

红塔红土稳健回报灵活配置混合型 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：2022年12月23日

报告公告日期：2022年12月28日

目 录

一、重要提示	3
二、基金概况	4
三、基金运作情况概述	5
四、财务会计报告	6
五、清算情况	7
六、备查文件	10

一、重要提示

红塔红土稳健回报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]2265号《关于准予红塔红土稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》以及2017年2月8日机构部函[2017]306号文《关于红塔红土稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金延期募集备案的回函》注册并公开募集，自2017年3月24日起基金合同生效，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《中华人民共和国证券投资基金法》第四十七条的规定，“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权：（二）决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同”；第八十条规定，“有下列情形之一的，基金合同终止：（二）基金份额持有人大会决定终止”。根据《红塔红土稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的“二、《基金合同》的终止事由”中约定，“有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的”。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条第二款的规定，“基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效”。

为召集基金份额持有人大会审议《关于终止红塔红土稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》，基金管理人已于2022年10月17日刊登了《关于以通讯方式召开红塔红土稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，并于2022年10月18日、2022年10月19日连续刊登了提示性公告。本次基金份额持有人大会已于2022年10月19日至2022年11月18日对本次会议议案进行了投票表决，根据2022年11月21日的计票结果，本次基金份额持有人大会会议议案获得通过，本次基金份额持有人大会决议自2022年11月21日起生效。基金管理人于2022年11月22日刊登了《红塔红土基金管理有限公司关于红塔红土稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于2022年12月5日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

二、基金概况

基金名称	红塔红土稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	红塔红土稳健回报	
基金主代码	002023	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年3月24日	
最后运作日（2022-11-22） 基金份额总额	1,216,269.35份	
投资目标	通过投资财务稳健、业绩良好、管理规范的公司，力争每年获得较高的绝对回报。	
投资策略	<p>本基金以自上而下的投资策略，灵活配置大类资产，动态控制组合风险，力争长期、稳定的绝对回报。</p> <p>本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行各大类资产中的个股、个券精选。具体包括大类资产配置策略，股票投资策略，固定收益类资产投资策略，股指期货投资策略，权证投资策略，存托凭证投资策略等。</p>	
业绩比较基准	沪深300指数×55%+中债总指数（财富）×45%	
基金管理人名称	红塔红土基金管理有限公司	
基金托管人名称	广州农村商业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	红塔红土稳健回报A	红塔红土稳健回报C
下属分级基金的交易代码	002023	002024
最后运作日（2022-11-22） 下属分级基金的份额总额	921,475.89份	294,793.46份

三、基金运作情况概述

红塔红土稳健回报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(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2265号《关于准予红塔红土稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》以及2017年2月8日机构部函[2017]306号文《关于红塔红土稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金延期募集备案的回函》注册,由红塔红土基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《红塔红土稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币110,336,608.46元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2017)验字第61014670_H01号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《红塔红土稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2017年3月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为110,349,051.73份基金份额,其中认购资金利息折合12,443.27份基金份额。本基金的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。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,003,150.00份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《红塔红土稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《红塔红土稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有较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)、存托凭证、固定收益类资产(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款及现金等)、衍生工具(股指期货、权证),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。基金的投资组合比例为:股票及存托凭证投资占基金资产的比例为0%-95%;债券等固定收益类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0%-3%;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%+中证

总指数(财富)*45%。

自 2017 年 3 月 24 日至 2022 年 11 月 22 日期间，本基金按基金合同正常运作。

根据《红塔红土稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》，本基金基金份额持有人大会于 2022 年 10 月 19 日至 2022 年 11 月 18 日以通讯方式召开，于 2022 年 11 月 21 日表决通过了《关于终止红塔红土稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》。根据本基金基金份额持有人大会通过的议案及议案说明，2022 年 11 月 22 日为本基金最后运作日，从 2022 年 11 月 23 日起本基金进入清算期。

四、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表(已经审计)

会计主体：红塔红土稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 11 月 22 日

单位：人民币元

资产	本期末 2022 年 11 月 22 日 (基金最后运作日)
资产：	
银行存款	557,121.23
结算备付金	123,143.94
存出保证金	51,676.55
交易性金融资产	424,540.07
其中：股票投资	323,469.00
债券投资	101,071.07
应收清算款	127,337.49
应收申购款	-
其他资产	-
资产总计	1,283,819.28
负债：	

卖出回购金融资产款	-
应付清算款	-
应付赎回款	10.04
应付管理人报酬	1,610.24
应付托管费	301.91
应付销售服务费	40.42
应交税费	-
其他负债	103,979.92
负债合计	105,942.53
净资产：	
实收基金	1,216,269.35
未分配利润	-38,392.60
净资产合计	1,177,876.75
负债和净资产总计	1,283,819.28

注：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《资产管理产品相关会计处理规定》等有关规定编制的。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2022年11月23日至2022年12月23日止清算期间，红塔红土稳健回报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。具体清算情况如下：

1、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币557,121.23元，其中应计利息为人民币567.26元，应计利息已于2022年12月21日划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币123,143.94元，其中上海结算备付金为人民币113,733.24元，应计利息为人民币227.65元，部分上海结算备付金69,597.13元已于2022年12月2日划入托管账户，应计利息已于2022年12月21日划入托管账户；深圳结算备付金为人民币9,410.70元，应计利息为人民币29.98元，部分深圳结算备付金5,399.65元已于2022年12月2

日划入托管账户，应计利息已于 2022 年 12 月 21 日划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 51,676.55 元，其中上海存出保证金为人民币 31,553.56 元，应计利息为人民币 102.38 元，部分上海存出保证金 2,527.06 元已于 2022 年 12 月 2 日划入托管账户，应计利息已于 2022 年 12 月 21 日划入托管账户；深圳存出保证金为人民币 20,122.99 元，应计利息为人民币 104.74 元，部分深圳存出保证金 2,594.23 元已于 2022 年 12 月 2 日划入托管账户，应计利息已于 2022 年 12 月 21 日划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 424,540.07 元，其中股票投资为人民币 323,469.00 元，债券投资为人民币 101,071.07 元，均已在清算期间变现完毕。

(5) 本基金最后运作日应收清算款为人民币 127,337.49 元，该款项已于 2022 年 11 月 23 日划入托管账户。

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 10.04 元，该款项已于 2022 年 11 月 23 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,610.24 元，该款项已于 2022 年 12 月 5 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 301.91 元，该款项已于 2022 年 12 月 5 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 40.42 元，该款项已于 2022 年 12 月 5 日支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币 103,979.92 元。其中，应付持有人大会公证费为人民币 10,000.00 元，已于 2022 年 12 月 14 日支付；应付持有人大会律师费用为人民币 40,000.00 元，已于 2022 年 12 月 14 日支付；应付审计费为人民币 40,000.00 元，已于 2022 年 12 月 14 日支付；应付银行间账户维护费为人民币 6,000.00 元，已于 2022 年 11 月 30 日支付；应付交易费用为人民币 7,979.92 元，已于 2022 年 12 月 14 日支付。

3、 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2022 年 11 月 23 日至 2022 年 12 月 23 日止清算期间
一、清算收益	
1. 利息收入（注 1）	495.97
2. 投资收益	43,697.78
3. 公允价值变动损益	-37,911.75

清算收入小计	6,282.00
二、清算费用	
1. 律师费	10,000.00
2. 账户费用（注2）	200.00
清算费用小计	10,200.00
三、清算净收益	-3,918.00

注1：利息收入系计提的自2022年11月23日至2022年12月23日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。其中，银行存款利息收入为人民币332.07元，已于2022年12月21日银行结息日收回人民币300.60元；存出保证金利息收入为人民币66.88元，已于2022年12月21日银行结息日收回人民币60.64元；结算备付金利息收入为人民币97.02元，已于2022年12月21日银行结息日收回人民币90.54元。

注2：账户费用系清算期间本基金支付的上交所账户查询费。

4、剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2022年11月22日基金净资产	1,177,876.75
加：清算期间净收益	-3,918.00
减：基金赎回及转出金额（于2022年11月23日确认的投资者赎回申请）	714.06
二、清算结束日2022年12月23日基金净资产	1,173,244.69

资产处置及负债清偿后，于2022年12月23日本基金剩余财产为人民币1,173,244.69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、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2022年12月24日至清算款划出日前一日银行存款、结算备付金、存出保证金产生的利息亦属基金份额持有人所有，将与清算结束日净资产合计按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

5、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配。

六、备查文件

1、备查文件目录

- (1) 《红塔红土稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《上海市通力律师事务所关于〈红塔红土稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金清算报告〉的法律意见》。

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

红塔红土稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

2022年12月28日