

红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式 证券投资基金清算报告

基金管理人：红塔红土基金管理有限公司

基金托管人：广州农村商业银行股份有限公司

报告出具日期：2018年10月30日

清算报告公告日：2018年12月25日

一、重要提示

红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]1467号注册募集,于2015年8月6日成立并正式运作,基金管理人为红塔红土基金管理有限公司,基金托管人为广州农村商业银行股份有限公司。

根据《红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》“第五部分基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定,“《基金合同》生效之日起三年后的对应日,若基金资产净值低于2亿元,《基金合同》自动终止,无需召开基金份额持有人大会审议决定”;本基金自《基金合同》生效之日起三年后的对应日,基金资产净值低于2亿元,已触发基金合同终止情形,基金合同自动终止。于2018年9月7日基金管理人就该事项在基金管理人网站刊登了《红塔红土基金管理有限公司关于红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。本基金于2018年9月11日起进入清算程序。

基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2018年9月10日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计,上海源泰律师事务所对清算事宜出具法律意见。

二、基金概况

1、基金基本情况

基金名称	红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	红塔红土优质成长灵活配置混合	
基金主代码	001673	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2015年8月6日	
基金管理人	红塔红土基金管理有限公司	
基金托管人	广州农村商业银行股份有限公司	
报告期末(最后运作日)基金份额总额	10,642,600.13份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	红塔红土优质成长混合型A	红塔红土优质成长混合型C
下属分级基金的交易代码	001673	001674

报告期末（最后运作日）下属分级基金的份额总额	10,102,255.76 份	540,344.37 份
------------------------	-----------------	--------------

2、基金产品说明

投资目标	本基金通过对个股基本面的价值分析精选个股，通过对宏观经济周期阶段的分析确定股票资产和债券资产等各类资产的中长期配置，通过行为金融学对市场短期风格的分析确定短期行业配置，在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动地资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金投资策略包括大类资产配置策略、股票资产投资策略、债券及其它金融工具投资策略几个部分。
业绩比较基准	沪深 300 指数×55%+中债总指数（财富）×45%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

三、财务会计报告

资产负债表

会计主体：红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2018 年 9 月 10 日

单位：人民币元

资 产	基金最后运作日 2018 年 9 月 10 日
资 产：	
银行存款	1,877,963.31
结算备付金	759,122.15
存出保证金	17,145.58
交易性金融资产	7,921,974.56
其中：股票投资	6,513,694.56
债券投资	1,408,280.00
应收证券清算款	89,315.36
应收利息	30,779.21
资产总计	10,696,300.17
负债和所有者权益	基金最后运作日 2018 年 9 月 10 日
负 债：	
应付赎回款	918.14
应付管理人报酬	19,434.90
应付托管费	4,858.72
应付销售服务费	35.94
应付交易费用	173,854.35

应交税费	3,818.30
其他负债	146,745.58
负债合计	349,665.93
所有者权益：	
实收基金	10,642,600.13
未分配利润	-295,965.89
所有者权益合计	10,346,634.24
负债和所有者权益总计	10,696,300.17

注：报告截止日 2018 年 9 月 10 日(基金最后运作日)，基金份额总额 10,642,600.13 份。其中 A 类基金份额净值 0.9725 元，基金份额总额 10,102,255.76 份；C 类基金份额净值 0.9659 元，基金份额总额 540,344.37 份。

四、清算事项说明

1、基本情况

红塔红土优质成长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证监许可[2015]1467号《关于准予红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》的注册，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 2015 年 8 月 6 日正式生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次设立募集规模为 20,980,124.65 份基金份额，其中认购资金利息折合 530.52 份基金份额。本基金的基金管理人为红塔红土基金公司，登记机构为红塔红土基金公司，基金托管人为广州农村商业银行股份有限公司(以下简称“广州农村商业银行”)。

本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。

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(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票)、固定收益类资产(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款及现金等)、衍生工具(权证、股指期货等)以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具(但需符合中国

证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%,债券等固定收益资产占基金资产的比例不低于 5%;权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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%。

根据《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》和《红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“基金合同”)等有关规定,发起式证券投资基金基金合同生效满 3 年之日,若基金资产净值低于人民币 2 亿元,基金合同自动终止,无须召开基金份额持有人大会审议决定。本基金因触发上述规定中基金合同自动终止情形,基金合同自动终止。于 2018 年 9 月 7 日基金管理人就该事项在基金管理人网站刊登了《红塔红土基金管理有限公司关于红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

2、清算原因

根据基金合同“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定:“《基金合同》生效之日起三年后的对应日,若基金资产净值低于 2 亿元,《基金合同》自动终止,无需召开基金份额持有人大会审议决定;《基金合同》生效三年后继续存续的,连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续 60 个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。”《基金合同》生效之日起满 3 年后的对应日,本基金资产净值低于人民币 2 亿元,触发《基金合同》终止事由,按照基金合同的约定应进行基金财产清算。

3、清算起始日

经基金管理人红塔红土基金公司与基金托管人广州农村商业银行协商一致,本基金于 2018 年 9 月 11 日起进入清算程序,故本基金清算起始日为 2018 年 9 月 11 日。由于本基金持有的流通受限证券无法确定变现时间,本基金计划将进行两次清算,其中第一次清算期间为 2018 年 9 月 11 日至 2018 年 10 月 30 日,第二次清算期间将根据流通受限股票的变现时间确定。

4、清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。基金管理人编制清算报表是为了呈报红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金全体持有人以及中国证监会使用。因此，清算报表可能不适用于其他用途。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

五、清算情况

自 2018 年 9 月 11 日至 2018 年 10 月 30 日止清算期间，红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下：

1、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金人民币 759,122.15 元；截至 2018 年 10 月 30 日结算备付金余额为人民币 14,362.23 元，该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

(2) 本基金最后运作日存出保证金人民币 17,145.58 元；截至 2018 年 10 月 30 日存出保证金余额为人民币 111,176.76 元，该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产人民币 7,921,974.56 元，其中：

1) 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限股票人民币 3,282,240.38 元，其明细如下：

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	流通受限类型	可流通日	最后运作日估值单价	数量(单位:股)	最后运作日成本总额	最后运作日估值总额
601138	工业富联	新股锁定	2019-06-10	12.97	70,306	968,113.62	911,868.82
603156	养元饮品	新股锁定	2019-02-13	44.89	52,804	2,969,459.41	2,370,371.56

待锁定期满后，基金管理人将及时变现上述流通受限股票，并于第二次清算时再向基金份额持有人分配。于 2018 年 10 月 30 日，本基金持有的流动受限股票锁定期尚未到期。

2) 因重大事项停牌而未能变现的流通受限股票人民币 2,019,405.00 元，其明细如下：

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	最后运作日估值单价	数量(单位:股)	最后运作日成本总额	最后运作日估值总额
002739	万达电影	2017-07-04	重大事项	22.07	91,500	3,222,847.68	2,019,405.00

待停牌股票复牌后，基金管理人将及时变现上述停牌股票，并于第二次清算时再向基金份额持

有人分配。于 2018 年 10 月 30 日，本基金持有停牌股票尚未复牌。

3) 本基金最后运作日其他股票投资人民币 1,212,049.18 元，其明细如下：

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	最后运作日估值 单价	数量(单 位:股)	最后运作日成本总额	最后运作日估值总额
600019	宝钢股份	7.61	1,000	8,391.74	7,610.00
600028	中国石化	6.72	1,000	5,723.22	6,720.00
600030	中信证券	15.42	1,000	15,554.28	15,420.00
600031	三一重工	8.60	1,000	9,050.50	8,600.00
600036	招商银行	27.90	1,000	27,237.05	27,900.00
600038	中直股份	38.33	1,000	43,694.07	38,330.00
600048	保利地产	11.80	1,000	11,454.12	11,800.00
600068	葛洲坝	6.90	1,000	10,160.00	6,900.00
600153	建发股份	8.02	1,000	8,131.65	8,020.00
600176	中国巨石	9.72	1,000	11,207.83	9,720.00
600201	生物股份	14.96	1,000	15,022.51	14,960.00
600236	桂冠电力	5.77	1,000	6,060.00	5,770.00
600309	万华化学	43.66	1,000	48,287.10	43,660.00
600323	瀚蓝环境	13.59	1,000	13,885.43	13,590.00
600392	盛和资源	8.78	1,000	9,796.25	8,780.00
600452	涪陵电力	15.76	1,000	23,579.26	15,760.00
600498	烽火通信	28.08	1,000	24,041.27	28,080.00
600562	国睿科技	15.78	1,000	20,245.48	15,780.00
600570	恒生电子	52.70	1,000	50,958.63	52,700.00
600579	天华院	8.77	1,000	9,020.22	8,770.00
600583	海油工程	6.32	1,000	5,756.67	6,320.00
600642	申能股份	5.17	1,000	5,048.35	5,170.00
600754	锦江股份	22.27	1,000	30,225.56	22,270.00
600859	王府井	14.95	1,000	16,535.23	14,950.00
600886	国投电力	7.22	1,000	7,958.00	7,220.00
600887	伊利股份	22.64	1,000	17,441.34	22,640.00
600967	内蒙一机	13.93	1,000	12,458.81	13,930.00
601100	恒立液压	21.51	1,000	23,255.40	21,510.00
601288	农业银行	3.60	1,000	3,693.39	3,600.00
601318	中国平安	62.03	1,000	39,746.47	62,030.00
601688	华泰证券	14.41	1,000	18,389.45	14,410.00
601899	紫金矿业	3.35	1,000	3,840.00	3,350.00
603790	雅运股份	10.98	1,591	17,469.18	17,469.18
000001	平安银行	9.88	1,000	8,947.98	9,880.00
000002	万科A	23.46	1,000	23,549.20	23,460.00
000028	国药一致	46.69	1,000	45,116.42	46,690.00
000059	华锦股份	6.67	1,000	6,902.60	6,670.00
000338	潍柴动力	7.62	1,000	5,295.68	7,620.00
000581	威孚高科	18.66	1,000	22,588.62	18,660.00
000858	五粮液	60.38	1,000	64,235.00	60,380.00
000895	双汇发展	23.92	1,000	21,608.52	23,920.00
000998	隆平高科	15.99	1,000	25,620.73	15,990.00
002003	伟星股份	7.52	1,000	8,321.59	7,520.00

股票代码	股票名称	最后运作日估值 单价	数量(单 位:股)	最后运作日成本总额	最后运作日估值总额
002008	大族激光	39.69	1,000	31,442.50	39,690.00
002024	苏宁易购	12.07	1,000	12,085.49	12,070.00
002027	分众传媒	7.59	1,000	9,241.58	7,590.00
002146	荣盛发展	7.82	1,000	10,607.01	7,820.00
002153	石基信息	35.00	1,000	33,837.84	35,000.00
002179	中航光电	42.04	1,000	37,348.84	42,040.00
002343	慈文传媒	11.80	1,000	27,926.64	11,800.00
002389	南洋科技	11.63	1,000	19,957.42	11,630.00
002466	天齐锂业	34.42	1,000	65,576.19	34,420.00
002601	龙鳞佰利	13.06	1,000	15,915.49	13,060.00
300003	乐普医疗	33.27	1,000	19,124.86	33,270.00
300059	东方财富	11.12	1,000	12,792.00	11,120.00
300144	宋城演艺	21.18	1,000	20,332.94	21,180.00
300182	捷成股份	5.91	1,000	6,472.43	5,910.00
300188	美亚柏科	19.31	1,000	18,061.52	19,310.00
300203	聚光科技	23.78	1,000	25,632.40	23,780.00
300408	三环集团	20.97	1,000	21,365.95	20,970.00
300424	航新科技	20.00	1,000	20,836.26	20,000.00
300433	蓝思科技	10.61	1,000	11,351.83	10,610.00
300537	广信材料	10.23	1,000	11,682.50	10,230.00
300595	欧普康视	36.02	1,000	35,042.62	36,020.00

以上股票投资已于自 2018 年 9 月 11 日至 2018 年 10 月 30 日止清算期间处置变现, 实际变现金额为人民币 1,220,456.91 元。

4) 本基金最后运作日债券投资人民币 1,408,280.00 元, 其明细如下:

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	最后运作日估 值单价	数量(单位:张)	最后运作日成本 总额	最后运作日估值总 额
018005	国开1701	100.52	14,000	1,406,700.80	1,407,280.00
128045	机电转债	100.00	10	1,000.00	1,000.00

以上债券已于自 2018 年 9 月 11 日至 2018 年 10 月 30 日止清算期间处置变现, 实际变现金额为人民币 1,431,785.32 元。

(4) 本基金最后运作日应收证券清算款人民币 89,315.36 元, 已于 2018 年 9 月 11 日收回并划入本基金银行存款活期账户。

(5) 本基金最后运作日应收利息人民币 30,779.21 元, 包括应收银行存款利息人民币 6,587.05 元、应收最低备付金利息人民币 1,253.21 元、应收结算保证金利息人民币 31.04 元及应收债券利息人民币 22,907.91 元; 截至 2018 年 10 月 30 日应收利息余额为人民币 2,766.59 元, 包括应收银行存款利息人民币 2,013.33 元、应收最低备付金利息人民币 629.18 元、应收结算保证金利息人民币 124.08 元, 该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 918.14 元，该款项已于 2018 年 9 月 11 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 19,434.90 元，该款项将于第二次清算期间支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 4,858.72 元，该款项已于 2018 年 9 月 21 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 35.94 元，该款项已于 2018 年 9 月 21 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 173,854.35 元，截至 2018 年 10 月 16 日该款项已付清。

(6) 本基金最后运作日应交税费为人民币 3,818.30 元，截至 2018 年 10 月 12 日该款项已付清。

(7) 本基金最后运作日其他负债为人民币 146,745.58 元，为本基金预提的审计费和信息披露费。其中，应付审计费人民币 34,658.47 元为多预提的款项，已于清算期间冲回并计入清算期间的其他收入；应付信息披露费人民币 112,087.11 元，实付金额为人民币 95,000.00 元，截至 2018 年 9 月 17 日该款项已付清，人民币 17,087.11 元为多计提的款项，已于清算期间冲回并计入清算期间的其他收入。

3、清算期间的清算损益情况

项目	单位：人民币元
	自2018年9月11日至 2018年10月30日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入(注1)	4,709.79
2、投资收益	-52,099.95
3、公允价值变动损益	-604,406.29
其中：已变现证券公允价值变动损益	59,510.73
流通受限证券公允价值变动损益	-663,917.02
4、其他收入(注2)	51,745.58
清算收入小计	-600,050.87
二、清算费用	
1、交易费用	2,227.50
2、账户维护费	9,000.00
清算费用小计(注3)	11,227.50
三、清算净收益	-611,278.37

注 1：利息收入系计提的自 2018 年 9 月 11 日至 2018 年 10 月 30 日止清算期间的银行存款利息、

最低备付金利息、结算保证金利息、债券利息，该款项将于第二次清算款划出日由基金管理人红塔红土基金公司以自有资金垫付，基金管理人垫付的资金将于清算期后银行结息日后返还给基金管理人。

注 2：其他收入为冲销多预提的审计费人民币 34,658.47 元及冲销多预提的信息披露费人民币 17,087.11 元。

注 3：经本基金管理人红塔红土基金公司确认，考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，除上述交易费用和账户维护费外，其他与本次清算相关的清算费用由本基金管理人承担，不从基金财产中支付。

4、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2018年9月10日基金净资产	10,346,634.24
加：清算期间净收益	-611,278.37
二、2018年10月30日基金净资产	9,735,355.87
其中：非受限基金净资产金额	5,097,627.51
受限基金净资产金额	4,637,728.36

资产处置及负债清偿后，于 2018 年 10 月 30 日本基金剩余财产为人民币 9,735,355.87 元，根据本基金的基金合同约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用（本基金清算费用由基金管理人承担）、缴纳所欠税款(如有)并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配：

非受限基金净资产金额人民币 5,097,627.51 元，其中：银行存款金额为人民币 4,988,756.83 元，将于第一次清算时按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配；结算备付金、存出保证金、应收利息金额为人民币 128,305.58 元，将于第二次清算时向基金份额持有人进行分配，于第二次清算款划出日如有未变现部分，则由基金管理人红塔红土基金公司以自有资金垫付；应付管理人报酬金额为人民币 19,434.90 元，将于第二次清算期间支付。

受限基金净资产金额人民币 4,637,728.36 元（该金额为停牌股票和新股锁定期内股票于报告日的估值金额，与停牌股票资产复牌后、新股锁定期满后实际变现金额可能存在差异），将根据变现情况在第二次清算期间按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

因清算款划出日不能确定，暂不能准确预估银行存款、结算备付金、存出保证金自清算结束日至第二次清算款划出日前一日期间产生的利息，该期间利息亦属基金份额持有人所有，将于第二次清算结束时按基金份额持有人持有的基金份额比例向基金份额持有人分配，其中未变现部分连同结算备付金、存出保证金的未变现部分均由基金管理人红塔红土基金公司于第二次清算款划出日以自

有资金垫付，基金管理人垫付的资金以及垫付资金产生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

六、备查文件

1、备查文件目录

- (1) 红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金清算审计报告
- (2) 红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金财产清算的法律意见书

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：广州市天河区珠江新城华夏路 1 号

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

特此公告

红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金财产清算小组

2018 年 12 月 25 日