# 红塔红土长益定期开放债券型证券投资基金

## 2019 半年度 报告摘要

2019年6月30日

**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**
**送出日期:2019 年 8 月 28 日**

### §1 重要提示

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。本半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。

基金托管人渤海银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2019 年 8 月 26 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

### §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 红塔红土长益定期开放债券 | |
| 基金主代码 | 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 | |
| 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 | |
| 报告期末基金份额总额 | 161,647,129.57 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 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 |
| 下属分级基金的交易代码: | 002688 | 002689 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 161,374,262.50 份 | 272,867.07 份 |

2.2 基金产品说明

| | | |
|---|---|---|
| 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。 | |
| | 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 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | – | – |

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 | 渤海银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李凌 | 阮劲松 |
| | 联系电话 | 0755–33379079 | 010–65110109 |
| | 电子邮箱 | liling@htamc.com.cn | js.ruan@cbhb.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4001–666–916(免长途话费) | 4008888811/95541 |
| 传真 | | 0755–33379007 | 022–58314791 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.htamc.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的办公场所 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 基金级别 | 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 |
|---|---|---|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019 年 1 月 1 日 – 2019 年 6 月 30 日) | 报告期(2019 年 1 月 1 日 – 2019 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 7,234,491.07 | 11,837.98 |
| 本期利润 | 2,957,561.25 | 4,594.03 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0185 | 0.0168 |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.87% | 1.67% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019 年 6 月 30 日) | |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0603 | 0.0500 |
| 期末基金资产净值 | 161,272,835.53 | 272,450.55 |
| 期末基金份额净值 | 0.9994 | 0.9985 |

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

红塔红土长益定期开放债券 A

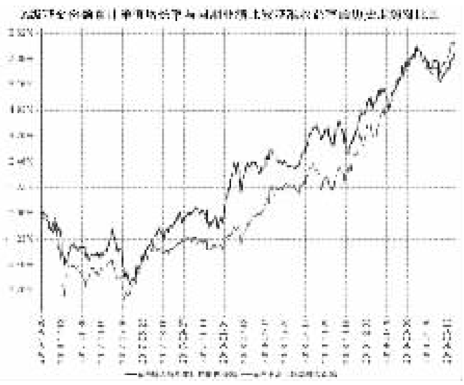
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①–③ | ②–④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 1.07% | 0.08% | 1.12% | 0.10% | –0.05% | –0.02% |
| 过去三个月 | –0.25% | 0.12% | 0.29% | 0.14% | –0.54% | –0.02% |
| 过去六个月 | 1.87% | 0.13% | 3.94% | 0.14% | –2.07% | –0.01% |
| 过去一年 | 4.99% | 0.13% | 6.60% | 0.15% | –1.61% | –0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.63% | 0.14% | 8.21% | 0.14% | –0.58% | 0.00% |

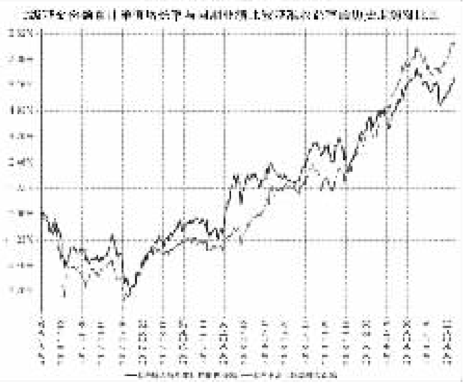
红塔红土长益定期开放债券 C

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 1.03% | 0.08% | 1.12% | 0.10% | –0.09% | –0.02% |
| 过去三个月 | –0.35% | 0.12% | 0.29% | 0.14% | –0.64% | –0.02% |
| 过去六个月 | 1.67% | 0.13% | 3.94% | 0.14% | –2.27% | –0.01% |
| 过去一年 | 4.57% | 0.13% | 6.60% | 0.15% | –2.03% | –0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.48% | 0.14% | 8.21% | 0.14% | –1.73% | 0.00% |

注:本基金的业绩比较基准为:中国债券总指数(财富)×90%+ 沪深 300 指数 ×10%。

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





3.3 其他指标

注:无

### §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 日正式成立,注册地位于深圳前海,注册资本 4.96 亿元人民币。其中,红塔证券股份有限公司出资比例为 59.27%,北京市华远集团有限公司出资比例为 30.24%,深圳市创新投资集团有限公司出资比例为 10.49%。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 2019 年 6 月 30 日,公司有员工 53 人,其中 35 人具有硕士或博士学位;截止 2019 年 6 月 30 日,公司管理 9 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 | | |
| 梁钧 | 基金经理 | 2018年 9 月 29 日 | – | 18 | 上海交通大学博士,2000 年 7 月参加工作。曾担任湘财证券研究所研究员、太平洋保险资金中心债券投资经理、泰达宏利基金管理有限公司固定收益部总经理和基金经理、上投摩根基金管理有限公司基金经理、上海原君投资公司总经理、太平资产管理有限公司债券投资经理。2018 年 5 月起任职于红塔红土基金管理有限公司, 现任固定收益部总经理、研究部总监、总经理助理。 |
| 罗薇 | 基金经理 | 2018年 9 月 14 日 | – | 6 | 澳洲新南威尔士大学会计学硕士,北京大学理学学士,2012 年加入红塔红土基金研究部, 现任职于公司投资部,为公司投资决策委员会委员。 |
| 胡文波 | 基金经理 | 2017年 12 月 8 日 | 2018年 9 月 29 日 | 10 | 北京大学金融专业硕士,加拿大多伦多大学金融学士。3 年海外金融从业经历与 7 年国内金融研究投资经验。曾任职华泰证券研究所机构销售经理,金元证券资产管理部投资经理职务,具有较丰富的债券研究投资经验。2017 年加入红塔红土基金研究部,现任职于公司投资部,为公司投资决策委员会委员。 |
| 罗薇 | 基金经理 | 2016年 10 月 26 日 | 2018年 7 月 27 日 | 6 | 澳洲新南威尔士大学会计学硕士,北京大学理学学士,2012 年加入红塔红土基金研究部, 现任职于公司投资部,为公司投资决策委员会委员。 |

注: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。

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《红塔红土长益定期开放债券型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 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

进入二季度以来,经济下行压力明显加大,4、5 月工业生产持续减速。而从中观高频数据看,6 月经济有望止跌企稳。一方面,终端需求有所改善,地产销量增速低位持平,乘用车批发增速依然偏低,但零售增速已回升转正。另一方面,工业生产逐渐回暖,发电耗煤降幅收窄,汽车、钢铁、化工等行业开工率也是多数回升。此外,海外环境出现缓和,美债收益率大幅下行,G20 峰会有助于中美贸易摩擦短期缓和。

年初以来的猪价、水果价格大涨引发了对通胀的担忧,但这些食品价格的上涨主要源于供给因素的推动,而缺乏需求上升的支撑,其实难以形成全面的通胀压力。6 月以来猪价、水果价格涨幅缩窄,加上国内钢价、煤价回落,成品油价格滞后下调,预计下半年通胀将趋于回落。预计 6 月的 CPI 将小幅回落,而 PPI 或再度转负,通胀整体趋于回落。

为避免包商银行事件对金融系统造成过度冲击,二季度央行持续投放流动性,并着力于预期引导,以呵护资金面稳定。尽管二季度流动性充裕,但整体市场风险偏好显著下移,信用利差显著扩大,高资质信用主体受到市场偏好,交易情绪活跃,收益率显著下行。本基金在二季度内进一步降低了基金久期和杠杆,同时根据市场环境择机调整了利率债持仓,整体债券组合久期保持在 2 左右。股票方面,基金在行业配置上也以稳健为目标,以受益于稳增长的低估值行业,同时适当布局符合中国经济长期发展需要的高科技行业为主,受适当参与了贵金属行业受美联储货币政策预期变化影响的趋势性机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末红塔红土长益定期开放债券 A 基金份额净值为 0.9994 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.87%;截至本报告期末红塔红土长益定期开放债券 C 基金份额净值为 0.9985 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.67%;同期业绩比较基准收益率为 3.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,随着外部风险因素的减弱,政策更加聚焦到宏观经济的内部因素,大到政府进一步减少不必要的开支,小到积极推广垃圾分类,我们正走在一条正确的道路上。因此我们对于三季度股票市场较为乐观,一是 G20 会议,中美两国领导人再次达成共识,中美贸易谈判再度重启,市场对外部环境的担忧得到解除,风险偏好提升;二是经过二季度的回调,股票的估值再度回到较低的位置,向上有空间;三是科创板即将开板,将会带动市场投资科技成长股的热情;四是宏观经济也有可能在三季度止住进一步下行的势头,出现启稳迹象。总体而言三季度利多因素远多于不利因素。在行业上我们看好科技成长股和消费龙头。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 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,渤海银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对红塔红土长益定期开放债券型证券投资基金(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 托管人对本半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并经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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:红塔红土长益定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2019 年 6 月 30 日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期末<br>2019年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 1,085,199.05 | 1,050,583.34 |
| 结算备付金 | 961,500.98 | 487,680.64 |
| 存出保证金 | 72,654.16 | 53,695.28 |
| 交易性金融资产 | 164,685,474.60 | 203,063,634.00 |
| 其中:股票投资 | 1,991,813.00 | 174,437.00 |
| 基金投资 | – | – |
| 债券投资 | 162,693,661.60 | 202,889,197.00 |
| 资产支持证券投资 | – | – |
| 贵金属投资 | – | – |
| 衍生金融资产 | – | – |
| 买入返售金融资产 | 6,400,000.00 | – |
| 应收证券清算款 | 198,581.75 | – |
| 应收利息 | 3,547,796.09 | 4,386,539.43 |
| 应收股利 | – | – |
| 应收申购款 | – | 5,200.00 |
| 递延所得税资产 | – | – |
| 其他资产 | – | – |
| 资产总计 | 176,951,206.63 | 209,047,332.69 |
| 负债和所有者权益 | 本期末<br>2019年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018年 12 月 31 日 |
| 负 债: | | |
| 短期借款 | – | – |
| 交易性金融负债 | – | – |
| 衍生金融负债 | – | – |
| 卖出回购金融资产款 | 15,200,000.00 | 49,919,654.50 |
| 应付证券清算款 | – | – |
| 应付赎回款 | – | 225,497.06 |
| 应付管理人报酬 | 52,799.29 | 51,066.23 |
| 应付托管费 | 13,199.83 | 12,766.58 |
| 应付销售服务费 | 89.11 | 117.81 |
| 应付交易费用 | 23,953.48 | 22,066.29 |
| 应交税费 | 15,997.11 | 19,540.90 |
| 应付利息 | 12,741.60 | 63,987.22 |
| 应付利润 | – | – |
| 递延所得税负债 | – | – |
| 其他负债 | 87,140.13 | 50,000.04 |
| 负债合计 | 15,405,920.55 | 50,364,696.63 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 150,097,200.68 | 150,189,366.20 |
| 未分配利润 | 11,448,085.40 | 8,493,269.86 |
| 所有者权益合计 | 161,545,286.08 | 158,682,636.06 |
| 负债和所有者权益总计 | 176,951,206.63 | 209,047,332.69 |

注:报告截止日 2019 年 6 月 30 日,本基金 A 类基金份额净值人民币 0.9994 元,A 类基金份额 161,374,262.50 份;C 类基金份额净值人民币 0.9985 元,C 类基金份额 272,867.07 份,基金份额总额合计为 161,647,129.57 份。

6.2 利润表

会计主体:红塔红土长益定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位:人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 4,159,814.22 | 5,553,591.83 |
| 1.利息收入 | 4,418,316.16 | 4,140,906.85 |
| 其中:存款利息收入 | 13,886.86 | 16,616.73 |
| 债券利息收入 | 4,369,186.38 | 4,098,611.49 |
| 资产支持证券利息收入 | – | – |
| 买入返售金融资产收入 | 35,242.92 | 25,678.63 |
| 其他利息收入 | – | – |
| 2.投资收益(损失以"–"填列) | 4,025,671.83 | 962,394.84 |
| 其中:股票投资收益 | 2,506,045.71 | 1,528,720.25 |
| 基金投资收益 | – | – |
| 债券投资收益 | 1,483,931.02 | –562,347.21 |
| 资产支持证券投资收益 | – | – |
| 贵金属投资收益 | – | – |
| 衍生工具收益 | – | – |
| 股利收益 | 35,695.10 | –3,978.20 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"–"号填列) | –4,284,173.77 | 450,117.24 |
| 4.汇兑收益(损失以"–"号填列) | – | – |
| 5.其他收入(损失以"–"号填列) | – | 172.90 |
| 减:二、费用 | 1,197,658.94 | 1,708,377.56 |
| 1. 管理人报酬 | 317,932.61 | 288,393.72 |
| 2. 托管费 | 79,483.16 | 72,098.41 |
| 3. 销售服务费 | 543.04 | 1,490.29 |
| 4. 交易费用 | 100,048.81 | 107,862.20 |
| 5. 利息支出 | 583,036.93 | 1,081,852.75 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 583,036.93 | 1,081,852.75 |
| 6. 税金及附加 | 10,874.26 | 14,107.86 |
| 7. 其他费用 | 105,740.13 | 142,572.33 |
| 三、利润总额(亏损总额以"–"号填列) | 2,962,155.28 | 3,845,214.27 |
| 减:所得税费用 | – | – |
| 四、净利润(净亏损以"–"号填列) | 2,962,155.28 | 3,845,214.27 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:红塔红土长益定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位:人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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) | 150,189,366.20 | 8,493,269.86 | 158,682,636.06 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | – | 2,962,155.28 | 2,962,155.28 |
| 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) | –92,165.52 | –7,339.74 | –99,505.26 |
| 其中:1.基金申购款 | 1,418.13 | 79.96 | 1,498.09 |
| 2.基金赎回款 | –93,583.65 | –7,419.70 | –101,003.35 |
| 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) | 150,097,200.68 | 11,448,085.40 | 161,545,286.08 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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) | 142,824,013.77 | –264,694.28 | 142,559,319.49 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | – | 3,845,214.27 | 3,845,214.27 |
| 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) | –1,756,766.29 | –36,942.04 | –1,793,708.33 |
| 其中:1.基金申购款 | 22,858.74 | 527.93 | 23,386.67 |
| 2.基金赎回款 | –1,779,625.03 | –37,469.97 | –1,817,095.00 |
| 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) | 141,067,247.48 | 3,543,577.95 | 144,610,825.43 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

______ 刘辉 ______ ______ 许艺然 ______ ____ 李志朋 ____
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

红塔红土长益定期开放债券型证券投资基金(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")2016 年 4 月 6 日下发的证监许可[2016]689 号文《关于准予红塔红土长益定期开放债券型证券投资基金注册的批复》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")自 2016 年 9 月 26 日至 2016 年 10 月 21 日向社会公开发行募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2016)验字第 61014670_H03 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。本基金合同于 2016 年 10 月 26 日正式生效。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,渤海银行股份有限公司(简称"渤海银行")。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国内依法发行交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、地方政府债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券、次级债、债券回购(包含但不限于质押及买断式回购)、银行存款(包含但不限于协议存款、通知存款、定期存款)、货币市场工具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的相关规定)。本基金还可以参与投资股票、权证等权益类金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%;投资于股票、权证等权益类证券的比例不超过基金资产的 20%,其中,本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%;开放期内,本基金每个交易日终应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;封闭期内,本基金不受该比例的限制。本基金的业绩比较基准为:中国债券总指数(财富)X90%+ 沪深 300 指数 X10%。

6.4.2 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。

6.4.3 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 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)增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自 2018 年 1 月 1 日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称"资管产品运营业务"),暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》,自 2018 年 1 月 1 日起,资管产品管理人运营资管产品提供贷款服务,以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额;转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价(2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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[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。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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 |
| 渤海银行 | 基金托管人、基金销售机构 |

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注:无。

6.4.8.1.2 债券交易

注:无。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注:无。

6.4.8.1.4 权证交易

注:无。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 317,932.61 | 288,393.72 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 602.86 | 2,124.03 |

注:基金管理费每日计提,按月支付。基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.40%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.40%÷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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 79,483.16 | 72,098.41 |

注:基金托管费每日计提,按月支付。基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2019年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 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 | 合计 |
| 渤海银行 | – | 39.82 | 39.82 |
| 红塔红土基金公司 | – | 30.77 | 30.77 |
| 合计 | – | 70.59 | 70.59 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 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 | 合计 |
| 渤海银行 | – | 85.14 | 85.14 |
| 红塔红土基金公司 | – | 282.17 | 282.17 |
| 合计 | – | 367.31 | 367.31 |

注:基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别,适用不同的销售服务费率。其中,A 类基金份额不收取销售服务费,C 类基金份额销售服务费年费率为 0.40%。基金销售服务费每日计提,按月支付。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下:

H=E×0.40%/ 当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:无。

6.4.8.4.2 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

注:无。

6.4.8.5 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<br>2019年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 渤海银行 | 1,085,199.05 | 7,039.74 | 1,032,439.45 | 10,114.55 |

注:本基金本期的活期银行存款由基金托管人渤海银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注:无。

6.4.9 期末(2019 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发 / 增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注:无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止, 基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 15,200,000.00 元,于 2019 年 7 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和 / 或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 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、存出保证金、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 2019 年 6 月 30 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划分为第一层次的余额为人民币 1,991,813.00 元,划分为第二层次的余额为人民币 162,693,661.60 元,无划分为第三层次余额。于 2018 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划分为第一层次的余额为人民币 174,437.00 元,划分为第二层次的余额为人民币 202,889,197.00 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。

(iii)第三层次公允价值本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具,本基金本报告期末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。

### §7 投资组合报告

7.1 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 | 1,991,813.00 | 1.13 |
| | 其中:股票 | 1,991,813.00 | 1.13 |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | 162,693,661.60 | 91.94 |
| | 其中:债券 | 162,693,661.60 | 91.94 |
| | 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 | 6,400,000.00 | 3.62 |
| | 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 | 2,046,700.03 | 1.16 |
| 8 | 其他各项资产 | 3,819,032.00 | 2.16 |
| 9 | 合计 | 176,951,206.63 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | – | – |
| B | 采矿业 | – | – |
| C | 制造业 | 1,770,598.00 | 1.10 |
| 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 | – | – |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 52,780.00 | 0.03 |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | – | – |
| J | 金融业 | – | – |
| K | 房地产业 | – | – |
| L | 租赁和商务服务业 | 168,435.00 | 0.10 |
| 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 | 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 | 1,991,813.00 | 1.23 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:无。

7.3 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

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 | 002463 | 沪电股份 | 28,000 | 381,360.00 | 0.24 |
| 2 | 600872 | 中炬高新 | 5,900 | 252,697.00 | 0.16 |
| 3 | 603611 | 诺力股份 | 12,600 | 219,870.00 | 0.14 |
| 4 | 002205 | 国统股份 | 9,200 | 179,124.00 | 0.11 |
| 5 | 601888 | 中国国旅 | 1,900 | 168,435.00 | 0.10 |
| 6 | 000860 | 顺鑫农业 | 3,300 | 153,945.00 | 0.10 |
| 7 | 603160 | 汇顶科技 | 1,100 | 152,680.00 | 0.09 |
| 8 | 002597 | 金禾实业 | 8,000 | 145,920.00 | 0.09 |
| 9 | 603833 | 欧派家居 | 1,100 | 118,382.00 | 0.07 |
| 10 | 600031 | 三一重工 | 6,400 | 83,712.00 | 0.05 |

注:投资者欲了解本报告期末投资的所有股票明细,应阅读登载于 www.htamc.com.cn 网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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 | 600030 | 中信证券 | 1,979,327.00 | 1.25 |
| 2 | 300014 | 亿纬锂能 | 1,808,903.00 | 1.14 |
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 1,786,649.93 | 1.13 |
| 4 | 002463 | 沪电股份 | 1,634,912.00 | 1.03 |
| 5 | 600872 | 中炬高新 | 1,470,978.00 | 0.93 |
| 6 | 601688 | 华泰证券 | 1,455,389.00 | 0.92 |
| 7 | 300059 | 东方财富 | 1,312,853.00 | 0.83 |
| 8 | 300136 | 信维通信 | 880,169.00 | 0.55 |
| 9 | 601162 | 天风证券 | 818,417.00 | 0.52 |
| 10 | 600004 | 白云机场 | 801,605.00 | 0.51 |
| 11 | 600036 | 招商银行 | 770,928.00 | 0.49 |
| 12 | 601009 | 南京银行 | 756,786.00 | 0.48 |
| 13 | 600398 | 海澜之家 | 750,327.00 | 0.47 |
| 14 | 601328 | 交通银行 | 748,200.00 | 0.47 |
| 15 | 600236 | 桂冠电力 | 745,080.00 | 0.47 |
| 16 | 002146 | 荣盛发展 | 739,025.00 | 0.47 |
| 17 | 601006 | 大秦铁路 | 735,486.00 | 0.46 |
| 18 | 603833 | 欧派家居 | 722,198.15 | 0.46 |
| 19 | 000429 | 粤高速 A | 720,240.34 | 0.45 |
| 20 | 601888 | 中国国旅 | 681,872.00 | 0.43 |

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。

7.4.2 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 | 300014 | 亿纬锂能 | 2,274,945.00 | 1.43 |
| 2 | 600030 | 中信证券 | 2,077,515.00 | 1.31 |
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 1,884,299.44 | 1.19 |
| 4 | 002463 | 沪电股份 | 1,684,897.00 | 1.06 |
| 5 | 601688 | 华泰证券 | 1,443,342.00 | 0.91 |
| 6 | 300059 | 东方财富 | 1,369,556.19 | 0.86 |
| 7 | 600872 | 中炬高新 | 1,353,726.00 | 0.85 |
| 8 | 300136 | 信维通信 | 990,286.00 | 0.62 |
| 9 | 002146 | 荣盛发展 | 878,512.00 | 0.55 |
| 10 | 600004 | 白云机场 | 864,731.00 | 0.54 |
| 11 | 601162 | 天风证券 | 849,214.00 | 0.54 |
| 12 | 600398 | 海澜之家 | 826,263.00 | 0.52 |
| 13 | 600036 | 招商银行 | 804,062.08 | 0.51 |
| 14 | 600236 | 桂冠电力 | 797,867.00 | 0.50 |
| 15 | 601009 | 南京银行 | 774,752.00 | 0.49 |
| 16 | 601328 | 交通银行 | 764,180.00 | 0.48 |
| 17 | 601006 | 大秦铁路 | 750,482.00 | 0.47 |
| 18 | 000429 | 粤高速 A | 747,012.23 | 0.47 |
| 19 | 300073 | 当升科技 | 689,946.00 | 0.43 |
| 20 | 601398 | 工商银行 | 679,458.00 | 0.43 |

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。

7.4.3 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 | 31,394,583.51 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 32,336,341.40 |

7.5 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 | 1,359,321.60 | 0.84 |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 3 | 金融债券 | 10,233,000.00 | 6.33 |
| | 其中:政策性金融债 | – | – |
| 4 | 企业债券 | 81,575,340.00 | 50.50 |
| 5 | 企业短期融资券 | 20,051,000.00 | 12.41 |
| 6 | 中期票据 | 20,317,000.00 | 12.58 |
| 7 | 可转债(可交换债) | – | – |
| 8 | 同业存单 | 29,158,000.00 | 18.05 |
| 9 | 其他 | – | – |
| 10 | 合计 | 162,693,661.60 | 100.71 |

7.6 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 | 1828005 | 18浙商银行 01 | 100,000 | 10,233,000.00 | 6.33 |
| 2 | 127370 | 16奥德 01 | 100,000 | 10,212,000.00 | 6.32 |
| 3 | 1280352 | 12湘高速债 | 100,000 | 10,187,000.00 | 6.31 |
| 4 | 1282435 | 12闽高速 MTN2 | 100,000 | 10,168,000.00 | 6.29 |
| 5 | 101758024 | 17 中 药 控 股 MTN001 | 100,000 | 10,149,000.00 | 6.28 |

7.7 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。

7.8 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:无。

7.9 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:无。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

注:无。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:无。

7.10.3 本期国债期货投资评价

注:无。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期末,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。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

7.11.3 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 | 72,654.16 |
| 2 | 应收证券清算款 | 198,581.75 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 3,547,796.09 |
| 5 | 应收申购款 | – |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 3,819,032.00 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:无。

7.11.6 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,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 份额级别 | 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 |
| 红塔红土长益定期开放债券 A | 119 | 1,356,086.24 | 161,003,506.27 | 99.77% | 370,756.23 | 0.23% |
| 红塔红土长益定期开放债券 C | 104 | 2,623.72 | 0.00 | 0.00% | 272,867.07 | 100.00% |
| 合计 | 223 | 724,875.02 | 161,003,506.27 | 99.60% | 643,623.30 | 0.40% |

注:1、分级基金机构 / 个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额);

2、户均持有的基金份额合计 = 期末基金份额总额 / 期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 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 | 红塔红土长益定期开放债券 A | 17,406.92 | 0.0108% |
| | 红塔红土长益定期开放债券 C | 14,329.86 | 5.2516% |
| | 合计 | 31,736.78 | 0.0196% |

注:分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.3 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 | 份额级别 | 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 | 红塔红土长益定期开放债券 A | 0~10 |
| | 红塔红土长益定期开放债券 C | 0 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 红塔红土长益定期开放债券 A | 0 |
| | 红塔红土长益定期开放债券 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |

### §9 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 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 155,969,758.07 | 270,429.97 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 1,465.52 | 9.81 |
| 减:本报告期期间基金总赎回份额 | 92,589.06 | 6,392.52 |
| 本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以 "–" 填列) | 5,495,627.97 | 8,819.81 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 161,374,262.50 | 272,867.07 |

### §10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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,基金管理人无重大人事变动。
基金托管人的专门托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 | |
| 长城证券 | 2 | 63,728,944.91 | 100.00% | 59,351.26 | 100.00% | – |

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。

10.7.2 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 |
| 长城证券 | 108,950,322.09 | 100.00% | 753,900,000.00 | 100.00% | – | – |

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 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2019–01–01 至 2019–06–30 | 145,640,555.96 | 5,133,155.24 | – | 150,773,711.20 | 93.27% |
| 个人 | – | – | – | – | – | – | – |
| – | – | – | – | – | – | – | – |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本报告期内,本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情形,可能出现大额赎回导致基金净值波动的风险,基金管理人可能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。 | | | | | | | |

注:上表申购份额包含报告期内份额折算调增的份额,赎回份额包含报告期内份额折算调减的份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

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**
2019 年 8 月 28 日