

红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金 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：平安银行股份有限公司

报告出具日期：2021年9月22日

报告公告日期：2021年9月28日

1、重要提示

1.1 重要提示

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 2019 年 7 月 2 日《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》（证监许可[2019]1192 号）注册公开募集，自 2020 年 4 月 9 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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

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《红塔红土盛平中短债债券型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，经履行相关程序后，《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《关于终止红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，基金管理人已于 2021 年 7 月 21 日刊登了《关于以通讯方式召开红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，并于 2021 年 7 月 22 日、2021 年 7 月 23 日连续刊登了提示性公告。本次基金份额持有人大会已于 2021 年 7 月 26 日至 2021 年 8 月 26 日对本次会议议案进行了投票表决，根据 2021 年 8 月 27 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 2021 年 8 月 27 日起生效。基金管理人于 2021 年 8 月 28 日刊登了《红塔红土基金管理有限公司关于红塔红土盛平中短债债券型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、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2021 年 8 月 31 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

2、基金概况

2.1 基金基本情况

2.1.1 基金基本信息

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	
最后运作日(2021-8-30)基金份额总额	22,254,736.49份	
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%	
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	平安银行股份有限公司	
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
最后运作日(2021-8-30)下属分级基金的份额总额	19,255,589.94	2,999,146.55

2.1.2 基金运作情况说明

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》的注册,由基金管理人红塔红土基金管理有限公司(以下简称“红塔红土基金公司”)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,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”)。

本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式等不同，将基金份额分为不同的类别：A类基金份额和C类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别公布基金份额净值。A类基金份额指投资人认购/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；C类基金份额指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。

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 \times 80%+一年期定期存款利率（税后） \times 20%。

红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金基金份额持有人大会（以下简称“本基金基金份额持有人大会”）已于2021年7月26日至2021年8月26日以通讯方式召开，于2021年8月27日表决通过了《关于终止红塔红土盛平中短债债券型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，本基金于2021年8月30日终止运作，从2021年8月31日起进入清算期。

2.2 清算原因

本基金基金份额持有人大会通过《关于终止红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

2.3 清算起始日

根据《红塔红土基金管理有限公司关于红塔红土盛平中短债债券型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》，本基金于2021年8月31日起进入清算程序，故本基金清

算起始日为 2021 年 8 月 31 日。

3、清算报表编制基础

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

4、财务报告

4.1 基金最后运作日资产负债表(已经审计)

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：2021 年 8 月 30 日

单位：人民币元

	最后运作日 2021 年 8 月 30 日
资产：	
银行存款	4,166,027.28
结算备付金	40,358.18
存出保证金	923.56
应收证券清算款	18,550,914.95
应收利息	2,265.32
资产总计	22,760,489.29
负债：	
应付管理人报酬	5,574.93
应付托管费	1,858.32
应付销售服务费	624.92
其他负债	168,562.34
负债合计	176,620.51
所有者权益：	
实收基金	22,254,736.49
未分配利润	329,132.29
所有者权益合计	22,583,868.78
负债和所有者权益总计	22,760,489.29

5、清算情况

自 2021 年 8 月 31 日至 2021 年 9 月 22 日止清算期间，红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下：

1、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金人民币 40,358.18 元，是由中国证券登记结算公司上海分公司收取并保管的结算备付金。结算备付金每月调整一次，根据《结算备付金管理办法》，“中国证券登记结算有限责任公司在每月前 3 个营业日内，对结算参与人的最低结算备付金限额进行重新核算、调整”。9 月 2 日中国证券登记结算有限责任公司上海分公司将结算备付金调整为人民币 34,426.83 元。该款项将于清算款划出日由基金管理人红塔红土基金管理有限公司以自有资金垫付，待中国证券登记结算有限责任公司结算后返还给基金管理人。

(2) 本基金最后运作日存出保证金人民币 923.56 元，该款项已于 2021 年 9 月 2 日收回并划入本基金银行存款活期账户。

(3) 本基金最后运作日应收证券清算款人民币 18,550,914.95 元，已于 2021 年 8 月 31 日收回并划入本基金银行存款活期账户。

(4) 本基金最后运作日应收利息人民币 2,265.32 元，其中包括活期银行存款应收利息 2,207.57 元、清算备付金应收利息 54.48 元和结算保证金应收利息 3.27 元，已分别于 2021 年 9 月 21 日、2021 年 9 月 22 日收回并划入本基金银行存款活期账户。

2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 5,574.93 元，该款项已于 2021 年 9 月 13 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,858.32 元，该款项已于 2021 年 9 月 13 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 624.92 元，该款项已于 2021 年 9 月 13 日支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币 168,562.34 元，包含其他应付款和预提费用。其中，应付持有人大会公证费为人民币 10,000.00 元；应付持有人大会律师费用为人民币 30,000.00 元；应付清算期律师费用为人民币 20,000.00 元；应付信息披露费为人民币 79,562.34 元；应付

审计费为人民币 20,000.00 元；应付银行间账户维护费为人民币 9,000.00 元，该款项已于 2021 年 9 月 13 日支付。

3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2021 年 8 月 31 日至 2021 年 9 月 22 日止清算期间
一、清算收益	
利息收入（注 1）	5,100.37
清算收入小计	5,100.37
二、清算费用	
账户费用（注 2）	300.00
清算费用小计（注 3）	300.00
三、清算净收益	4,800.37

注 1：利息收入系计提的自 2021 年 8 月 31 日至 2021 年 9 月 22 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 5,064.12 元，已于 2021 年 9 月 21 日银行结息日收回人民币 4,625.58 元；存出保证金利息收入为人民币 0.28 元，均已于 2021 年 9 月 22 日收回；结算备付金利息收入为人民币 35.97 元，已于 2021 年 9 月 22 日收回人民币 32.87 元。剩余款项将于清算款划出日由基金管理人红塔红土基金管理有限公司以自有资金垫付，基金管理人垫付的资金将于清算期后银行结息日后返还给基金管理人。

注 2：账户费用系清算期间本基金支付的上交所账户查询费。

注 3：经本基金管理人红塔红土基金管理有限公司确认，本次清算相关的清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

4、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2021 年 8 月 30 日基金净资产	22,583,868.78
加：基金净申购金额	-20.30

加：清算期间净收益	4,800.37
二、2021年9月22日基金净资产	22,588,648.85

资产处置及负债清偿后，于2021年9月22日本基金剩余财产为人民币22,588,648.85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。

因清算款划出日不能确定，暂不能准确预估清算结束日至清算款划出日前一日银行存款、存出保证金产生的利息，该期间利息亦属份额持有人所有，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。由于本基金托管户银行存款、存出保证金按季度结息，基金管理人红塔红土基金管理有限公司将于清算款划出日以自有资金划入托管账户，用以垫付本基金最后运作日应收利息余额及清算起始日至清算款划出日（不含当日）产生的利息，具体垫付金额按当前适用的利率进行预估。基金管理人垫付的资金以及垫付日之后产生的利息将于清算期后银行结息日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。

6、备查文件目录

6.1 备查文件目录

- (1) 《红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 关于《红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金清算报告》的法律意见。

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3 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。

红塔红土盛平中短债债券型证券投资基金基金财产清算小组

2021年9月28日