

红塔红土盛弘灵活配置混合型发起式证券投资基金2019年第一季度报告

2019-03-31

基金管理人：红塔红土基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2019-04-20

重要提示

基金管理人承诺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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的投资运作符合有关法律法规的规定，不存在任何内幕交易、操纵市场等违法违规行为，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期末基金资产净值1,035,256.23元，基金份额持有人户数10,000户，较上一报告期末增加100户。

基金基本情况表，包含基金名称、基金代码、基金类型、基金管理人、基金托管人、基金合同生效日期、基金管理人、基金托管人、基金合同生效日期、基金管理人、基金托管人、基金合同生效日期。

主要财务指标表，包含本期已实现收益、本期利润、加权平均基金份额本期利润、期末基金资产净值、期末基金份额净值。

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，计入费用后实际投资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。

基金净值表现

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

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表，包含阶段、净值增长率、业绩比较基准收益率、业绩比较基准差。

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

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表，包含阶段、净值增长率、业绩比较基准收益率、业绩比较基准差。

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

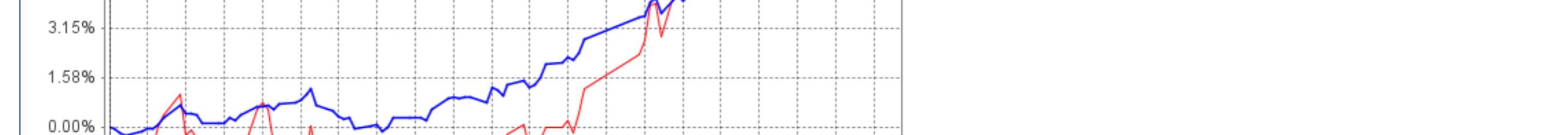
本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较表，包含阶段、净值增长率、业绩比较基准收益率、业绩比较基准差。

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变动的比较

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变动的比较图



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变动的比较



其他指标

其他指标表，包含其他指标、报告期、报告期末。

注：无

基金经理（或基金经理小组）简介

基金经理简介表，包含姓名、职务、任职日期、离任日期、证券从业年限、说明。

注：1. 本基金合同生效前基金经理任职不满一年，此处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。

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》、《证券投资基金信息披露管理办法》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，为基金份额持有人谋求最大利益。

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》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，为基金份额持有人谋求最大利益。

公平交易专项说明

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执行公平交易制度。

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执行公平交易制度。

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管理办法》，除完全按照有关指数构成比例进行证券投资的投资组合外，同一投资组合内不同反向交易、不同投资组合之间严格限制同日反向交易。

报告期内，本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均未超过该证券当日成交量的5%，未发生可能影响公平交易和利益输送的异常交易行为。

报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度宏观经济仍在下行波动中，但从各种指标表明下行的趋势在收敛，部分领先指标如PMI和制造业PMI已经触底回升，宏观经济最为艰难、预期最为悲观的时期已经过去。

截至本报告期末红塔红土盛弘灵活配置混合型发起式基金资产净值为1,035,256.23元，本报告期基金份额净值增长率为6.89%，截至本报告期末红塔红土盛弘灵活配置混合型发起式基金资产净值为1,035,256.23元，本报告期基金份额净值增长率为6.89%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，基金合同生效满三年，不运用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

根据本基金合同的规定，该基金生效之日起三年后的对应日，若基金资产规模低于2亿元，基金合同自动终止。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

报告期末基金资产组合情况表，包含序号、代码、项目、金额、占基金总资产比例。

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的股票投资组合表，包含序号、行业类别、公允价值、占基金资产净值比例。

报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合表，包含行业类别、公允价值、占基金资产净值比例。

注：无

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

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表，包含序号、股票代码、股票名称、数量、公允价值、占基金资产净值比例。

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末按债券品种分类的债券投资组合表，包含序号、债券品种、公允价值、占基金资产净值比例。

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

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表，包含序号、债券代码、债券名称、数量、公允价值、占基金资产净值比例。

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：无

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：无

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：无

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细表，包含代码、名称、持仓量、公允价值变动、公允价值变动。

注：无

本基金股指期货投资的投资政策

注：无

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

注：无

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细表，包含代码、名称、持仓量、公允价值变动、公允价值变动。

本期国债期货投资评价

注：无

投资组合报告附注

受到调查及处罚情况

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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

其他资产构成

其他资产构成表，包含序号、名称、金额。

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于组合内原因，分项之和与合计可能有尾差。

开放式基金份额变动

开放式基金份额变动表，包含项目、红塔红土盛弘混合型发起式、红塔红土盛弘混合型发起式A、红塔红土盛弘混合型发起式C。

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人持有本基金份额变动情况表，包含项目、红塔红土盛弘混合型发起式、红塔红土盛弘混合型发起式A、红塔红土盛弘混合型发起式C。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细表，包含序号、交易方式、交易日期、交易份额、交易金额、适用费率。

注：注：本报告期内管理人未运用固有资金投资本基金。

报告期末发起式基金基金资产持有份额情况

报告期末发起式基金基金资产持有份额情况表，包含项目、持有份额总数、持有份额占基金总资产比例、发起份额总数、发起份额占基金总资产比例、发起份额承诺持有期限。

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况表，包含投资者类别、序号、持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间、期初份额、中期份额、赎回份额、持有份额、份额占比。

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，可能出现大额赎回导致基金净值波动的风险，基金管理人将无法及时变现基金资产导致投资者赎回申请延期办理的风险，敬请投资者留意。

影响投资决策的其他重要信息

无

备查文件目录

- 1. 中国证监会核准基金募集的文件；
2. 红塔红土盛弘灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同；
3. 红塔红土盛弘灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议；
4. 红塔红土盛弘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。

存放地点

广东省深圳市南山区侨香路6068号智慧广场48081

查阅方式

投资者可通过基金管理人网站，或在营业时间内到基金管理人、基金托管人的办公场所免费查阅有关文件。在支付工本费后，投资者可取得有关文件的复印件或复印件。

投资者对本报告如有疑义，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.htsec.com.cn