
红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：浙商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 30 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。本中期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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 2 月 5 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	52
7.1 期末基金资产组合情况.....	52
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	52
7.3 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.....	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
7.7 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.....	59
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.....	59
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.....	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	59
§8 基金份额持有人信息.....	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
§9 开放式基金份额变动.....	63
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	68

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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§12 备查文件目录.....	69
12.1 备查文件目录.....	69
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金	
基金简称	红塔红土盛昌优选混合型	
基金主代码	011438	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 2 月 5 日	
基金管理人	红塔红土基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	212,274,115.65 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	红塔红土盛昌优选混合型 A	红塔红土盛昌优选混合型 C
下属分级基金的交易代码:	011438	011439
报告期末下属分级基金的份额总额	210,388,978.21 份	1,885,137.44 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动配置股票和债券等资产，挖掘价格合理，具有良好盈利前景、可持续增长潜力的个券，分享中国经济增长和证券市场发展带来的成果，力争为投资者获取持续稳定的投资回报。
投资策略	本基金为混合型基金，投资策略细分为大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、存托凭证策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+中债总指数（财富）收益率×35%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其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。

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	浙商银行股份有限公司
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）	95527
传真	0755-33379007	0571-88268688
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入	杭州市萧山区鸿宁路 1788 号

	驻深圳市前海商务秘书有 限公司)	
办公地址	深圳市南山区侨香路 4068 号智慧广场 A 栋 801	杭州市延安路 368 号
邮政编码	518053	310006
法定代表人	李凌	沈仁康

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网 址	http://www.htamc.com.cn
基金中期报告备置地点	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
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	红塔红土盛昌优选混合型 A	红塔红土盛昌优选混合型 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年2月5日 - 2021年6月30日)	报告期(2021年2月5日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	7,931,360.35	469,566.72
本期利润	5,256,616.53	564,348.17
加权平均基金份额本期利润	0.0258	0.0988
本期加权平均净值利润率	2.61%	9.93%
本期基金份额净值增长率	2.43%	2.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	5,119,050.89	43,910.20
期末可供分配基金份额利润	0.0243	0.0233
期末基金资产净值	215,508,029.10	1,929,047.64
期末基金份额净值	1.0243	1.0233
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	2.43%	2.33%

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、本基金的基金合同于 2021 年 2 月 5 日生效，截至 2021 年 6 月 30 日，基金合同生效未满 1 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

红塔红土盛昌优选混合型 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	2.38%	0.50%	-1.27%	0.52%	3.65%	-0.02%
过去三个月	7.36%	0.56%	2.81%	0.64%	4.55%	-0.08%
自基金合同生效起至今	2.43%	0.77%	-2.06%	0.84%	4.49%	-0.07%

红塔红土盛昌优选混合型 C

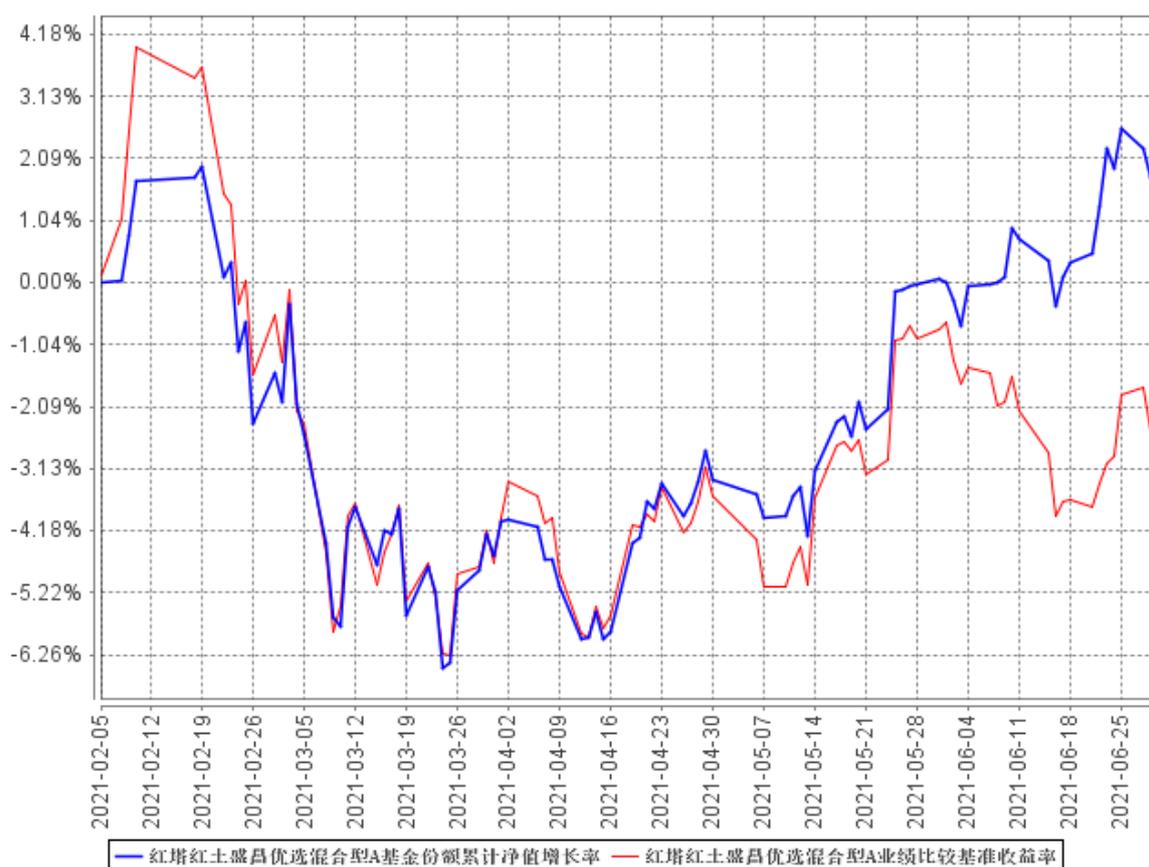
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.36%	0.50%	-1.27%	0.52%	3.63%	-0.02%
过去三个月	7.30%	0.57%	2.81%	0.64%	4.49%	-0.07%
自基金合同生效起至今	2.33%	0.77%	-2.06%	0.84%	4.39%	-0.07%

注：1、本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+中债总指数（财富）收益率×35%；

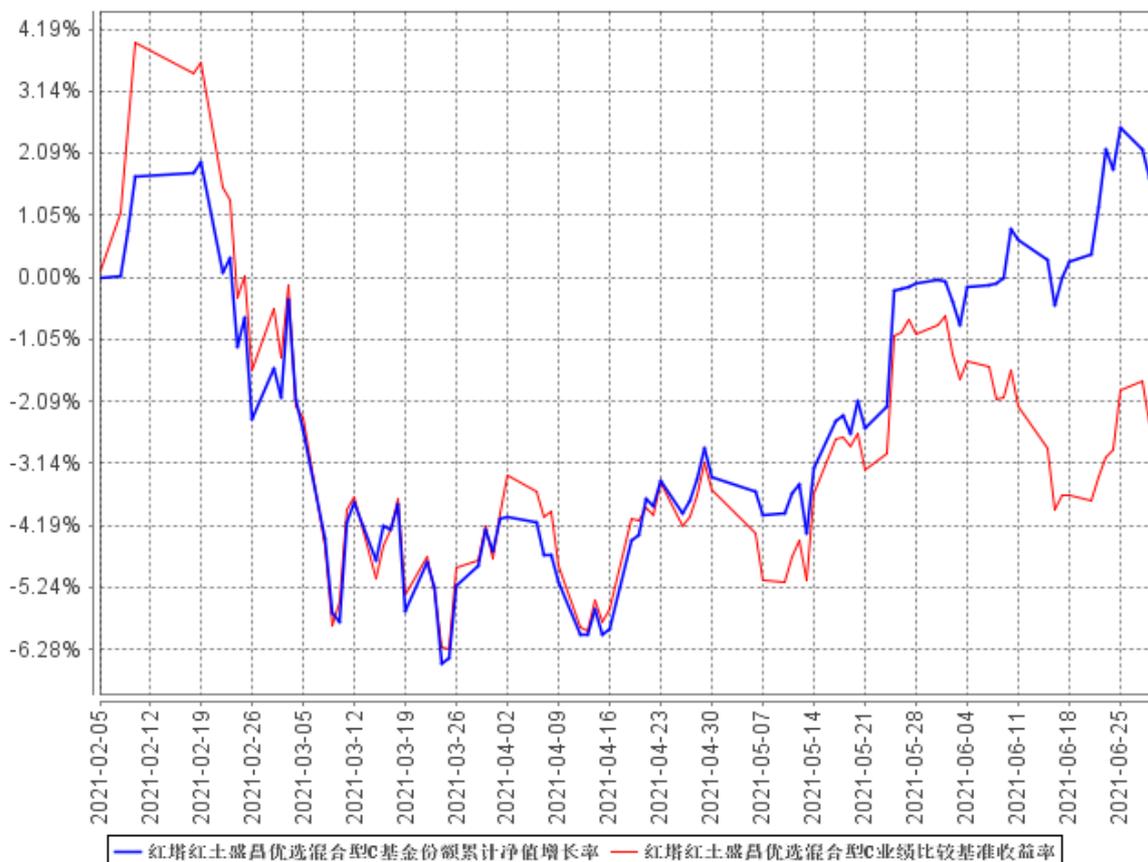
2、本基金的基金合同于 2021 年 2 月 5 日生效，截至 2021 年 6 月 30 日，基金合同生效未满 1 年。

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

红塔红土盛昌优选混合型A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



红塔红土盛昌优选混合型C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：1、本基金的基金合同于 2021 年 2 月 5 日生效，截至 2021 年 6 月 30 日，基金合同生效未满足 1 年；

2、本基金建仓期自 2021 年 2 月 5 日至 2021 年 8 月 5 日，截至报告期末基金建仓期尚未结束，报告期末资产配置比例符合本基金基金合同规定。

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，不断完善投研平台，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。截至 2021 年 6 月 30 日，公司共有员工 60 人，其中 40 人具有硕士或博士学位；截至 2021 年 6 月 30 日，公司管理 15 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		
赵耀	基金经理	2021 年 2 月 5 日	-	17	香港中文大学金融财务工商管理硕士，厦门大学经济学学士，CFA（美国注册金融分析师）。多年证券、基金从业经历，历任诺安基金交易员、中国国际金融有限公司交易员，具有丰富的大资金运作交易经验。现任职公司投资部，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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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《红塔红土盛昌优选混合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

2021 上半年，虽然仍有变异新冠病毒在局部地区蔓延，但全球的宏观经济基本处于疫情恢复期，经济增长动能较为强劲，原材料价格上涨。我国一方面受益于全球经济的复苏，另一方面受益于本身产业的完备性，供给能力强，在经济复苏中表现的格外强劲。在这样的背景下，二季度由于经济增长在边际上有减弱的趋势，央行进行了前瞻性的货币操作，总体在上半年国内货币

政策稳健中性，而财政政策偏保守。上半年资本市场表现一般，其中上证 50 指数下跌 3.90%、沪深 300 指数上涨 0.24%、创业板指数上涨 14.28%，呈现结构性行情，这主要是由于去年指数上涨较多，个别行业出现交易拥挤，风险收益比下降所致。从行业在结构上看，科技成长股，特别是新能源产业链受益于行业的高增长，股价表现突出。十年国债上半年下行了 6.5 个 bp，反应了对于下半年经济增速走弱的担忧。从美林投资时钟看当前我国经济和资本市场是在从过热向滞胀过度。

本基金在期内股票仓位保持相对稳定，保持一个在合同范围内相对保守的股票仓位，而行业分布也相对均衡，超配了新能源和低估的大金融行业。债券方面则保持高等级、中短久期的投资策略。

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昌优选混合型 A 基金份额净值为 1.0243 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.43%；截至本报告期末红塔红土盛昌优选混合型 C 基金份额净值为 1.0233 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.33%；同期业绩比较基准收益率为-2.06%。

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 年下半年，新冠疫情仍将是全球经济和市场的一个重要的扰动因子。受海外经济逐渐从疫情中恢复的影响，我国出口对宏观经济的正面拉动在减弱；与此同时国内疫情的管控和过去两年疫情对服务类行业造成的伤害使得消费又处于一个较低的增速当中，下半年国内的宏观经济面临一定的压力。在这样的局面下，如果经济下行的压力较大，投资又有可能成为一个重要的抓手。因此我们看到央行已经先行通过降准向市场释放积极的信号，也许下半年我们还将看到一次降准或调降市场利率。货币政策的进一步放松受制于国内的物价水平，如果下半年 PPI 环比呈现走平或走弱的趋势则是一个利好因素。扰动因子是中美关系，在中美竞争的大格局下，对抗的力度会对 A 股的风险偏好产生一定的影响。当前的 A 股市场经过上半年的振荡，去年底的高估值问题得到了一定的消化，当前市场的估值水平处于历史估值的平均数附近。在货币宽松的环境下，估值不易收缩，加上企业本身盈利仍有增长，我们认为虽然面临一定的经济下行压力，但指数仍有可能是走平或是小幅上行。在股票的结构方向上，我们继续看好以新能源为代表的科技成长行业，也看好部分低估值大金融行业的估值修复。

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、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，与公司领导、运营部门、监察稽核部、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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，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

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元情形。

§ 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，本基金托管人在对红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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

本报告期内，红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金的管理人——红塔红土基金管理有限公司在红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对红塔红土基金管理有限公司编制和披露的红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金 2021 年年度(中期)报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	6,129,389.12
结算备付金		184,557.89
存出保证金		62,354.63
交易性金融资产	6.4.7.2	266,426,071.07
其中：股票投资		135,404,071.07
基金投资		-
债券投资		131,022,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		252,485.35
应收利息	6.4.7.5	1,082,402.12
应收股利		-
应收申购款		361,625.21
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		274,498,885.39
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		55,999,596.00
应付证券清算款		478,207.80
应付赎回款		321,369.95
应付管理人报酬		131,325.27
应付托管费		37,521.51
应付销售服务费		3,478.13
应付交易费用	6.4.7.7	46,873.81
应交税费		7,100.27

应付利息		14,180.08
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	22,155.83
负债合计		57,061,808.65
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	212,274,115.65
未分配利润	6.4.7.10	5,162,961.09
所有者权益合计		217,437,076.74
负债和所有者权益总计		274,498,885.39

注：1、报告截止日 2021 年 6 月 30 日，红塔红土盛昌优选混合型 A 基金份额净值 1.0243 元，基金份额总额 210,388,978.21 份；红塔红土盛昌优选混合型 C 基金份额净值 1.0233 元，基金份额总额 1,885,137.44 份。红塔红土盛昌优选混合型份额总额合计为 212,274,115.65 份；

2、本基金合同于 2021 年 2 月 5 日生效。本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2021 年 2 月 5 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止。因此，无上年度可比期间财务报表数据。

6.2 利润表

会计主体：红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 5 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 2 月 5 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		7,177,207.70
1.利息收入		1,020,932.41
其中：存款利息收入	6.4.7.11	28,500.28
债券利息收入		895,989.78
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		96,442.35
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,720,111.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,669,440.62
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	35,940.87
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	1,014,729.60
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.17	-2,579,962.37

填列)		
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	16,126.57
减:二、费用		1,356,243.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	607,643.67
2. 托管费	6.4.10.2.2	164,262.55
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,402.94
4. 交易费用	6.4.7.19	239,812.35
5. 利息支出		315,116.62
其中: 卖出回购金融资产支出		315,116.62
6. 税金及附加		1,882.95
7. 其他费用	6.4.7.20	22,121.92
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		5,820,964.70
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		5,820,964.70

注: 本基金合同于 2021 年 2 月 5 日生效。本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2021 年 2 月 5 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止。因此, 无上年度可比期间财务报表数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金

本报告期: 2021 年 2 月 5 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 5 日(基金合同生效日)至 2021 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)	201,984,170.55	-	201,984,170.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,820,964.70	5,820,964.70
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)	10,289,945.10	-658,003.61	9,631,941.49
其中: 1.基金申购款	32,619,814.48	-509,394.91	32,110,419.57
2.基金赎回款	-22,329,869.38	-148,608.70	-22,478,478.08
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)	212,274,115.65	5,162,961.09	217,437,076.74

注：本基金合同于 2021 年 2 月 5 日生效。本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2021 年 2 月 5 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止。因此，无上年度可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 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u> 杨洁 </u>	<u> 杨洁 </u>	<u> 李志朋 </u>
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

红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金（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”）2020 年 11 月 22 日下发的证监许可[2020]2736 号文《关于准予红塔红土盛昌优选混合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 2021 年 2 月 1 日至 2021 年 2 月 2 日止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（2021）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。基金合同于 2021 年 2 月 5 日正式生效，本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 201,982,274.14 元，折合 201,982,274.14 份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 1,896.41 元，折合 1,896.41 份基金份额，以上实收基金（本息）合计为人民币 201,984,170.55 元，折合 201,984,170.55 份基金份额。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，基金托管人为浙商银行股份有限公司（以下简称“浙商银行”）。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、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、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、股票期权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）。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。

基金的投资组合比例为：本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 50% - 95%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的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、存出保证金和应收申购款等；股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资组合比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+中债总指数（财富）收益率×35%。

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《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。

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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 2 月 5 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.4.1 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 2021 年 2 月 5 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

本基金持有的股票及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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)”。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 于 2021 年 4 月 7 日之前，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 的年费率逐日计提；自 2021 年 4 月 7 日起，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 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 0.20% 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体收益分配方案以基金管理人发布的公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 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；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将可能有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规及基金合同规定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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。

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要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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	6,129,389.12
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:	6,129,389.12

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	138,075,636.32	135,404,071.07	-2,671,565.25
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	11,274,500.00	11,281,000.00
	银行间市场	119,655,897.12	119,741,000.00
	合计	130,930,397.12	131,022,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	269,006,033.44	266,426,071.07	-2,579,962.37

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	731.07
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	83.00
应收债券利息	1,081,560.05
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-

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	28.00
合计	1,082,402.12

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	41,819.40
银行间市场应付交易费用	5,054.41
合计	46,873.81

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	33.91
应付证券出借违约金	-
预提审计费	22,121.92
合计	22,155.83

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

红塔红土盛昌优选混合型 A		
项目	本期 2021年2月5日(基金合同生效日)至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	201,765,050.26	201,765,050.26
本期申购	9,207,358.74	9,207,358.74
本期赎回(以“-”号填列)	-583,430.79	-583,430.79
- 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	210,388,978.21	210,388,978.21

金额单位：人民币元

红塔红土盛昌优选混合型 C		
项目	本期 2021年2月5日(基金合同生效日)至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	219,120.29	219,120.29
本期申购	23,412,455.74	23,412,455.74
本期赎回(以“-”号填列)	-21,746,438.59	-21,746,438.59
- 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	1,885,137.44	1,885,137.44

注：1、申购含转入份额及金额，赎回含转出份额及金额。

2、本基金合同于 2021 年 2 月 5 日生效。设立时募集的有效认购资金(本息)为人民币 201,984,170.55 元，折合 201,984,170.55 份基金份额。A 类基金首次发售募集的有效认购资金为人民币 201,765,050.26 元，折合 201,765,050.26 份基金份额；C 类基金首次发售募集的有效认购资金为人民币 219,120.29 元，折合 219,120.29 份基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

红塔红土盛昌优选混合型 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	7,931,360.35	-2,674,743.82	5,256,616.53
本期基金份额交易产生的变动数	73,675.87	-211,241.51	-137,565.64
其中：基金申购款	86,802.56	-225,627.02	-138,824.46
基金赎回款	-13,126.69	14,385.51	1,258.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,005,036.22	-2,885,985.33	5,119,050.89

单位：人民币元

红塔红土盛昌优选混合型 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	469,566.72	94,781.45	564,348.17
本期基金份额交易产生的变动数	-399,768.48	-120,669.49	-520,437.97
其中：基金申购款	226,146.45	-596,716.90	-370,570.45
基金赎回款	-625,914.93	476,047.41	-149,867.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	69,798.24	-25,888.04	43,910.20

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月5日(基金合同生效日)至2021年6月30日
活期存款利息收入	18,292.05
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	9,874.81
其他	333.42
合计	28,500.28

注：其他为保证金存款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月5日(基金合同生效日)至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,669,440.62
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	7,669,440.62

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月5日(基金合同生效日)至2021年6月30日
卖出股票成交总额	34,480,979.16
减: 卖出股票成本总额	26,811,538.54
买卖股票差价收入	7,669,440.62

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注: 无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位: 人民币元

项目	本期 2021年2月5日(基金合同生效日)至2021年6月30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	35,940.87
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	35,940.87

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位: 人民币元

项目	本期 2021年2月5日(基金合同生效日)至2021年6月30日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	42,851,004.01
减: 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	41,931,103.95
减: 应收利息总额	883,959.19
买卖债券差价收入	35,940.87

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注: 无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月5日(基金合同生效日)至2021年6月 30日
股票投资产生的股利收益	1,014,729.60
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,014,729.60

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 2 月 5 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,579,962.37
——股票投资	-2,671,565.25
——债券投资	91,602.88
——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	-2,579,962.37

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 5 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	16,126.57
合计	16,126.57

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 5 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	236,662.35
银行间市场交易费用	3,150.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	239,812.35

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 5 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	22,121.92
信息披露费	-
证券出借违约金	-
合计	22,121.92

6.4.7.21 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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
浙商银行	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年2月5日(基金合同生效日)至 2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
红塔证券	174,221,999.10	90.77%	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年2月5日(基金合同生效日)至 2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30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	12,745,773.43	83.22%	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年2月5日(基金合同生效日) 至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30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	829,000,000.00	94.42%	-	-

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期

	2021年2月5日(基金合同生效日)至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
红塔证券	162,252.63	92.61%	28,865.71	69.02%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年2月5日(基金合同生效日)至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	607,643.67	-
其中：支付销售机构的客户维护费	8,671.75	-

注：基金管理费每日计提，按月支付。于2021年4月7日之前，基金管理费按前一日基金资产净值的0.80%的年费率逐日计提；自2021年4月7日起，基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H = E \times A \div \text{当年天数}$$

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

A 于2021年4月7日之前为0.80%，自2021年4月7日起为0.70%

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年2月5日(基金合同生效日)至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付	164,262.55	-

的托管费		
------	--	--

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 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.3 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 2021 年 2 月 5 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	红塔红土盛昌优选 混合型 A	红塔红土盛昌优选 混合型 C	合计
	红塔证券	-	327.42
合计	-	327.42	327.42
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	红塔红土盛昌优选 混合型 A	红塔红土盛昌优选 混合型 C	合计
	合计	-	-

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 0.25%。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：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 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**6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 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。

6.4.10.5.2 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

红塔红土盛昌优选混合型 A				
关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	4,999,900.00	2.3600%	-	-

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。

6.4.10.6 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 2021 年 2 月 5 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
浙商银行	6,129,389.12	18,292.05	-	-

注：本基金的活期银行存款由基金托管人浙商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688314	康拓医疗	2021 年 5 月 11 日	2021 年 11 月 18 日	新股锁定	17.34	74.48	1,085	18,813.90	80,810.80	-
688217	睿昂基因	2021 年 5 月 7 日	2021 年 11 月 17 日	新股锁定	18.42	58.40	1,040	19,156.80	60,736.00	-
688191	智洋创新	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 8 日	新股锁定	11.38	17.74	3,203	36,450.14	56,821.22	-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股锁定	33.22	87.50	319	10,597.18	27,912.50	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300973	立高	2021 年	2021	新股	28.28	115.71	201	5,684.28	23,257.71	-

	食品	4月8日	年10月15日	锁定						
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股锁定	12.54	27.89	793	9,944.22	22,116.77	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	48.59	90.39	202	9,815.18	18,258.78	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2022年1月7日	新股锁定	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股锁定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新股锁定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300962	中金	2021年	2021	新股	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-

	辐照	3月29日	年10月11日	锁定						
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股锁定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股锁定	24.90	24.81	271	6,747.90	6,723.51	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立	2021年	2021	新股	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-

	科技	6月9日	年12月17日	锁定						
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股锁定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股锁定	12.10	19.29	280	3,388.00	5,401.20	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺	2021年	2022	新股	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

	激光	6月28日	年1月6日	锁定						
600905	三峡能源	2021年6月2日	2021年12月10日	新股锁定	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021年6月17日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	810	81,000.00	81,000.00	-

注：上述流通受限证券的“可流通日”是根据证券上市公告书估算的流通日期，最终可流通日期以证券解禁上市流通的公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 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 55,999,596.00 元，是以如下债券作为抵押：

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
012102001	21 深圳地铁 SCP003	2021 年 7 月 6 日	99.86	100,000.00	9,986,000.00
012100565	21 中石化 SCP001	2021 年 7 月 6 日	100.20	100,000.00	10,020,000.00
012102236	21 苏国信 SCP013	2021 年 7 月 6 日	99.87	100,000.00	9,987,000.00
012100563	21 南电 SCP001	2021 年 7 月 6 日	100.24	100,000.00	10,024,000.00
012101483	21 华润 SCP003	2021 年 7 月 6 日	100.14	100,000.00	10,014,000.00
012100669	21 广州地铁 SCP001	2021 年 7 月 6 日	100.22	100,000.00	10,022,000.00

合计				600,000	60,053,000.00
----	--	--	--	---------	---------------

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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同责任，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。

6.4.13.2.1 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	上年度末
--------	-----	------

	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
A-1	10,029,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	91,269,000.00	-
合计	101,298,000.00	-

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等于一年的短期融资券和政策性金融债。

3、债券投资以净价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	19,572,000.00	-
合计	19,572,000.00	-

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等于一年的同业存单。

3、债券投资以净价列示。

6.4.13.2.4 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	10,152,000.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	10,152,000.00	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、债券投资以净价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 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 6.4.12 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 6.4.12.3 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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、存出保证金及债券投资等，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，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30 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	6,129,389.12	-	-	-	-	-	6,129,389.12
结算备付金	184,557.89	-	-	-	-	-	184,557.89
存出保证金	62,354.63	-	-	-	-	-	62,354.63
交易性金融资产	21,219,000.00	39,930,000.00	69,792,000.00	-	81,000.00	135,404,071.07	266,426,071.07
应收证券清算款	-	-	-	-	-	252,485.35	252,485.35
应收利息	-	-	-	-	-	1,082,402.12	1,082,402.12
应收申购款	-	-	-	-	-	361,625.21	361,625.21
资产总计	27,595,301.64	39,930,000.00	69,792,000.00	-	81,000.00	137,100,583.75	274,498,885.39
负债							
卖出回购金融资产款	55,999,596.00	-	-	-	-	-	55,999,596.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	478,207.80	478,207.80
应付赎回款	-	-	-	-	-	321,369.95	321,369.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	131,325.27	131,325.27
应付托管费	-	-	-	-	-	37,521.51	37,521.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,478.13	3,478.13
应付交易费用	-	-	-	-	-	46,873.81	46,873.81
应付利息	-	-	-	-	-	14,180.08	14,180.08
应交税费	-	-	-	-	-	7,100.27	7,100.27
其他负债	-	-	-	-	-	22,155.83	22,155.83
负债总计	55,999,596.00	-	-	-	-	1,062,212.65	57,061,808.65
利率敏感度缺口	-28,404,294.36	39,930,000.00	69,792,000.00	-	81,000.00	不适用	不适用

注：本基金合同于 2021 年 2 月 5 日生效，因此，无上年度可比期间财务报表数据。

6.4.13.4.1.2 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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1、市场利率上升 25 个基点	-123,442.27	-
2、市场利率下降 25 个基点	123,805.06		

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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	135,404,071.07	62.27	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	131,022,000.00	60.26	-	-
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	266,426,071.07	122.53	-	-

6.4.13.4.3.2 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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 本基金业绩比较基准上升 5%	11,102,096.25	-
2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-11,102,096.25		

注：本基金业绩比较基准 = 沪深 300 指数收益率 × 65% + 中债总指数（财富）收益率 × 35%。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 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、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 2021 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 129,597,977.84 元，划分为第二层次的余额为人民币 136,828,093.23 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。

§ 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	135,404,071.07	49.33
	其中：股票	135,404,071.07	49.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	131,022,000.00	47.73
	其中：债券	131,022,000.00	47.73
	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	-	-
	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	6,313,947.01	2.30
8	其他各项资产	1,758,867.31	0.64
9	合计	274,498,885.39	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	530,693.08	0.24
B	采矿业	5,017,480.00	2.31
C	制造业	51,282,613.22	23.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,302,484.60	4.28
E	建筑业	1,775,691.37	0.82
F	批发和零售业	24,350.22	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	2,984,380.00	1.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,207,229.46	3.77
J	金融业	50,589,672.10	23.27
K	房地产业	2,683,435.00	1.23
L	租赁和商务服务业	1,880,233.00	0.86
M	科学研究和技术服务业	563,724.00	0.26

N	水利、环境和公共设施管理业	13,285.02	0.01
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	548,800.00	0.25
S	综合	-	-
	合计	135,404,071.07	62.27

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所有股票投资明细

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	000001	平安银行	441,000	9,975,420.00	4.59
2	600036	招商银行	106,800	5,787,492.00	2.66
3	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	2.37
4	601398	工商银行	953,000	4,927,010.00	2.27
5	600900	长江电力	200,700	4,142,448.00	1.91
6	601939	建设银行	563,000	3,743,950.00	1.72
7	601166	兴业银行	150,000	3,082,500.00	1.42
8	601601	中国太保	100,400	2,908,588.00	1.34
9	000636	风华高科	89,905	2,716,929.10	1.25
10	000858	五粮液	9,000	2,681,010.00	1.23
11	600519	贵州茅台	1,300	2,673,710.00	1.23
12	601336	新华保险	56,100	2,575,551.00	1.18
13	002594	比亚迪	10,000	2,510,000.00	1.15
14	601818	光大银行	656,000	2,479,680.00	1.14
15	000333	美的集团	33,400	2,383,758.00	1.10
16	002230	科大讯飞	35,000	2,365,300.00	1.09
17	601577	长沙银行	241,400	2,158,116.00	0.99
18	601318	中国平安	32,600	2,095,528.00	0.96
19	000002	万科 A	87,500	2,083,375.00	0.96
20	600926	杭州银行	136,800	2,017,800.00	0.93
21	601688	华泰证券	127,200	2,009,760.00	0.92
22	300207	欣旺达	60,000	1,953,600.00	0.90
23	000983	山西焦煤	230,000	1,911,300.00	0.88

24	002081	金螳螂	221,000	1,750,320.00	0.80
25	600030	中信证券	70,000	1,745,800.00	0.80
26	603799	华友钴业	15,000	1,713,000.00	0.79
27	002110	三钢闽光	250,000	1,685,000.00	0.77
28	002624	完美世界	70,000	1,673,700.00	0.77
29	300750	宁德时代	3,000	1,604,400.00	0.74
30	300059	东方财富	48,000	1,573,920.00	0.72
31	002555	三七互娱	63,000	1,513,260.00	0.70
32	600276	恒瑞医药	21,840	1,484,464.80	0.68
33	600919	江苏银行	200,000	1,420,000.00	0.65
34	002928	华夏航空	91,200	1,377,120.00	0.63
35	002179	中航光电	17,300	1,367,046.00	0.63
36	601888	中国中免	4,500	1,350,450.00	0.62
37	300760	迈瑞医疗	2,700	1,296,135.00	0.60
38	000977	浪潮信息	45,400	1,277,102.00	0.59
39	002475	立讯精密	26,200	1,205,200.00	0.55
40	601899	紫金矿业	122,000	1,182,180.00	0.54
41	000651	格力电器	22,000	1,146,200.00	0.53
42	300014	亿纬锂能	11,000	1,143,230.00	0.53
43	601012	隆基股份	12,740	1,131,821.60	0.52
44	600000	浦发银行	109,100	1,091,000.00	0.50
45	600585	海螺水泥	26,000	1,067,300.00	0.49
46	002352	顺丰控股	15,000	1,015,500.00	0.47
47	002459	晶澳科技	20,000	980,000.00	0.45
48	601088	中国神华	50,000	976,000.00	0.45
49	002460	赣锋锂业	8,000	968,720.00	0.45
50	601658	邮储银行	191,800	962,836.00	0.44
51	300450	先导智能	16,000	962,240.00	0.44
52	601225	陕西煤业	80,000	948,000.00	0.44
53	002371	北方华创	3,400	943,092.00	0.43
54	300724	捷佳伟创	8,000	928,080.00	0.43
55	600438	通威股份	20,000	865,400.00	0.40
56	002236	大华股份	40,600	856,660.00	0.39
57	002078	太阳纸业	60,000	801,000.00	0.37
58	600760	中航沈飞	12,460	751,338.00	0.35
59	600406	国电南瑞	32,040	744,609.60	0.34
60	600499	科达制造	50,000	720,000.00	0.33
61	002415	海康威视	10,900	703,050.00	0.32
62	000063	中兴通讯	21,000	697,830.00	0.32

63	000661	长春高新	1,800	696,600.00	0.32
64	002601	龙佰集团	20,000	691,600.00	0.32
65	000725	京东方 A	110,000	686,400.00	0.32
66	002311	海大集团	8,200	669,120.00	0.31
67	001979	招商蛇口	54,800	600,060.00	0.28
68	002402	和而泰	25,000	599,250.00	0.28
69	000703	恒逸石化	49,900	596,305.00	0.27
70	002756	永兴材料	10,000	593,900.00	0.27
71	601021	春秋航空	10,400	591,760.00	0.27
72	603501	韦尔股份	1,800	579,600.00	0.27
73	300274	阳光电源	5,000	575,300.00	0.26
74	600309	万华化学	5,200	565,864.00	0.26
75	603259	药明康德	3,600	563,724.00	0.26
76	300413	芒果超媒	8,000	548,800.00	0.25
77	002410	广联达	8,000	545,600.00	0.25
78	603444	吉比特	1,000	530,000.00	0.24
79	002027	分众传媒	56,300	529,783.00	0.24
80	002241	歌尔股份	12,200	521,428.00	0.24
81	002714	牧原股份	8,540	519,402.80	0.24
82	000338	潍柴动力	28,100	502,147.00	0.23
83	002597	金禾实业	14,400	499,680.00	0.23
84	600486	扬农化工	4,200	469,434.00	0.22
85	600703	三安光电	14,500	464,725.00	0.21
86	600741	华域汽车	16,600	436,082.00	0.20
87	600845	宝信软件	7,540	383,786.00	0.18
88	300628	亿联网络	4,400	368,720.00	0.17
89	600570	恒生电子	3,900	363,675.00	0.17
90	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.04
91	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.03
92	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.03
93	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.03
94	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
95	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
96	300979	华利集团	319	27,912.50	0.01
97	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
98	300973	立高食品	201	23,257.71	0.01
99	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
100	301009	可靠股份	793	22,116.77	0.01
101	300981	中红医疗	202	18,258.78	0.01

102	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
103	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
104	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
105	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
106	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
107	301013	利和兴	471	12,768.81	0.01
108	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
109	603511	爱慕股份	353	11,649.00	0.01
110	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.01
111	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
112	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
113	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
114	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
115	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
116	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
117	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
118	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
119	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
120	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
121	300985	致远新能	271	6,723.51	0.00
122	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
123	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
124	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
125	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
126	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
127	300993	玉马遮阳	280	5,401.20	0.00
128	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
129	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
130	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
131	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
132	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
133	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
134	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净
----	------	------	----------	----------

				值比例 (%)
1	000001	平安银行	10,626,500.38	4.89
2	600036	招商银行	5,845,960.00	2.69
3	601398	工商银行	4,940,110.00	2.27
4	600900	长江电力	3,959,498.00	1.82
5	000858	五粮液	3,937,693.00	1.81
6	601601	中国太保	3,932,491.00	1.81
7	601939	建设银行	3,912,850.00	1.80
8	601166	兴业银行	3,909,477.00	1.80
9	600519	贵州茅台	3,782,685.00	1.74
10	600905	三峡能源	3,436,527.95	1.58
11	000333	美的集团	3,245,944.00	1.49
12	601818	光大银行	2,781,000.00	1.28
13	000429	粤高速 A	2,693,734.00	1.24
14	601336	新华保险	2,690,675.00	1.24
15	000002	万科 A	2,589,854.00	1.19
16	601318	中国平安	2,587,739.00	1.19
17	601577	长沙银行	2,577,385.00	1.19
18	000636	风华高科	2,555,532.50	1.18
19	600926	杭州银行	2,367,005.00	1.09
20	601688	华泰证券	2,142,600.00	0.99

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000429	粤高速 A	3,037,176.00	1.40
2	002511	中顺洁柔	2,103,709.00	0.97
3	601838	成都银行	1,863,786.00	0.86
4	002677	浙江美大	1,859,871.00	0.86
5	000568	泸州老窖	1,738,650.00	0.80
6	600905	三峡能源	1,704,214.40	0.78
7	300253	卫宁健康	1,345,252.80	0.62
8	300207	欣旺达	952,899.00	0.44
9	000858	五粮液	901,367.10	0.41
10	600745	闻泰科技	867,628.00	0.40

11	002001	新和成	718,715.00	0.33
12	600600	青岛啤酒	692,965.00	0.32
13	600519	贵州茅台	633,910.00	0.29
14	300122	智飞生物	605,220.00	0.28
15	002064	华峰化学	578,562.00	0.27
16	300015	爱尔眼科	560,554.00	0.26
17	300308	中际旭创	535,845.00	0.25
18	300347	泰格医药	525,356.00	0.24
19	688131	皓元医药	465,478.50	0.21
20	603882	金域医学	455,958.60	0.21

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	164,887,174.86
卖出股票收入（成交）总额	34,480,979.16

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	11,200,000.00	5.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	90,098,000.00	41.44
6	中期票据	10,071,000.00	4.63
7	可转债（可交换债）	81,000.00	0.04
8	同业存单	19,572,000.00	9.00
9	其他	-	-
10	合计	131,022,000.00	60.26

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	019640	20 国债 10	112,000	11,200,000.00	5.15
2	101900333	19 国开投	100,000	10,071,000.00	4.63

		MTN001A			
3	042100115	21 长电 CP002	100,000	10,029,000.00	4.61
4	012100563	21 南电 SCP001	100,000	10,024,000.00	4.61
5	012100669	21 广州地铁 SCP001	100,000	10,022,000.00	4.61

7.7 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。

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股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

注：无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：无。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 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**

招商银行（代码：600036）发行主体招商银行股份有限公司的如下违法违规事实于 2021 年 5 月 17 日受到中国银行保险监督管理委员会罚款合计 7170 万元的处罚：（一）为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；（二）违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；（三）理财产品之间风险隔离不到位；（四）理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准等共计 27 条违规行为。

工商银行（代码：601398）发行主体中国工商银行股份有限公司的如下违法违规事实于 2020 年 12 月 25 日受到中国银行保险监督管理委员会罚款 5470 万元的处罚：（一）未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告；（二）关键岗位未进行实质性轮岗；（三）法人账户日间透支业务存在资金用途管理的风险漏洞；（四）为同业投资业务提供隐性担保；（五）理财产品通过申购/赎回净值型理财产品调节收益等共计 23 条违规行为。

本基金基金经理根据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序进行了投资，符合相关法律法规和公司投资管理制度。

除招商银行、工商银行外，本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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

7.12.3 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	62,354.63
2	应收证券清算款	252,485.35
3	应收股利	-
4	应收利息	1,082,402.12
5	应收申购款	361,625.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,758,867.31

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	2.37	新股锁定

7.12.6 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
红塔红土盛昌优选混合型 A	251	838,203.10	200,001,595.83	95.06%	10,387,382.38	4.94%
红塔红土盛昌优选混合型 C	189	9,974.27	0.00	0.00%	1,885,137.44	100.00%
合计	440	482,441.17	200,001,595.83	94.22%	12,272,519.82	5.78%

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	红塔红土盛昌优选混合型 A	1,483.78	0.0007%
	红塔红土盛昌优选混合型 C	250.00	0.0133%
	合计	1,733.78	0.0008%

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	红塔红土盛昌优选混合型 A	0~10
	红塔红土盛昌优选混合型 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开	红塔红土盛昌优选混合型 A	0

开放式基金	红塔红土盛昌优选混合型 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	红塔红土盛昌优选混合型 A	红塔红土盛昌优选混合型 C
基金合同生效日（2021 年 2 月 5 日）基金份额总额	201,765,050.26	219,120.29
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	9,207,358.74	23,412,455.74
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	583,430.79	21,746,438.59
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	210,388,978.21	1,885,137.44

§ 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

2021 年 6 月 12 日，基金管理人红塔红土基金管理有限公司原总经理饶雄先生离任，由董事长李凌先生代为履行总经理职责；

2021 年 7 月 10 日，基金管理人红塔红土基金管理有限公司聘任杨洁女士担任公司总经理，李凌先生不再代为履行总经理职责。

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。

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

报告期内本基金增加了存托凭证投资策略相关内容。

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	
红塔证券	2	174,221,999.10	90.77%	162,252.63	92.61%	-
财信证券	1	15,135,004.58	7.89%	11,068.28	6.32%	-
东吴证券	1	2,578,241.07	1.34%	1,885.41	1.08%	-

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
红塔证券	12,745,773.43	83.22%	829,000,000.00	94.42%	-	-
财信证券	2,003,740.00	13.08%	18,000,000.00	2.05%	-	-
东吴证券	565,406.40	3.69%	31,000,000.00	3.53%	-	-

10.8 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	红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金(红塔红土盛昌优选混合型 A 份额)基金产品资料概要	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 1 月 27 日
2	红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金(红塔红土盛昌优选混合型 C 份额)基金产品资料概要	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 1 月 27 日
3	红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 1 月 27 日
4	红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 1 月 27 日
5	红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 1 月 27 日
6	红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 1 月 27 日
7	红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 1 月 27 日
8	关于红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 2 月 2 日
9	红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 2 月 6 日
10	红塔红土盛昌优选混合型证	中国证监会指定报	2021 年 2 月 18 日

	券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告	刊及网站	
11	红塔红土基金管理有限公司关于调整红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金管理费并修订基金合同等事项的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 4 月 7 日
12	红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 4 月 7 日
13	红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 4 月 7 日
14	红塔红土盛昌优选混合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	2021 年 4 月 8 日
15	红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金（红塔红土盛昌优选混合型 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	2021 年 4 月 8 日
16	红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金（红塔红土盛昌优选混合型 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	2021 年 4 月 8 日
17	红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金更新招募说明书（2021 年 1 号）	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 4 月 8 日
18	关于红塔红土基金管理有限公司旗下部分基金增加侧袋机制、投资范围增加存托凭证并修改法律文件的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 6 月 29 日
19	红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 6 月 29 日
20	红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 6 月 29 日
21	红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金更新招募说明书（2021 年 2 号）	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 6 月 29 日
22	红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金（红塔红土盛昌优选混合型 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	2021 年 6 月 29 日
23	红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金（红塔红土盛昌优	中国证监会指定报刊及网站	2021 年 6 月 29 日

	选混合型 C 份额) 基金产品资料概要 (更新)		
--	--------------------------	--	--

§ 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	2021-02-05 至 2021-06-30	-	95,000,823.61	-	95,000,823.61	44.75%
	2	2021-02-05 至 2021-06-30	-	100,000,872.22	-	100,000,872.22	47.11%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>1、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。</p> <p>2、流动性风险 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险。</p> <p>3、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>4、基金净值大幅波动的风险 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>5、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>6、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金基金合同；
- 3、红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金托管协议；
- 4、红塔红土盛昌优选混合型证券投资基金招募说明书；
- 5、报告期内披露的各项公告。

12.2 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：浙江省杭州市下城区延安路 368 号 2 楼

12.3 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 8 月 30 日