
红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 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：2021 年 3 月 31 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 2021 年 3 月 22 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 2020 年 4 月 9 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19
§6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	54
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.....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	55

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国债期货交易情况说明	55
8.11 投资组合报告附注	56
§ 9 基金份额持有人信息.....	57
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
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
§ 10 开放式基金份额变动.....	59
§ 11 重大事件揭示.....	60
11.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4 基金投资策略的改变	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
11.8 其他重大事件	61
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
12.1 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	64
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§13 备查文件目录.....	65
13.1 备查文件目录	65
13.2 存放地点	65
13.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金	
基金简称	红塔红土盛平中短债债券	
基金主代码	008815	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 9 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	221,696,586.61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	红塔红土盛平中短债债券 A	红塔红土盛平中短债债券 C
下属分级基金的交易代码:	008815	008816
报告期末下属分级基金的份额总额	218,678,809.58 份	3,017,777.03 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，力求获得超越业绩比较基准的投资回报，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在充分考虑基金资产的安全性、收益性及流动性及严格控制风险的前提下，通过分析经济周期变化、货币政策、债券供求等因素，持续研究债券市场运行状况、研判市场风险，制定债券投资策略，挖掘价值被低估的标的券种，力争实现超越业绩基准的投资收益。 本基金的投资策略包括资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、可转债投资策略。
业绩比较基准	中债总财富（1-3 年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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	段皓静
	联系电话	0755-33372133
	电子邮箱	htservice@htamc.com.cn
客户服务电话	4001-666-916（免长途话费）	95511-3
传真	0755-33379007	0755-82080387
注册地址	深圳市前海深港合作区前	广东省深圳市罗湖区深南东路

	湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)	5047号
办公地址	深圳市南山区侨香路4068号智慧广场A栋801	深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座
邮政编码	518053	518001
法定代表人	李凌	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.htamc.com.cn
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	2020 年 4 月 9 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日	
	红塔红土盛平中短债债券 A	红塔红土盛平中短债债券 C
本期已实现收益	5,036,075.49	20,984.53
本期利润	5,277,230.67	36,731.95
加权平均基金份额本期利润	0.0129	0.0210
本期加权平均净值利润率	1.29%	2.10%
本期基金份额净值增长率	1.69%	1.51%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	
期末可供分配利润	1,191,488.91	14,313.61
期末可供分配基金份额利润	0.0054	0.0047
期末基金资产净值	220,828,097.84	3,045,298.15
期末基金份额净值	1.0098	1.0091
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	
基金份额累计净值增长率	1.69%	1.51%

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、本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 9 日，截止报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

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

红塔红土盛平中短债债券 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
过去三个月	1.03%	0.03%	0.87%	0.03%	0.16%	0.00%
过去六个月	1.46%	0.02%	0.68%	0.04%	0.78%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.69%	0.02%	-0.05%	0.05%	1.74%	-0.03%

红塔红土盛平中短债债券 C

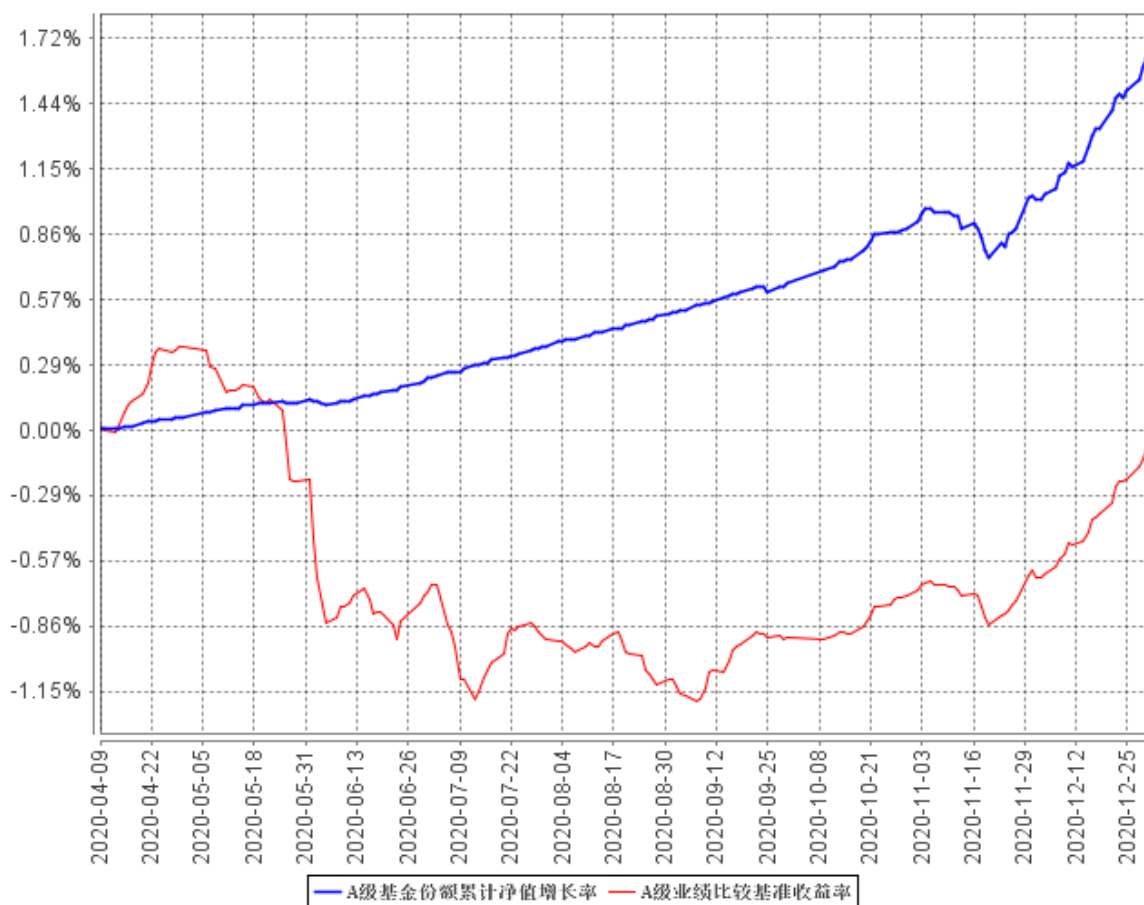
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去三个月	0.97%	0.03%	0.87%	0.03%	0.10%	0.00%
过去六个月	1.34%	0.02%	0.68%	0.04%	0.66%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.51%	0.02%	-0.05%	0.05%	1.56%	-0.03%

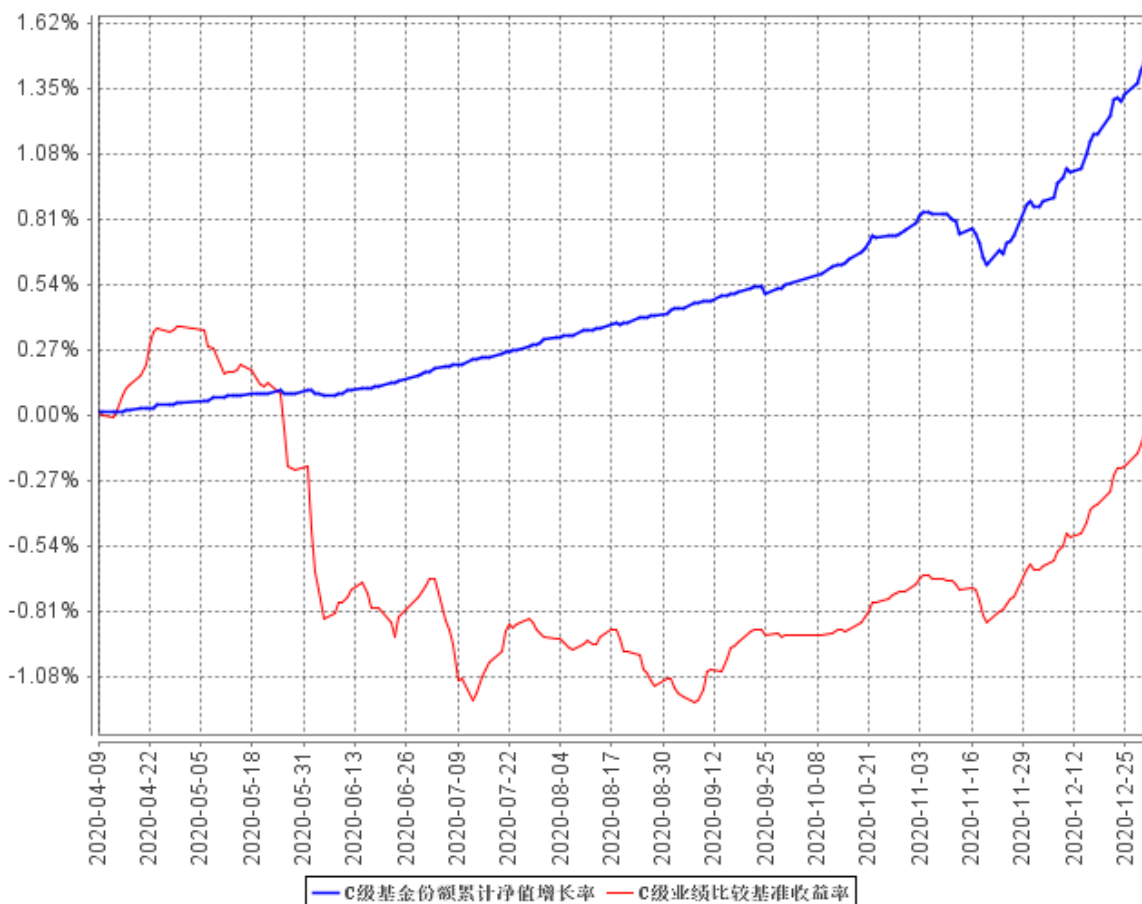
注：本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 9 日，截止报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

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

A级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



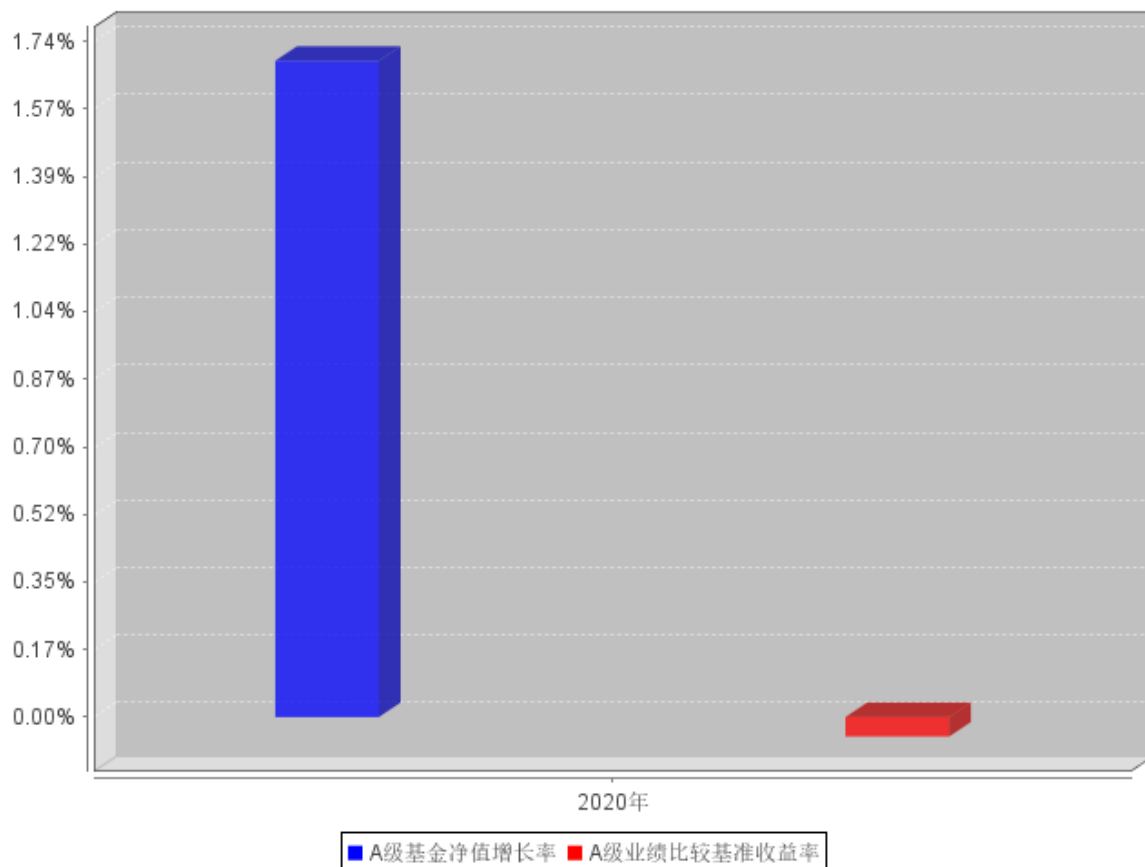
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



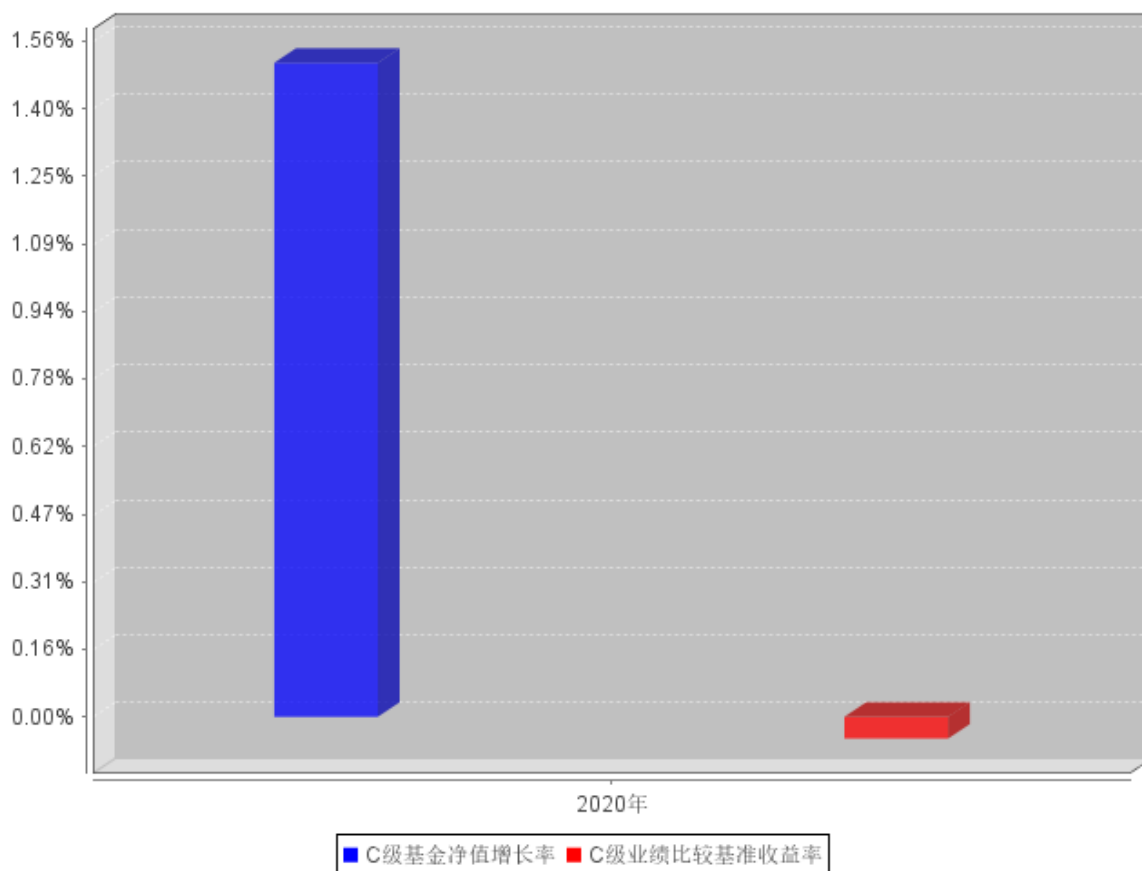
注：本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 9 日，截止报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

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

A级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



C级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



注：1、本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 9 日，截止报告期末，本基金基金合同生效不满一年；

2、基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

红塔红土盛平中短债债券 A					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020	0.0700	2,936,627.26	0.07	2,936,627.33	注：-
合计	0.0700	2,936,627.26	0.07	2,936,627.33	注：-

单位：人民币元

红塔红土盛平中短债债券 C					
年度	每 10 份基金	现金形式发放总额	再投资形式发放	年度利润分配合	备注

	份额分红数		总额	计	
2020	0.0600	18,092.94	12.00	18,104.94	注：-
合计	0.0600	18,092.94	12.00	18,104.94	注：-

§ 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2020年12月31日，公司有员工66人，其中43人具有硕士或博士学位；截止2020年12月31日，公司管理12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	2020年4月9日	-	20	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，现任研究部总监、总经理助理。
罗薇	基金经理	2020年4月9日	2020年11月5日	8	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：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。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；

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《红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金》、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内的公平交易模块，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

2020 年是中国全面建成小康社会和“十三五”规划的收官之年，但突发的新冠肺炎疫情冲击着整个全球经济，对经济社会发展带来了巨大的挑战。中国经济处于经济增速换挡期、结构调整阵痛期和前期政策消化期的“三期叠加”，但在这样的背景下，中国为全世界交出了高质量的答卷，成为 2020 年唯一实现 GDP 正增长的主要经济体。

二季度以来，我国经济逐步从新冠肺炎疫情的影响中走出，工业企业复工率大幅回升，制造业 PMI 连续高于 50%荣枯线，景气度大幅回升，在海外受到疫情影响逐步深化的过程中，中国对外出口替代持续强于预期；部分服务型行业受疫情影响较深，主要包括餐饮、娱乐、教育等传统

服务业；批发零售、交通运输、酒店住宿等行业，截止 2020 年底仍然未完全恢复，居民消费受到一定挤压。上半年通胀呈现前高后低，高位回落态势。前期冲高主要受春节错位和突发疫情冲击影响，随着疫情短期冲击逐步消散和猪肉价格供给恢复，CPI 连续下降，通胀压力减轻，有望于 2020 年底看到企稳态势，但展望 2021 年，随着全球放水持续，以大宗商品、原油为主的通胀代表逐步走高，给市场造成一定的通胀担忧。

疫情突发冲击后，国内财政货币双管齐下，债市快速走牛，收益率不断突破新低；而伴随国内疫情得到控制、生产活动有序恢复，央行逐步退出超常规宽松，债券市场随即调整，而经济数据、破净赎回、股市表现也对债市的调整起到推波助澜的作用。

回顾 2020 年，本基金成立于 2020 年 4 月，考虑到债券市场在资金宽松之下已处于高位，基金采取保守的久期和杠杆策略，低杠杆久期品种为主要配置方向，尽量回避债券市场调整可能造成的业绩波动，2020 年下半年，产品规模波动较大，为应对赎回压力，保持产品高流动性的基础上，整体操作谨慎为主，避开了利率调整对净值的影响，为基金业绩产生较好贡献。

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盛平中短债债券 A 基金份额净值为 1.0098 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.69%；截至本报告期末红塔红土盛平中短债债券 C 基金份额净值为 1.0091 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.51%；同期业绩比较基准收益率为-0.05%。

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 2021 年，我国经济的走势大概率出现前高后低的态势，对利率短期保持中性谨慎，长期保持乐观。因此，本基金仍将维持较短久期、低杠杆的策略，并保证产品流动性。整体看，信用周期大概率已于 2020 年四季度见顶，而经济周期预计将同步见顶于二季度或三季度。全球进入疫苗接种期，发达国家在 2021 年二季度完成大部分人接种后疫情将受到控制，但不排除变异可能带来的黑天鹅事件。预计从 2021 年二季度开始，通胀将在海外补库存和疫情后周期复苏环节中快速体现，叠加国内通胀翘尾因素逐级走高，预计二季度货币市场会逐步加大收紧预期。综合看，GDP 增速将在疫情期间再下台阶，潜在经济增速对应的无风险收益也将整体回落，但在防止经济过热的基础上，流动性偏向边际收紧，预计 2021 年中期仍面临利率上行压力。

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

本基金管理人分别与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其分别提供银行间同业市场、交易所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

本基金于 2020 年 10 月 30 日对 A 类基金份额持有人按每 10 份基金份额分配人民币 0.07 元进行分红，其中现金形式发放总额人民币 2,936,627.26 元，再投资形式发放总额人民币 0.07 元，实际分配收益为人民币 2,936,627.33 元；对 C 类基金份额持有人按每 10 份基金份额分配人民币 0.06 元进行分红，其中现金形式发放总额人民币 18,092.94 元，再投资形式发放总额人民币 12.00 元，实际分配收益为人民币 18,104.94 元。

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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 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（2021）审字第 61014670_H10 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	红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，自 2020 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金的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平中短债债券型证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2020 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时,管理层负责评估红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,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。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能</p>

	<p>导致红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
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）
注册会计师的姓名	吴翠蓉 陈玥婷
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	2021 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	3,121,674.59
结算备付金		55,383.44
存出保证金		2,317.09
交易性金融资产	7.4.7.2	188,608,450.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		188,608,450.00
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	60,000,210.00
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	2,190,970.15
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		253,979,005.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
负债：		
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		29,999,755.00
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		32,951.76
应付托管费		10,983.94
应付销售服务费		643.21
应付交易费用	7.4.7.7	5,486.95
应交税费		-
应付利息		5,788.42

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	50,000.00
负债合计		30,105,609.28
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	221,696,586.61
未分配利润	7.4.7.10	2,176,809.38
所有者权益合计		223,873,395.99
负债和所有者权益总计		253,979,005.27

注：1、报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 221,696,586.61 份，其中红塔红土盛平中短债债券 A 基金份额净值 1.0098 元，份额总额 218,678,809.58 份；红塔红土盛平中短债债券 C 基金份额净值 1.0091 元，份额总额 3,017,777.03 份；

2、本基金合同于 2020 年 4 月 9 日生效。本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2020 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止。因此，无上年度可比期间财务报表数据。

7.2 利润表

会计主体：红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 4 月 9 日（基金合同生效日） 至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		6,658,794.35
1.利息收入		6,851,370.31
其中：存款利息收入	7.4.7.11	151,057.01
债券利息收入		3,279,852.65
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		3,420,460.65
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-449,498.28
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-449,498.28
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	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	256,902.60

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	19.72
减：二、费用		1,344,831.73
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	910,313.92
2. 托管费	7.4.10.2.2	303,437.97
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	3,201.49
4. 交易费用	7.4.7.19	8,438.54
5. 利息支出		56,639.81
其中：卖出回购金融资产支出		56,639.81
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.20	62,800.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,313,962.62
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,313,962.62

注：本基金合同于 2020 年 4 月 9 日生效。本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2020 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止。因此，无对比期间财务报表数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2020 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）	650,092,877.94	-	650,092,877.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,313,962.62	5,313,962.62
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）	-428,396,291.33	-182,420.97	-428,578,712.30
其中：1. 基金申购款	251,752,108.21	1,424,981.43	253,177,089.64
2. 基金赎回款	-680,148,399.54	-1,607,402.40	-681,755,801.94
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	-	-2,954,732.27	-2,954,732.27

“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	221,696,586.61	2,176,809.38	223,873,395.99

注：本基金合同于 2020 年 4 月 9 日生效。本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2020 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止。因此，无对比期间财务报表数据。

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：

_____ 饶雄	_____ 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

红塔红土盛平中短债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”）2019 年 7 月 2 日下发的证监许可[2019]1192 号文《关于准予红塔红土盛平中短债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 2020 年 1 月 2 日至 2020 年 4 月 2 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（2020）验字第 61014670_H02 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 2020 年 4 月 9 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，基金托管人为平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券（包括超短期融资券）、次级债、可转债（不包括可分离交易可转债，但包括可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、国债期货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）。本基金对可转债、可交换债的投资仅限于一级市场申购，且申购获得的可转债、可交换债不得转换成股票。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，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中短债主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产

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：中债总财富（1-3 年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%。

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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集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〈年度报告和中期报告〉》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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2020 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间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

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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。唯本期财务报表的实际编制期间系自 2020 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2020 年 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。

本基金持有的债券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；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

(2) 与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(3) 不存在活跃市场的金融工具，应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确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(4) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值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，按最能反映公允价值的方法估值；

(5) 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及应由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，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及应由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，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扣除应由基金管理人缴纳的增值税后的净额入账；

(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 0.30% 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 0.10% 的年费率逐日计提；

(3) 基金销售服务费：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25% 年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购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) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

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) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；选择红利再投资的，基金份额的现金红利将按红利派发日的该类基金份额净值折算成基金份额，红利再投资的份额免收申购费。若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择不同的分红方式，同一投资者持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式

为准；

(2) 基金收益分配后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；

(3) 本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 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

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 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。

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) 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。

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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	3,121,674.59	-
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	3,121,674.59	-

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	9,581,414.22	8,035.78
	银行间市场	178,770,133.18	248,866.82

	合计	188,351,547.40	188,608,450.00	256,902.60
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	188,351,547.40	188,608,450.00	256,902.60
项目	上年度末 2019年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	-	-	-

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

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 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	60,000,210.00	-
合计	60,000,210.00	-
项目	上年度末 2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	964.45	-
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	27.39	-
应收债券利息	2,172,761.92	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	17,215.29	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	1.10	-
合计	2,190,970.15	-

注：其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	5,486.95	-
合计	5,486.95	-

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	50,000.00	-
合计	50,000.00	-

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

红塔红土盛平中短债债券 A		
项目	本期 2020 年 4 月 9 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	650,032,685.85	650,032,685.85
本期申购	248,731,298.61	248,731,298.61
本期赎回(以“-”号填列)	-680,085,174.88	-680,085,174.88
- 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	218,678,809.58	218,678,809.58

金额单位：人民币元

红塔红土盛平中短债债券 C		
项目	本期 2020 年 4 月 9 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	60,192.09	60,192.09
本期申购	3,020,809.60	3,020,809.60
本期赎回(以“-”号填列)	-63,224.66	-63,224.66
- 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	3,017,777.03	3,017,777.03

注：本期申购包含红利再投份额及金额，本期赎回包含基金转出份额及金额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

红塔红土盛平中短债债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	5,036,075.49	241,155.18	5,277,230.67
本期基金份额交易产生的变动数	-907,959.25	716,644.17	-191,315.08
其中：基金申购款	1,158,131.93	257,798.11	1,415,930.04
基金赎回款	-2,066,091.18	458,846.06	-1,607,245.12
本期已分配利润	-2,936,627.33	-	-2,936,627.33

本期末	1,191,488.91	957,799.35	2,149,288.26
-----	--------------	------------	--------------

单位：人民币元

红塔红土盛平中短债债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	20,984.53	15,747.42	36,731.95
本期基金份额交易产生的变动数	11,434.02	-2,539.91	8,894.11
其中：基金申购款	11,599.29	-2,547.90	9,051.39
基金赎回款	-165.27	7.99	-157.28
本期已分配利润	-18,104.94	-	-18,104.94
本期末	14,313.61	13,207.51	27,521.12

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
	2020年4月9日(基金合同生效日)至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	113,336.97	-
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	37,706.66	-
其他	13.38	-
合计	151,057.01	-

注：其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：无。

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

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 2020年4月9日(基金合 同生效日)至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-449,498.28	-
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	-449,498.28	-

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 2020年4月9日(基金合 同生效日)至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	516,512,912.12	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	510,253,102.60	-
减：应收利息总额	6,709,307.80	-
买卖债券差价收入	-449,498.28	-

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

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：无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

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：无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：无。

7.4.7.16 股利收益

注：无。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年4月9日(基金合 同生效日)至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
1. 交易性金融资产	256,902.60	-
——股票投资	-	-
——债券投资	256,902.60	-
——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	-	-
减：应税金融商品公允价 值变动产生的预估增 值税	-	-
合计	256,902.60	-

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月9日(基金合同 生效日)至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
基金赎回费收入	19.71	-
基金转换费收入	0.01	-
合计	19.72	-

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月9日(基金合同 生效日)至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
交易所市场交易费用	123.54	-
银行间市场交易费用	8,315.00	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	8,438.54	-

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月9日(基金合同 生效日)至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
审计费用	50,000.00	-
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
银行间账户维护费	12,000.00	-
其他	800.00	-
合计	62,800.00	-

注：其他为开户手续费和上清所账户查询费。

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

截至财务报表批准日，本基金无需要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
平安银行	基金托管人
红塔证券股份有限公司（“红塔证券”）	基金管理人的股东
深圳市创新投资集团有限公司	基金管理人的股东
北京市华远集团有限公司	基金管理人的股东
深圳市红塔资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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

注：无。

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月9日(基金合同生效日)至 2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	27,941,123.32	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 2020年4月9日(基金合同生效日)至 2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	5,741,700,000.00	100.00%	-	-

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

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 2020年4月9日(基金合同生效 日)至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日	
	当期发生的基金应支付 的管理费	910,313.92	-	-
其中：支付销售机构的客 户维护费	109.20	-	-	-

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0.30%年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月9日(基金合同生效 日)至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日	
	当期发生的基金应支付 的托管费	303,437.97	-	-

注：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0.10%的年费率计

提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

7.4.10.2.3 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 2020 年 4 月 9 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	红塔红土盛平中短 债债券 A	红塔红土盛平中短 债债券 C	合计
红塔红土基金公司	-	3,141.97	3,141.97
合计	-	3,141.97	3,141.97
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	红塔红土盛平中短 债债券 A	红塔红土盛平中短 债债券 C	合计
合计	-	-	-

注：A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

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：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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

红塔红土盛平中短债债券 C				
关联方名称	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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
深圳市红塔资产管理有限公司	2,991,026.92	1.3500%	-	-

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。

7.4.10.6 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 2020 年 4 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	3,121,674.59	113,336.97	-	-

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：无。

7.4.11 利润分配情况

红塔红土盛平中短债债券A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					

1	2020 年 10 月 30 日	-	2020 年 10 月 30 日	0.0700	2,936,627.26	0.072	2,936,627.33	
合计	-	-		0.0700	2,936,627.26	0.072	2,936,627.33	

红塔红土盛平中短债债券 C

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2020 年 10 月 30 日	-	2020 年 10 月 30 日	0.0600	18,092.94	12.00	18,104.94	
合计	-	-		0.0600	18,092.94	12.00	18,104.94	

7.4.12 期末（2020 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

注：无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 29,999,755.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期 日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
160015	16 付息国 债 15	2021 年 1 月 13 日	100.08	200,000	20,016,000.00
180211	18 国开 11	2021 年 1 月 13 日	101.90	100,000	10,190,000.00
190214	19 国开 14	2021 年 1 月 13 日	100.19	10,000	1,001,900.00
合计				310,000	31,207,900.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	41,932,400.00	-
合计	41,932,400.00	-

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小于一年的国债，政策性金融债。

3、债券投资以净价列示。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	38,944,000.00	-
合计	38,944,000.00	-

7.4.13.2.4 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	107,732,050.00	-
合计	107,732,050.00	-

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风

险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，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资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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 2020 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							
银行存款	3,121,674.59	-	-	-	-	-	3,121,674.59
结算备付金	55,383.44	-	-	-	-	-	55,383.44
存出保证金	2,317.09	-	-	-	-	-	2,317.09
交易性金融资产	-	-116,483,650.00	72,124,800.00	-	-	-	-188,608,450.00
买入返售金融资产	60,000,210.00	-	-	-	-	-	60,000,210.00
应收利息	-	-	-	-	-	2,190,970.15	2,190,970.15
资产总计	63,179,585.12	-116,483,650.00	72,124,800.00	-	-	-2,190,970.15	253,979,005.27
负债							
卖出回购金融资产款	29,999,755.00	-	-	-	-	-	29,999,755.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	32,951.76	32,951.76
应付托管费	-	-	-	-	-	10,983.94	10,983.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-	643.21	643.21
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,486.95	5,486.95
应付利息	-	-	-	-	-	5,788.42	5,788.42
其他负债	-	-	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	29,999,755.00	-	-	-	-	105,854.28	30,105,609.28
利率敏感度缺口	33,179,830.12	-116,483,650.00	72,124,800.00	-	-	不适用	不适用
上年度末 2019 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							
资产总计	-	-	-	-	-	-	-
负债							

负债总计	-	-	-	-	-	-	-
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-	-	-

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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-489,806.18	-
市场利率下降 25 个基点	492,680.50	-	

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

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 2020年12月31日		上年度末 2019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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	188,608,450.00	84.25	-	-

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	188,608,450.00	84.25	-	-

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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	1. 本基金业绩比较基准上升 5%	1,340,533.85	-
2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-1,340,533.85	-	

注：本基金业绩比较基准=中债总财富（1-3 年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

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、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 2020 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无划分为第一层次的余额，划分为第二层次的余额为人民币 188,608,450.00 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	188,608,450.00	74.26
	其中：债券	188,608,450.00	74.26
	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	60,000,210.00	23.62
	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	3,177,058.03	1.25
8	其他各项资产	2,193,287.24	0.86
9	合计	253,979,005.27	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

注：无。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

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

注：无。

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：无。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：无。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：无。

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	25,555,050.00	11.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	124,109,400.00	55.44
	其中：政策性金融债	124,109,400.00	55.44
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	38,944,000.00	17.40
9	其他	-	-
10	合计	188,608,450.00	84.25

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	160015	16 付息国债 15	200,000	20,016,000.00	8.94
2	200211	20 国开 11	200,000	19,920,000.00	8.90
3	180211	18 国开 11	100,000	10,190,000.00	4.55
4	200313	20 进出 13	100,000	10,084,000.00	4.50
5	190202	19 国开 02	100,000	10,046,000.00	4.49

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：无。

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：无。

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：无。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.10.1 本期国债期货投资政策**

注：无。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

8.10.3 本期国债期货投资评价

注：无。

8.11 投资组合报告附注**8.11.1 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**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

8.11.2 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**8.11.3 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	2,317.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,190,970.15
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,193,287.24

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

8.11.6 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。

§ 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

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
红塔红土盛平中短债债券 A	181	1,208,170.22	218,580,289.84	99.95%	98,519.74	0.05%
红塔红土盛平中短债债券 C	98	30,793.64	2,991,026.92	99.11%	26,750.11	0.89%
合计	279	794,611.42	221,571,316.76	99.94%	125,269.85	0.06%

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。

9.2 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	红塔红土盛平中短债债券 A	8,755.55	0.0040%
	红塔红土盛平中短债债券 C	720.54	0.0239%
	合计	9,476.09	0.0043%

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）。

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	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	红塔红土盛平中短债债券 A	0~10
	红塔红土盛平中短债债券 C	0

	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	红塔红土盛平中短债债券 A	0~10
	红塔红土盛平中短债债券 C	0
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	红塔红土盛平中短 债债券 A	红塔红土盛平中短 债债券 C
基金合同生效日（2020 年 4 月 9 日）基金 份额总额	650,032,685.85	60,192.09
基金合同生效日起至报告期期末基金总申 购份额	248,731,298.61	3,020,809.60
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总 赎回份额	680,085,174.88	63,224.66
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分 变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	218,678,809.58	3,017,777.03

§ 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：

2020 年 3 月 12 日起，李凌先生担任公司董事长，饶雄先生不再担任公司董事长；饶雄先生担任公司总经理，刘辉先生不再担任公司总经理；李凌不再担任公司督察长，仍代为履行督察长职务。2020 年 8 月 22 日起，段皓静女士担任公司督察长，李凌先生不再代为履行督察长职务。上述人事变动均由公司董事会审议通过，并按相关规定备案、公告。

本报告期内，基金托管人的专门基金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 50,000.00 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	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-

财富证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-

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	27,941,123.32	100.00%	5,741,700,000.00	100.00%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

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	红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年4月10日
2	红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年5月7日
3	红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020年7月21日
4	红塔红土基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年7月21日
5	关于红塔红土基金管理有限公司旗下基金参与华鑫证券有限责任公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020年8月12日

6	红塔红土基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 8 月 22 日
7	关于终止红塔红土基金 APP 手机客户端运营及维护服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 8 月 28 日
8	红塔红土基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 8 月 31 日
9	红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金 2020 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 8 月 31 日
10	红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金(红塔红土盛平中短债债券 A 份额)基金产品资料概要(更新)	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 8 月 31 日
11	红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金(红塔红土盛平中短债债券 C 份额)基金产品资料概要(更新)	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 8 月 31 日
12	关于红塔红土基金管理有限公司旗下基金参与红塔银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 9 月 1 日
13	红塔红土基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 10 月 28 日
14	红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 10 月 28 日
15	红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 10 月 29 日
16	红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 11 月 5 日
17	红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金招募说明书及产品资料概要更新的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 11 月 9 日
18	红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金更新招募说明书(2020 年 1 号)	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 11 月 9 日
19	红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金(红塔红土盛平	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 11 月 9 日

	中短债债券 A 份额) 基金产品资料概要 (更新)		
20	红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金 (红塔红土盛平中短债债券 C 份额) 基金产品资料概要 (更新)	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 11 月 9 日
21	关于终止泰诚财富基金销售 (大连) 有限公司和大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 11 月 10 日
22	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 12 月 12 日
23	关于红塔红土基金管理有限公司旗下基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 12 月 25 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2020-04-03 至 2020-11-16	-	299,999,000.00	299,999,000.00	0.00	0.00%
	2	2020-05-13 至 2020-07-29	-	99,999,000.00	99,999,000.00	0.00	0.00%
	3	2020-11-17 至 2020-12-28	-	49,804,761.43	10,000,000.00	39,804,761.43	17.95%
	4	2020-11-17 至 2020-12-28	-	49,804,761.43	10,000,000.00	39,804,761.43	17.95%
	5	2020-11-17 至 2020-12-28	-	49,804,761.43	10,000,000.00	39,804,761.43	17.95%
	6	2020-12-29 至 2020-12-31	-	99,166,005.55	-	99,166,005.55	44.73%
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。							

12.2 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、红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金基金合同；
- 3、红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金托管协议；
- 4、红塔红土盛平中短债债券型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

2021 年 3 月 31 日