	21,000,000.00	-
合计	21,000,000.00	-

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金于本期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	57,146.80	2,131.16
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	154.44	646.80
应收债券利息	7,113,552.99	1,593,359.10
应收买入返售证券利息	237,475.82	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	115.72	17.38
合计	7,408,445.77	1,596,154.44

注：其他为应收结算保证金利息。

**7.4.7.6 其他资产**

注：本基金于本期末及上年度末均无其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	252,258.68	80,512.03
银行间市场应付交易费用	35,624.30	-
合计	287,882.98	80,512.03

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	372.22
预提审计费	60,000.00	50,000.00
预提信息披露费	100,000.00	25,000.00
合计	160,000.00	75,372.22

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	94,354,024.27	94,354,024.27
本期申购	4,146,961,897.32	4,146,961,897.32
本期赎回（以“-”号填列）	-3,384,615,392.32	-3,384,615,392.32
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	856,700,529.27	856,700,529.27

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,587,307.28	-322,672.80	2,264,634.48
本期利润	77,625,062.91	40,693,583.77	118,318,646.68
本期基金份额交易	4,331,877.72	26,459,800.92	30,791,678.64

产生的变动数			
其中：基金申购款	286,687,417.30	268,523,275.31	555,210,692.61
基金赎回款	-282,355,539.58	-242,063,474.39	-524,419,013.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	84,544,247.91	66,830,711.89	151,374,959.80

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日
活期存款利息收入	2,374,413.19	40,765.38
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	4,358,623.60	178,077.78
结算备付金利息收入	145,083.07	7,147.93
其他	51,598.29	59.94
合计	6,929,718.15	226,051.03

注：其他存款利息收入为基金投资于协议存款产生的利息收入。其他为申购款利息收入及结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日
卖出股票成交总额	355,882,862.72	38,725,780.98
减：卖出股票成本总额	314,130,508.84	37,144,621.03
买卖股票差价收入	41,752,353.88	1,581,159.95

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日
债券投资收益——买卖债券(债转)	-1,023,049.19	506,511.43

股及债券到期兑付) 差价收入		
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-1,023,049.19	506,511.43

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015 年12月31日	上年度可比期间 2014年9月18日(基金合 同生效日)至2014年12月31 日
卖出债券(债转股及债券到期兑付) 成交总额	2,264,052,468.25	35,767,227.50
减：卖出债券(债转股及债券到期 兑付)成本总额	2,216,525,367.45	34,657,453.16
减：应收利息总额	48,550,149.99	603,262.91
买卖债券差价收入	-1,023,049.19	506,511.43

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金于本期及上年度可比期间均无债券投资收益赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金于本期及上年度可比期间均无债券投资收益申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金于本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益**

注：本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	288,669.73	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	288,669.73	-

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日
1. 交易性金融资产	40,693,583.77	-315,873.86
——股票投资	41,246,454.02	367,599.30
——债券投资	-552,870.25	-683,473.16
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	40,693,583.77	-315,873.86

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	11,458,140.39	209,485.33
其他	48,807.82	-
合计	11,506,948.21	209,485.33

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,034,158.14	130,436.45
银行间市场交易费用	30,152.50	-
合计	1,064,310.64	130,436.45

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	50,000.00
信息披露费	200,000.00	50,000.00
账户维护费	25,500.00	-
中登费用	-	2,466.55
其他	-	900.00
合计	285,500.00	103,366.55

#### 7.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

1、本基金于 2016 年 1 月 12 日 对本基金份额持有人按每 10 份基金份额分配人民币 0.6 元进

行分红，其中现金形式发放总额人民币 51,334,816.48 元，再投资形式发放总额人民币 59,154.38 元，实际分配收益为人民币 51,393,970.86 元。

2、除上述事项外，截至本财务报表批准报出日，本基金并无其它需作披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
红塔红土基金公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构、发起人
平安银行	基金托管人、基金销售机构
红塔证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
深圳市红塔资产管理有限公司	基金管理人的子公司
红塔期货有限责任公司	与基金管理人受同一母公司控制的公司
红证利德资本管理有限公司	与基金管理人受同一母公司控制的公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 9 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
红塔证券	117,690,767.62	17.76%	88,472,928.85	100.00%

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 9 月 18 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
红塔证券	28,742,599.33	44.15%	125,645,398.53	100.00%

**7.4.10.1.3 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年9月18日(基金合同生效日)至2014年 12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
红塔证券	92,000,000.00	2.21%	1,146,500,000.00	100.00%

**7.4.10.1.4 权证交易**

注：本基金于本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
红塔证券	110,015.97	17.95%	289.58	0.11%
关联方名称	上年度可比期间 2014年9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
红塔证券	81,200.07	100.00%	80,512.03	100.00%

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年9月18日(基金合同生效日) 至2014年12月31日
当期发生的基金应支付 的管理费	21,491,113.86	414,866.78
其中：支付销售机构的客 户维护费	69,625.75	76,929.06

注：1、基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%年费率计

提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

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

2、于 2015 年 12 月 31 日的应付基金管理费为人民币 1,525,016.19 元。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,477,315.23	86,430.59

注：1、基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2、于 2015 年 12 月 31 日的应付托管费为人民币 317,711.68 元。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金产品无销售服务费。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2014 年 9 月 18 日）持有的基金份额	-	10,000,000.00
期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
期间申购/买入总份额	26,929,084.38	-

期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	36,929,084.38	10,000,000.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	4.31%	10.60%

注：1、基金管理人持有本基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付；

2、根据《红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，发起资金认购本基金的金额不少于人民币 1,000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

2014 年 9 月 18 日（基金合同生效日），红塔红土基金公司运用自有资金作为发起资金认购的本基金份额为 10,000,000.00 份，占本基金发起式份额总量的 10.60%。

#### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例
红塔期货有限责任公司	-	-	10,000,200.00	10.60%
红证利德资本管理有限公司	20,462,929.50	2.39%	9,999,800.00	10.60%

注：其他关联方持有本基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 9 月 18 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行	15,842,236.11	2,374,413.19	17,500,614.92	40,765.38

注：本基金本期的活期银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况****7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

注：本基金于本期未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300436	广生堂	2015年4月16日	2016年4月22日	老股转让	21.47	83.43	94,594	1,015,466.59	7,891,977.42	包含流通受限期内获得的送股数量47,297股
300443	金雷风电	2015年4月16日	2016年4月22日	老股转让	31.94	193.32	65,566	2,094,178.04	12,675,219.12	-
300463	迈克生物	2015年5月21日	2016年5月28日	老股转让	27.96	117.39	233,333	6,523,990.68	27,390,960.87	-

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600271	航天信息	2015年10月12日	重大事项	55.91	-	-	40,000	2,021,861.40	2,236,400.00	-

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金于本期末未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于本期末未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、金融工程小组和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调金融工程小组及其他各部门完成运作风险管理，并进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

截至 2015 年 12 月 31 日止，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基

金资产净值的比例为 40.92%。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本期末及上年度末均未持有短期信用债券。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
AAA	2,008,001.80	2,918,609.30
AAA 以下	410,501,100.60	54,653,691.44
未评级	50,215,000.00	-
合计	462,724,102.40	57,572,300.74

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为债券期限大于一年的政策性金融债。

3、债券投资以净价列示。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过相关部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除批注 7.4.12.2 中所示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等，本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
资产：							
银行存款	15,842,236.11	-	-	-	-	-	15,842,236.11
结算备付金	311,962.67	-	-	-	-	-	311,962.67
存出保证金	233,739.65	-	-	-	-	-	233,739.65

交易性金融资产	1,043,600.60	50,215,000.00	124,060,000.00	287,405,501.80	-	73,861,443.96	536,585,546.36
买入返售金融资产	455,002,952.50	-	-	-	-	-	455,002,952.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-	388,805.88	388,805.88
应收利息	-	-	-	-	-	7,408,445.77	7,408,445.77
资产总计	472,434,491.53	50,215,000.00	124,060,000.00	287,405,501.80	-	81,658,695.61	1,015,773,688.94
负债	-	-	-	-	-	-	-
负债：	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,407,392.67	5,407,392.67
应付赎回款	-	-	-	-	-	196.35	196.35
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,525,016.19	1,525,016.19
应付托管费	-	-	-	-	-	317,711.68	317,711.68
应付交易费用	-	-	-	-	-	287,882.98	287,882.98
其他负债	-	-	-	-	-	160,000.00	160,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	7,698,199.87	7,698,199.87
利率敏感度缺口	472,434,491.53	50,215,000.00	124,060,000.00	287,405,501.80	-	-	-

上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
资产	-	-	-	-	-	-	-
银行存款	17,500,614.92	-	-	-	-	-	17,500,614.92
结算备付金	1,306,659.53	-	-	-	-	-	1,306,659.53
存出保证金	35,153.52	-	-	-	-	-	35,153.52
交易性金融资产	-	-	-	45,409,044.10	12,163,256.64	13,025,061.14	70,597,361.88
买入返售金融资产	21,000,000.00	-	-	-	-	-	21,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	1,596,154.44	1,596,154.44
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	39,842,427.97	-	-	45,409,044.10	12,163,256.64	14,621,215.58	112,035,944.29
负债							
负债:	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	14,991,099.30	14,991,099.30

应付赎回款	-	-	-	-	148,371.14	148,371.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	100,908.29	100,908.29
应付托管费	-	-	-	-	21,022.56	21,022.56
应付交易费用	-	-	-	-	80,512.03	80,512.03
其他负债	-	-	-	-	75,372.22	75,372.22
负债总计	-	-	-	-	-15,417,285.54	15,417,285.54
利率敏感度缺口	39,842,427.97	-	45,409,044.10	12,163,256.64	-	-

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年12月31日）	上年度末（2014年12月31日）
	利率上升 25 个基点	-1,584,203.42	-337,479.30
利率下降 25 个基点	1,595,086.46	341,043.51	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	73,861,443.96	7.33	13,025,061.14	13.48
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	462,724,102.40	45.90	57,572,300.74	59.59
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	536,585,546.36	53.23	70,597,361.88	73.07

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	1. 本基金业绩比较基准上升 5%	4,077,442.25	1,191,788.81
2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-4,077,442.25	-1,191,788.81	

注：本基金业绩比较基准=沪深 300 指数×55%+中债总指数（财富）×45%。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### (2) 其他事项

###### (a) 公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 71,625,043.96 元，属于第二层次的余额为人民币 464,960,502.40 元，无划分为第三层次余额。

###### (ii) 公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定，自 2015 年 3 月 27 日起，固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。

###### (iii) 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于 2015 年初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具，本基金 2015 年度未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(b) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	73,861,443.96	7.27
	其中：股票	73,861,443.96	7.27
2	固定收益投资	462,724,102.40	45.55
	其中：债券	462,724,102.40	45.55
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	455,002,952.50	44.79
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	16,154,198.78	1.59
7	其他各项资产	8,030,991.30	0.79
8	合计	1,015,773,688.94	100.00

## 8.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,199,000.00	0.22
B	采矿业	-	-
C	制造业	63,699,414.73	6.32
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	222,304.44	0.02
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	2,588,208.18	0.26
J	金融业	4,060,400.00	0.40
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	109,392.21	0.01
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	982,724.40	0.10
S	综合	-	-
	合计	73,861,443.96	7.33

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300463	迈克生物	233,333	27,390,960.87	2.72
2	300443	金雷风电	65,566	12,675,219.12	1.26
3	300436	广生堂	94,594	7,891,977.42	0.78
4	002563	森马服饰	200,000	2,480,000.00	0.25
5	600271	航天信息	40,000	2,236,400.00	0.22
6	002299	圣农发展	100,000	2,199,000.00	0.22
7	002152	广电运通	70,000	2,169,300.00	0.22
8	601336	新华保险	40,000	2,088,400.00	0.21
9	002415	海康威视	60,000	2,063,400.00	0.20
10	601688	华泰证券	100,000	1,972,000.00	0.20
11	600519	贵州茅台	9,000	1,963,710.00	0.19
12	600703	三安光电	80,000	1,942,400.00	0.19
13	000488	晨鸣纸业	200,000	1,784,000.00	0.18
14	603508	思维列控	14,605	1,136,853.20	0.11
15	603999	读者传媒	16,713	982,724.40	0.10
16	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.09
17	603996	中新科技	16,729	494,174.66	0.05
18	300493	润欣科技	7,248	299,632.32	0.03
19	002782	可立克	13,312	283,146.24	0.03
20	002780	三夫户外	3,566	222,304.44	0.02
21	002787	华源包装	10,011	163,880.07	0.02
22	300494	盛天网络	6,251	162,901.06	0.02

23	300492	山鼎设计	6,219	109,392.21	0.01
24	300491	通合科技	6,015	90,766.35	0.01
25	002777	久远银海	4,264	70,356.00	0.01
26	002785	万里石	12,000	70,080.00	0.01

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601988	中国银行	16,476,468.00	17.05
2	601288	农业银行	13,518,000.00	13.99
3	601398	工商银行	12,420,000.00	12.85
4	601939	建设银行	11,050,092.40	11.44
5	002241	歌尔声学	10,319,743.16	10.68
6	002065	东华软件	10,257,154.81	10.62
7	002152	广电运通	9,332,784.22	9.66
8	600271	航天信息	9,095,747.88	9.41
9	000333	美的集团	8,941,599.00	9.25
10	002299	圣农发展	7,487,973.00	7.75
11	601628	中国人寿	7,218,041.90	7.47
12	601336	新华保险	6,910,037.85	7.15
13	300463	迈克生物	6,523,990.68	6.75
14	002563	森马服饰	6,515,422.00	6.74
15	002415	海康威视	5,676,211.03	5.87
16	600048	保利地产	5,434,729.00	5.62
17	601328	交通银行	5,205,978.00	5.39
18	600588	用友网络	5,036,432.00	5.21
19	600519	贵州茅台	4,545,694.00	4.70
20	601688	华泰证券	4,455,602.46	4.61
21	600703	三安光电	4,296,353.00	4.45
22	600138	中青旅	4,138,895.00	4.28
23	000651	格力电器	3,549,000.00	3.67
24	601166	兴业银行	3,330,494.00	3.45
25	300115	长盈精密	3,259,106.00	3.37

26	600585	海螺水泥	3,204,011.00	3.32
27	002292	奥飞动漫	3,183,752.00	3.30
28	600038	中直股份	3,114,180.00	3.22
29	000002	万科A	2,989,714.00	3.09
30	000402	金融街	2,909,000.00	3.01
31	002081	金螳螂	2,692,953.01	2.79
32	603989	艾华集团	2,605,058.62	2.70
33	002285	世联行	2,603,813.00	2.69
34	002033	丽江旅游	2,574,766.28	2.66
35	600642	申能股份	2,392,830.00	2.48
36	600019	宝钢股份	2,360,707.00	2.44
37	600239	云南城投	2,305,053.00	2.39
38	600886	国投电力	2,290,000.00	2.37
39	300462	华铭智能	2,277,054.00	2.36
40	000712	锦龙股份	2,276,636.00	2.36
41	600780	通宝能源	2,178,551.21	2.25
42	002037	久联发展	2,178,198.00	2.25
43	600382	广东明珠	2,174,160.00	2.25
44	002305	南国置业	2,171,890.00	2.25
45	600054	黄山旅游	2,107,451.00	2.18
46	300443	金雷风电	2,094,178.04	2.17
47	600096	云天化	2,082,912.00	2.16
48	600489	中金黄金	2,081,200.00	2.15
49	002450	康得新	2,017,324.00	2.09
50	300043	互动娱乐	1,946,773.00	2.01

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601988	中国银行	16,465,919.00	17.04
2	601288	农业银行	13,586,000.00	14.06
3	601398	工商银行	12,472,000.00	12.91
4	601939	建设银行	11,351,624.94	11.75
5	002241	歌尔声学	10,158,135.56	10.51
6	002065	东华软件	9,149,535.37	9.47

7	000333	美的集团	9,028,595.00	9.34
8	601628	中国人寿	6,788,659.60	7.03
9	002152	广电运通	6,460,556.70	6.69
10	600271	航天信息	6,261,359.38	6.48
11	600588	用友网络	6,111,236.45	6.33
12	601328	交通银行	5,601,230.90	5.80
13	002299	圣农发展	5,503,984.88	5.70
14	600048	保利地产	4,908,498.06	5.08
15	603989	艾华集团	4,471,825.37	4.63
16	601336	新华保险	4,302,484.00	4.45
17	002563	森马服饰	4,192,867.00	4.34
18	600138	中青旅	4,173,154.10	4.32
19	002756	永兴特钢	3,848,954.92	3.98
20	600038	中直股份	3,792,759.04	3.93
21	000651	格力电器	3,616,145.37	3.74
22	002415	海康威视	3,563,463.00	3.69
23	000002	万科A	3,497,459.83	3.62
24	002292	奥飞动漫	3,462,871.00	3.58
25	603025	大豪科技	3,300,570.00	3.42
26	600585	海螺水泥	3,160,565.74	3.27
27	002081	金螳螂	2,971,731.63	3.08
28	601166	兴业银行	2,964,000.00	3.07
29	000402	金融街	2,837,852.41	2.94
30	300115	长盈精密	2,797,843.65	2.90
31	600519	贵州茅台	2,767,288.44	2.86
32	300446	乐凯新材	2,709,898.12	2.80
33	002033	丽江旅游	2,684,958.99	2.78
34	601368	绿城水务	2,658,954.33	2.75
35	600703	三安光电	2,552,996.20	2.64
36	600642	申能股份	2,422,900.00	2.51
37	300028	金亚科技	2,390,433.00	2.47
38	002751	易尚展示	2,388,044.00	2.47
39	600096	云天化	2,345,692.00	2.43
40	603227	雪峰科技	2,319,629.42	2.40
41	000877	天山股份	2,307,490.70	2.39
42	601968	宝钢包装	2,274,350.40	2.35
43	603116	红蜻蜓	2,244,765.48	2.32
44	600780	通宝能源	2,223,066.57	2.30

45	600382	广东明珠	2,216,418.00	2.29
46	600886	国投电力	2,203,000.00	2.28
47	600054	黄山旅游	2,170,102.07	2.25
48	300438	鹏辉能源	2,062,221.54	2.13
49	600019	宝钢股份	2,043,571.46	2.12
50	603308	应流股份	2,016,702.00	2.09
51	002450	康得新	1,999,591.24	2.07
52	603979	金诚信	1,995,179.60	2.07

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	333,720,437.64
卖出股票收入（成交）总额	355,882,862.72

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,215,000.00	4.98
	其中：政策性金融债	50,215,000.00	4.98
4	企业债券	58,064,100.60	5.76
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	352,437,000.00	34.96
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	2,008,001.80	0.20
10	合计	462,724,102.40	45.90

#### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1182299	11TCL 集 MTN2	700,000	72,310,000.00	7.17
2	1282542	12 中城建 MTN2	600,000	62,466,000.00	6.20

3	0980172	09 亳州债	500,000	51,750,000.00	5.13
4	101461034	14 浙商集 MTN001	500,000	50,900,000.00	5.05
5	140206	14 国开 06	500,000	50,215,000.00	4.98

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本期末未持有资产支持证券。

### 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贵金属投资明细

注：本基金本期末未持有贵金属。

### 8.9 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：本基金本期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金报告期内未持有股指期货投资，也无期间损益。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金报告期内未参与股指期货交易。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未参与国债期货交易。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金报告期内未持有国债期货投资，也无期间损益。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货交易。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体除华泰证券（601688）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。

华泰证券股份有限公司于 2015 年 8 月 24 日收到中国证监会《调查通知书》，2015 年 9 月 10 日收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2015]72 号），对公司未按规定审查、了解

客户身份等违法违规行为责令改正，给予警告、没收违法所得行政处罚，对直接负责人给予警告、罚款行政处罚。

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	233,739.65
2	应收证券清算款	388,805.88
3	应收股利	-
4	应收利息	7,408,445.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,030,991.30

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 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	600271	航天信息	2,236,400.00	0.22	重大事项

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
198	4,326,770.35	851,812,464.82	99.43%	4,888,064.45	0.57%

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,069,059.20	0.12%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	36,929,084.38	4.31	10,000,000.00	1.17	3年
基金管理人高级管理人员	986,648.56	0.12	-	-	-
基金经理等人员	9,901.79	0.00	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	72,508.85	0.01	-	-	-
合计	37,998,143.58	4.44	10,000,000.00	1.17	3年

注：1、上述份额总数为扣除认购费用并包含利息结转份额后的总份额数；

2、本基金发起式资金提供方仅为基金管理人，基金管理人基金经理、其他从业人员认购的基金份额不属于发起份额。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年9月18日）基金份额总额	149,004,696.76
本报告期期初基金份额总额	94,354,024.27
本报告期基金总申购份额	4,146,961,897.32
减:本报告期基金总赎回份额	3,384,615,392.32
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	856,700,529.27

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

2015年5月25日，经中国证券监督管理委员会核准，基金管理人董事会批准王园先生辞任公司督察长，任命李凌先生担任公司督察长职务，王园先生改任公司副总经理。

2015年10月13日，基金管理人董事会批准饶雄先生辞任公司代理总经理职务，并决定由副总经理刘辉先生代理履行公司总经理职务。

2015年11月19日，经中国证券监督管理委员会核准，基金管理人董事会正式任命刘辉先生担任公司总经理职务。

上述变动事项基金管理人均进行了公告。

基金托管人的专门托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费用为60,000.00元。该审计机构自基金合同生效日起为本基金提供审计服务。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
红塔证券	2	117,690,767.62	17.76%	110,015.97	17.95%	未变更
招商证券	1	180,573,609.67	27.25%	166,282.23	27.12%	新增
国海证券	1	131,479,959.03	19.84%	119,760.51	19.54%	新增
广发证券	2	233,005,796.11	35.16%	216,997.11	35.40%	新增

注：本基金管理人在租用证券机构交易单元上符合中国证监会的有关规定。本基金管理人将证券经营机构的注册资本、研究水平、财务状况、经营状况、经营行为以及通讯交易条件作为基金专用交易单元的选择标准，由研究部、投资部及交易部对券商进行考评并提出交易单元租用及更换方案。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
红塔证券	28,742,599.33	44.15%	92,000,000.00	2.21%	-	-
招商证券	22,981,851.41	35.30%	3,955,000,000.00	94.87%	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	13,378,438.64	20.55%	122,000,000.00	2.93%	-	-

注：1、本报告期内本基金未发生交易所权证交易。

2、本报告期内本基金未发生交易所基金交易。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	红塔红土盛世普益灵活配置混合	中国证券报、证券时	2015年1月23日

	型发起式证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	报、管理人网站	
2	红塔红土基金管理有限公司关于董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 3 月 5 日
3	红塔红土基金：关于旗下基金在齐鲁证券有限公司开展网上交易申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 3 月 13 日
4	红塔红土基金管理有限公司总经理变更公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 3 月 19 日
5	红塔红土基金关于旗下证券投资基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 3 月 30 日
6	红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金 2014 年度报告摘要	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 3 月 30 日
7	关于红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金暂停大额申购业务的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 4 月 16 日
8	红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 4 月 21 日
9	红塔红土盛世普益混合发起式证券投资基金恢复大额申购业务的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 4 月 28 日
10	红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金更新的招	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 4 月 29 日

	募说明书摘要（2015 年 1 号）		
11	关于红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金暂停大额申购业务的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 5 月 4 日
12	红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 5 月 6 日
13	关于红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金调整大额申购限制金额的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 5 月 8 日
14	红塔红土基金管理有限公司关于调整旗下证券投资基金申购费率的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 5 月 15 日
15	红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 5 月 25 日
16	红塔红土基金管理有限公司督察长及副总经理变更公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 5 月 27 日
17	关于红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金恢复大额申购业务的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 5 月 28 日
18	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 6 月 19 日
19	关于红塔红土基金管理有限公司旗下基金参与上海天天基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 1 日
20	关于公司、高管及基金经理投资旗下基金相关事宜的公告	管理人网站	2015 年 7 月 6 日
21	红塔红土基金管理有限公司关于	中国证券报、证券时报	2015 年 7 月 17 日

	旗下基金新增代销机构的公告	报、管理人网站	
22	红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金 2015 年第 2 季度报告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 17 日
23	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 27 日
24	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 28 日
25	关于红塔红土基金管理有限公司旗下基金参与泰诚财富费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 30 日
26	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 31 日
27	红塔红土基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 8 月 7 日
28	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 8 月 25 日
29	红塔红土基金关于参加天天基金网费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 8 月 26 日
30	红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金 2015 年半年度报告摘要	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 8 月 28 日
31	红塔红土基金管理有限公司总经理变更公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 10 月 21 日
32	红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金 2015 年第 3 季度报告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 10 月 28 日
33	红塔红土盛世普益灵活配置混合	中国证券报、证券时报	2015 年 11 月 2 日

	型发起式证券投资基金更新的招募说明书摘要（2015 年 2 号）	报、管理人网站	
34	红塔红土基金管理有限公司关于参加上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 11 月 10 日
35	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 11 月 17 日
36	红塔红土基金管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 11 月 20 日
37	红塔红土基金管理有限公司总经理变更公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 11 月 28 日
38	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 11 日
39	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 18 日
40	红塔红土基金管理有限公司关于参加北京钱景财富投资管理有限公司费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 18 日
41	红塔红土基金管理有限公司关于因实行指数熔断机制调整旗下基金开放时间的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 31 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同；
- 3、红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议；
- 4、红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书；
- 5、报告期内披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

基金管理人的办公场所：广东省深圳市南山区侨香路 4068 号智慧广场 A 栋 801

基金托管人的办公场所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

### 13.3 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  
2016 年 3 月 28 日