

# 红土创新稳进混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：红土创新基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 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及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责任。本半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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	错误！未定义书签。
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40

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.....	40
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.....	40
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.....	40
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	41
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
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情况.....	42
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>42</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	44
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>46</b>
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.....	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>46</b>
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	红土创新稳进混合型证券投资基金	
基金简称	红土创新稳进混合	
基金主代码	009077	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 3 月 6 日	
基金管理人	红土创新基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	995,949,736.20 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	红土创新稳进混合 A	红土创新稳进混合 C
下属分级基金的交易代码	009077	009078
报告期末下属分级基金的份额总额	151,999,955.19 份	843,949,781.01 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用多种投资策略，在严格管理风险和保障必要流动性的前提下，实现长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据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。在严格控制投资组合风险的前提下，动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例，力图规避市场风险，提高配置效率。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*20%+中证全债指数收益率*80%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

### 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	红土创新基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	殷喆
	联系电话	0755-33011858
	电子邮箱	yinz@htcfund.com
客户服务电话	0755-33011866	400-61-95555
传真	0755-33011855	0755-83195201
注册地址	广东省深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	深圳市南山区海德三道 1066 号深创投广场 48 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码	518048	518040
法定代表人	阮菲	缪建民

## 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.htcxfund.com">http://www.htcxfund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、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	红土创新基金管理有限公司	深圳市南山区海德三道 1066 号 深创投广场 48 层

## § 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	红土创新稳进混合 A	红土创新稳进混合 C
本期已实现收益	2,541,390.44	13,261,007.66
本期利润	4,640,554.90	24,261,812.84
加权平均基金份额本期利润	0.0319	0.0307
本期加权平均净值利润率	2.56%	2.48%
本期基金份额净值增长率	2.73%	2.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	33,785,890.01	183,108,409.82
期末可供分配基金份额利润	0.2223	0.2170
期末基金资产净值	191,210,813.66	1,057,093,841.56
期末基金份额净值	1.2580	1.2526
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	31.14%	30.58%

注：1. 本期已实现收益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。

2. 期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3. 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。

### 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

红土创新稳进混合 A

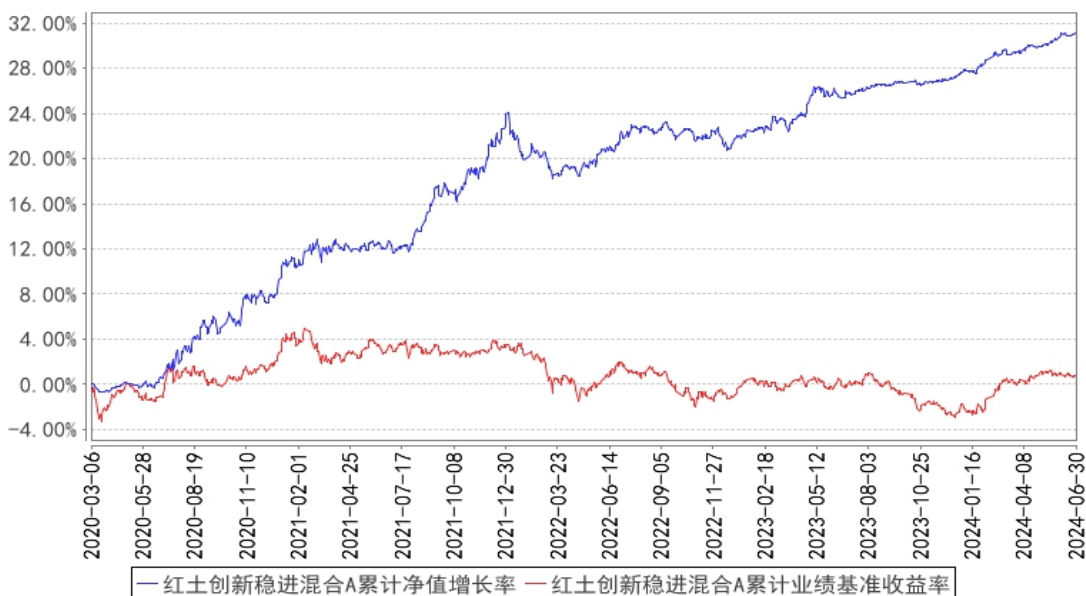
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.44%	0.08%	-0.05%	0.09%	0.49%	-0.01%
过去三个月	1.25%	0.07%	0.54%	0.13%	0.71%	-0.06%
过去六个月	2.73%	0.08%	2.49%	0.17%	0.24%	-0.09%
过去一年	4.27%	0.07%	0.74%	0.17%	3.53%	-0.10%
过去三年	16.76%	0.19%	-2.61%	0.21%	19.37%	-0.02%
自基金合同生效起至今	31.14%	0.22%	0.71%	0.23%	30.43%	-0.01%

红土创新稳进混合 C

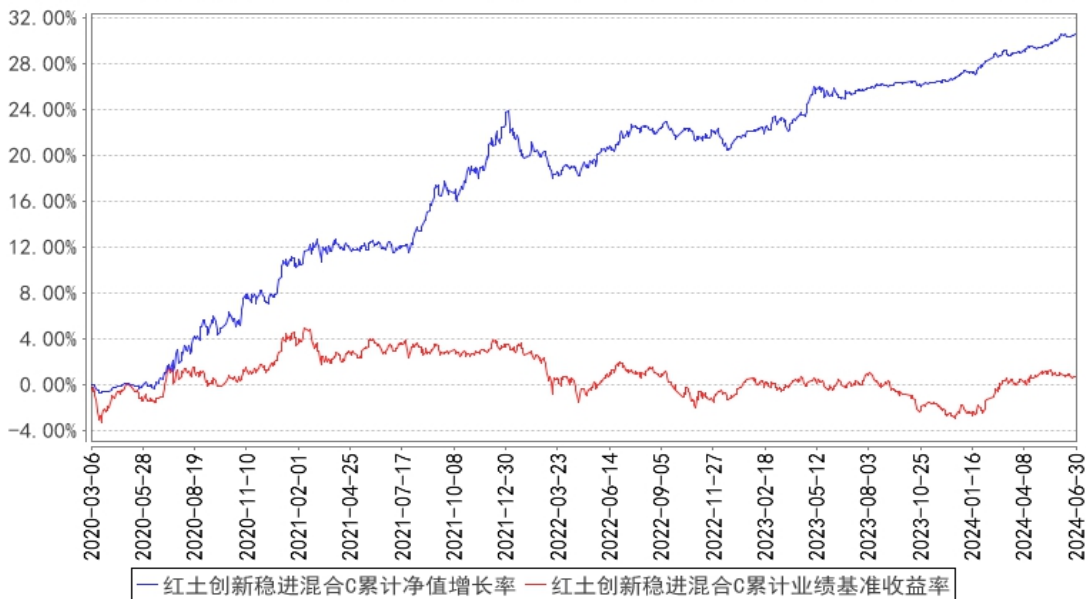
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.43%	0.08%	-0.05%	0.09%	0.48%	-0.01%
过去三个月	1.22%	0.07%	0.54%	0.13%	0.68%	-0.06%
过去六个月	2.68%	0.08%	2.49%	0.17%	0.19%	-0.09%
过去一年	4.16%	0.07%	0.74%	0.17%	3.42%	-0.10%
过去三年	16.41%	0.19%	-2.61%	0.21%	19.02%	-0.02%
自基金合同生效起至今	30.58%	0.22%	0.71%	0.23%	29.87%	-0.01%

### 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

红土创新稳进混合A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



红土创新稳进混合C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：本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，截止建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

## § 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

红土创新基金管理有限公司（以下简称“红土创新基金”）经中国证监会证监许可【2014】562



号文批准设立。红土创新基金总部位于深圳，注册资本金为 4 亿元人民币，是国内首家创投系公募基金管理公司。公司股东为深圳市创新投资集团有限公司，持有股权 100%。

红土创新基金在公募基金业务的优良传承基础上，借力股东对创业投资行业的深入理解，外加国内独创的博士后工作站研究支持，充分利用一级市场优势向二级市场延伸，将红土创新基金打造成为以权益类投资为特色的创新型资产管理机构。截至 2024 年 6 月 30 日，红土创新基金共管理 22 只公募基金，资产管理规模 174.64 亿元。

#### 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		
陈若劲	本基金的基金经理	2020 年 3 月 6 日	-	22 年	香港中文大学金融 MBA。曾在宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员、固定收益部总监，宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈货币市场证券投资基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈祥泰混合型证券投资基金的基金经理。现任红土创新基金管理有限公司副总经理、固定收益部总监、红土创新稳健混合型证券投资基金、红土创新稳进混合型证券投资基金、红土创新增强收益债券型证券投资基金、红土创新添利债券型证券投资基金、红土创新稳益 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 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

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《红土创新稳进混合证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 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

本报告期内，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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

### 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

报告期内，国内经济仍在处在蓄积回升力量的阶段，制造业 PMI 从去年年末的 49%回升至今年 6 月末的 49.5%。二季度以来，经济结构特征出现一定变化，4-6 月 PMI 生产分项下降 2.3pct 至 50.6%，新订单分项下降 1.6pct 至 49.5%，前期生产端持续强于需求端的格局发生变化，或指向近期产能去化节奏加快，7 月政治局会议也提到“要强化市场优胜劣汰机制，畅通落后低效能退出渠道”，未来我们将密切关注落后产能出清节奏。地产方面，5 月以来，房地产政策进一步优化，央行明确取消全国层面房贷利率下限、下调房贷首付比例和公积金贷款利率，推出保障性住房再贷款，核心一二线城市相继跟进，地产数据有所起色但仍在较低水位运行。政策方面，货币政策维持稳健宽松基调，银行间流动性持续稳定，财政政策总体积极但发行与使用进度偏缓。海外市场方面，二季度美国经济数据持续回落，7 月美国制造业 PMI 与非农数据出现较大幅度的回踩引发了市场对全球经济硬着陆的担忧，同时日元加息加大了全球市场的波动。

报告期内，一方面，政府债券发行节奏较缓、债券供需错位，另一方面，银行存款利率下行节奏较快，市场对政策利率下调的预期也始终存在，债券收益率曲线陡峭化下行。上半年 10 年国债收益率共下行 35bp 至 2.21%，1 年国债收益率下行 55bp 至 1.53%。权益市场行情较为波折，上半年上证指数回落 0.25%。

报告期内，债券方面，我们仍以持有中短久期高等级信用债获取稳健票息收益为主要策略，去年末，随着债券出现配置价值，我们适当增配信用债并提升了组合久期，今年 3 月之后，随着

债券收益率的下行，我们逐步降低了组合久期；股票方面，我们依然主要配置估值合理、对宏观经济敏感性弱、国家政策支持的事业行业标的，以及长逻辑符合人口老龄化的医药优质标的，并增配了部分稳定经营的资源类标的；转债方面，我们以配置估值合理、性价比高的转债为主要策略，适当增配了部分信用资质较好的具备债底保护的转债。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末红土创新稳进混合 A 的基金份额净值为 1.2580 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.73%，同期业绩比较基准收益率为 2.49%；截至本报告期末红土创新稳进混合 C 的基金份额净值为 1.2526 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.68%，同期业绩比较基准收益率为 2.49%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，宏观政策保持积极、流动性合理充裕、高质量发展定力仍在，投资者信心及风险偏好仍有进一步企稳回升的基础。债券方面，在经济结构的加快转型、房地产供求关系的重大变化的背景下，我们维持债券收益率向上波动的风险相对有限的观点，继续持有获取票息仍是不错的策略。股票方面，我们将继续依据上市公司的半年报情况，审视我们的组合持仓标的，谨慎乐观的参与权益市场的投资机会。转债方面，我们将以债底保护为主要考量，兼顾企业盈利改善之后或有的正股弹性，更加广泛的寻找可投转债优质标的。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值工作组，由投研部门、运营部门及监察稽核部门的相关人员组成。估值工作组负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理，特别是应当保证估值未被歪曲以免对基金份额持有人产生不利影响。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

遵照本基金合同约定，本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人、基金资产净值低于 5000 万的情形。

## § 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：红土创新稳进混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	5,165,671.54	1,756,561.27
结算备付金		59,762.12	188,348.34
存出保证金		26,034.74	33,534.03
交易性金融资产	6.4.7.2	1,576,827,550.22	1,017,448,699.06
其中：股票投资		124,926,962.19	68,954,069.00
基金投资		-	-
债券投资		1,451,900,588.03	948,494,630.06
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	93,227.38
应收股利		-	-
应收申购款		5,487,898.33	6,337,121.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,587,566,916.95	1,025,857,491.53
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		321,181,439.71	171,123,466.46
应付清算款		186,824.27	834,860.72
应付赎回款		16,854,884.41	10,248,173.01
应付管理人报酬		616,900.95	458,935.84
应付托管费		102,816.80	76,489.32
应付销售服务费		86,940.31	68,028.22
应付投资顾问费		-	-
应交税费		67,653.01	65,778.13
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	164,802.27	222,864.29
负债合计		339,262,261.73	183,098,595.99
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	995,949,736.20	690,521,357.73
未分配利润	6.4.7.12	252,354,919.02	152,237,537.81
净资产合计		1,248,304,655.22	842,758,895.54
负债和净资产总计		1,587,566,916.95	1,025,857,491.53

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 995,949,736.20 份，其中红土创新稳进混合 A 基金份额总额 151,999,955.19 份，基金份额净值 1.2580 元；红土创新稳进混合 C 基金份额总额 843,949,781.01 份，基金份额净值 1.2526 元。

## 6.2 利润表

会计主体：红土创新稳进混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		34,765,417.83	4,957,875.29
1. 利息收入		86,524.72	8,978.97
其中：存款利息收入	6.4.7.13	18,778.98	7,427.30
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		67,745.74	1,551.67
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,767,151.74	2,190,101.71
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,255,052.21	315,827.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	18,815,661.55	1,823,838.42
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	696,437.98	50,435.50
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	13,099,969.64	2,725,210.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	811,771.73	33,584.36
<b>减：二、营业总支出</b>		5,863,050.09	929,293.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,446,013.36	375,441.26
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	574,335.56	62,573.46
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	484,379.97	50,224.26
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,178,890.92	324,261.01
其中：卖出回购金融资产支出		1,178,890.92	324,261.01
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		35,658.20	6,293.95
8. 其他费用	6.4.7.23	143,772.08	110,499.82
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		28,902,367.74	4,028,581.53
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		28,902,367.74	4,028,581.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		28,902,367.74	4,028,581.53

### 6.3 净资产变动表

会计主体：红土创新稳进混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	690,521,357.73	-	152,237,537.81	842,758,895.54
二、本期期初净资产	690,521,357.73	-	152,237,537.81	842,758,895.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	305,428,378.47	-	100,117,381.21	405,545,759.68
（一）、综合收益总额	-	-	28,902,367.74	28,902,367.74
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	305,428,378.47	-	71,215,013.47	376,643,391.94
其中：1. 基金申购款	1,679,740,073.02	-	397,894,065.82	2,077,634,138.84
2. 基金赎回款	-1,374,311,694.55	-	-326,679,052.35	-1,700,990,746.90
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	995,949,736.20	-	252,354,919.02	1,248,304,655.22
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	106,909,709.30	-	17,602,549.15	124,512,258.45
二、本期期初净资产	106,909,709.30	-	17,602,549.15	124,512,258.45
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	18,435,626.74	-	7,905,817.26	26,341,444.00
(一)、综合收益总额	-	-	4,028,581.53	4,028,581.53
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	18,435,626.74	-	3,877,235.73	22,312,862.47
其中：1. 基金申购款	48,972,739.05	-	9,561,842.49	58,534,581.54
2. 基金赎回款	-30,537,112.31	-	-5,684,606.76	-36,221,719.07
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	125,345,336.04	-	25,508,366.41	150,853,702.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至-财务报表由下列负责人签署：

冀洪涛

周厚桥

焦小川

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

红土创新稳进混合型证券投资基金(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[2019]2216号《关于准予红土创新稳进混合型证券投资基金注册的批复》核准,由红土创新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《红土创新稳进混合型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 395,238,626.45 元,经普华永道中天会计师事务所(特



殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0163 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《红土创新稳进混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 3 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 395,247,848.08 份基金份额,其中认购资金利息折合 9,221.63 份基金份额。本基金的基金管理人为红土创新基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《红土创新稳进混合型证券投资基金基金合同》和《红土创新稳进混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定,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。在投资者认购、申购时收取前端认购、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,不计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购、申购时不收取前端认购、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,且从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。A 类基金份额、C 类基金份额分别设置代码,分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新稳进混合型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良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)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款、同业存单、股指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)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 0%—40%;其中本基金投资同业存单的比例不得超过基金资产的 20%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率\*20%+中证全债指数收益率\*80%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《红土创新稳进混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期间的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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以

产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对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，股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	5,165,671.54
等于：本金	5,165,431.95
加：应计利息	239.59
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-

合计	5,165,671.54
----	--------------

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	108,122,803.10	-	124,926,962.19	16,804,159.09	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	253,880,872.94	3,051,993.81	258,701,331.11	1,768,464.36
	银行间市场	1,180,706,813.08	11,338,456.92	1,193,199,256.92	1,153,986.92
	合计	1,434,587,686.02	14,390,450.73	1,451,900,588.03	2,922,451.28
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,542,710,489.12	14,390,450.73	1,576,827,550.22	19,726,610.37	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

#### 6.4.7.8 其他资产

无。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	387.11
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	51,982.74
其中：交易所市场	18,939.29
银行间市场	33,043.45
应付利息	-
预提费用	112,432.42
合计	164,802.27

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 红土创新稳进混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	82,714,914.84	82,714,914.84
本期申购	131,478,621.46	131,478,621.46
本期赎回（以“-”号填列）	-62,193,581.11	-62,193,581.11
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	151,999,955.19	151,999,955.19

##### 红土创新稳进混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	607,806,442.89	607,806,442.89
本期申购	1,548,261,451.56	1,548,261,451.56
本期赎回（以“-”号填列）	-1,312,118,113.44	-1,312,118,113.44
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	843,949,781.01	843,949,781.01

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 红土创新稳进混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,939,244.32	1,634,849.59	18,574,093.91

本期期初	16,939,244.32	1,634,849.59	18,574,093.91
本期利润	2,541,390.44	2,099,164.46	4,640,554.90
本期基金份额交易产生的变动数	14,305,255.25	1,690,954.41	15,996,209.66
其中：基金申购款	27,757,768.22	3,490,311.13	31,248,079.35
基金赎回款	-13,452,512.97	-1,799,356.72	-15,251,869.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,785,890.01	5,424,968.46	39,210,858.47

## 红土创新稳进混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	121,672,589.51	11,990,854.39	133,663,443.90
本期期初	121,672,589.51	11,990,854.39	133,663,443.90
本期利润	13,261,007.66	11,000,805.18	24,261,812.84
本期基金份额交易产生的变动数	48,174,812.65	7,043,991.16	55,218,803.81
其中：基金申购款	322,805,272.40	43,840,714.07	366,645,986.47
基金赎回款	-274,630,459.75	-36,796,722.91	-311,427,182.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	183,108,409.82	30,035,650.73	213,144,060.55

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	6,324.95
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	12,218.84
其他	235.19
合计	18,778.98

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,255,052.21
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	1,255,052.21

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	11,583,600.00
减：卖出股票成本总额	10,278,059.23
减：交易费用	50,488.56
买卖股票差价收入	1,255,052.21

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	16,136,379.52
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,679,282.03
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	18,815,661.55

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,332,167,115.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,317,134,204.48
减：应计利息总额	12,329,983.82
减：交易费用	23,644.82
买卖债券差价收入	2,679,282.03

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

**6.4.7.17 贵金属投资收益**

无。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	696,437.98
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	696,437.98

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	13,099,969.64
股票投资	13,366,573.68
债券投资	-266,604.04
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	13,099,969.64

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	809,375.26
基金转换费收入	2,396.47
合计	811,771.73

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。



#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	43,760.08
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	21,739.66
上清所证书使用费	600.00
上清所债券托管帐户维护费	9,000.00
中债登债券托管帐户维护费	9,000.00
合计	143,772.08

#### 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

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 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

无。

##### 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
红土创新基金管理有限公司（“红土创新”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
深创投红土资产管理（深圳）有限公司（“深创投红土资管”）	基金管理人的全资子公司
深圳市创新投资集团有限公司（“深创投”）	基金管理人的控股股东

注：下述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

无。

## 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
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,446,013.36	375,441.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,615,430.28	51,601.70
应支付基金管理人的净管理费	1,830,583.08	323,839.56

注：支付基金管理人红土创新的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	574,335.56	62,573.46

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

### 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		
	2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	红土创新稳进混合 A	红土创新稳进混合 C	合计
红土创新	-	702.74	702.74
合计	-	702.74	702.74
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	红土创新稳进混合 A	红土创新稳进混合 C	合计
红土创新	-	35,989.50	35,989.50

合计	-	35,989.50	35,989.50
----	---	-----------	-----------

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给红土创新，再由红土创新计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行	30,006,576.16	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

#### 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

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

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

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
		红土创新稳进混合 A
基金合同生效日( 2020 年 3 月	-	-

6 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	红土创新稳进混合 A	红土创新稳进混合 C
基金合同生效日( 2020 年 3 月 6 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	2, 593, 361. 00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	2, 593, 361. 00	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	8. 8300%	-

#### 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

无。

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
招商银行	5, 165, 671. 54	6, 324. 95	1, 176, 351. 52	2, 966. 63

注: 本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管, 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

无。

#### 6. 4. 10. 8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2024 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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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 2024 年 06 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 314,581,439.71 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
012480876	24 国际港务 SCP003	2024 年 7 月 1 日	100.68	500,000	50,338,016.44
012481433	24 大唐新能 SCP001	2024 年 7 月 1 日	100.32	500,000	50,159,136.99
012481435	24 国能新能 SCP001	2024 年 7 月 1 日	100.30	298,000	29,888,756.65
102000709	20 苏国信 MTN006	2024 年 7 月 1 日	101.45	223,000	22,623,655.48
102280070	22 中文天地 MTN001	2024 年 7 月 1 日	101.97	500,000	50,984,098.36
102280299	22 国际港务 MTN001	2024 年 7 月 1 日	101.69	472,000	47,997,215.74
112303204	23 农业银行 CD204	2024 年 7 月 1 日	99.62	327,000	32,575,805.67
230421	23 农发 21	2024 年 7 月 1 日	101.83	527,000	53,663,229.29
合计				3,347,000	338,229,914.62

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 6,600,000.00 元，于 2024 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，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管理委员会，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，协调并与各部门合作完成运作风险管理，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行，因而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并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	616,956,905.01	317,149,053.01
合计	616,956,905.01	317,149,053.01

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	99,680,837.57	98,404,135.65
合计	99,680,837.57	98,404,135.65

#### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	487,068,449.68	318,870,606.63
AAA 以下	3,913,885.06	549,290.26
未评级	244,280,510.71	213,521,544.51
合计	735,262,845.45	532,941,441.40

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

##### 6.4.13.3.1 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在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，



以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金和存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	5,165,671.54	-	-	-	5,165,671.54
结算备付金	59,762.12	-	-	-	59,762.12
存出保证金	26,034.74	-	-	-	26,034.74
交易性金融资产	1,377,625,446.03	63,624,336.52	10,650,805.48	124,926,962.19	1,576,827,550.22
应收申购款	-	-	-	5,487,898.33	5,487,898.33
<b>资产总计</b>	<b>1,382,876,914.43</b>	<b>63,624,336.52</b>	<b>10,650,805.48</b>	<b>130,414,860.52</b>	<b>1,587,566,916.95</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	16,854,884.41	16,854,884.41
应付管理人报酬	-	-	-	616,900.95	616,900.95

应付托管费	-	-	-	102,816.80	102,816.80
应付清算款	-	-	-	186,824.27	186,824.27
卖出回购金融资产款	321,181,439.71	-	-	-	321,181,439.71
应付销售服务费	-	-	-	86,940.31	86,940.31
应交税费	-	-	-	67,653.01	67,653.01
其他负债	-	-	-	164,802.27	164,802.27
负债总计	321,181,439.71	-	-	18,080,822.02	339,262,261.73
利率敏感度缺口	1,061,695,474.72	63,624,336.52	10,650,805.48	112,334,038.50	1,248,304,655.22
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,756,561.27	-	-	-	1,756,561.27
结算备付金	188,348.34	-	-	-	188,348.34
存出保证金	33,534.03	-	-	-	33,534.03
交易性金融资产	535,750,834.78	412,743,795.28	-	68,954,069.00	1,017,448,699.06
应收申购款	-	-	-	6,337,121.45	6,337,121.45
应收清算款	-	-	-	93,227.38	93,227.38
资产总计	537,729,278.42	412,743,795.28	-	75,384,417.83	1,025,857,491.53
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,248,173.01	10,248,173.01
应付管理人报酬	-	-	-	458,935.84	458,935.84
应付托管费	-	-	-	76,489.32	76,489.32
应付清算款	-	-	-	834,860.72	834,860.72
卖出回购金融资产款	171,123,466.46	-	-	-	171,123,466.46
应付销售服务费	-	-	-	68,028.22	68,028.22
应交税费	-	-	-	65,778.13	65,778.13
其他负债	-	-	-	222,864.29	222,864.29
负债总计	171,123,466.46	-	-	11,975,129.53	183,098,595.99
利率敏感度缺口	366,605,811.96	412,743,795.28	-	63,409,288.30	842,758,895.54

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	1. 市场利率下降 25 个基点	1,456,287.22	2,088,148.57
	2. 市场利率上升 25 个基点	-1,446,861.54	-2,077,513.07

#### 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 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 2024年6月30日		上年度末 2023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	124,926,962.19	10.01	68,954,069.00	8.18
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	116,591,078.50	9.34	95,118,229.20	11.29
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	241,518,040.69	19.35	164,072,298.20	19.47

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
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 （2024 年 6 月 30 日）	上年度末 （2023 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	188,553.43	469,922.07
2. 沪深 300 指数下降 5%	-188,553.43	-469,922.07	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	241,518,040.69	164,072,298.20
第二层次	1,335,309,509.53	853,376,400.86
第三层次	-	-
合计	1,576,827,550.22	1,017,448,699.06

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售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还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	124,926,962.19	7.87
	其中：股票	124,926,962.19	7.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,451,900,588.03	91.45
	其中：债券	1,451,900,588.03	91.45
	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	5,225,433.66	0.33
8	其他各项资产	5,513,933.07	0.35
9	合计	1,587,566,916.95	100.00

### 7.2 报告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	-	-
B	采矿业	18,679,126.00	1.50
C	制造业	15,401,578.01	1.23

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	76,258,663.88	6.11
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,957,200.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	12,508,894.30	1.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	121,500.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	124,926,962.19	10.01

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	2,197,714	63,557,888.88	5.09
2	600546	山煤国际	649,800	9,500,076.00	0.76
3	600012	皖通高速	460,000	6,426,200.00	0.51
4	600519	贵州茅台	4,000	5,869,560.00	0.47
5	001965	招商公路	489,995	5,811,340.70	0.47
6	601088	中国神华	130,000	5,768,100.00	0.46
7	600886	国投电力	290,000	5,289,600.00	0.42
8	600674	川投能源	279,828	5,246,775.00	0.42
9	002422	科伦药业	157,997	4,792,049.01	0.38
10	000513	丽珠集团	73,900	2,749,819.00	0.22
11	601899	紫金矿业	115,000	2,020,550.00	0.16
12	605599	菜百股份	140,000	1,782,200.00	0.14
13	600027	华电国际	232,000	1,610,080.00	0.13
14	600028	中国石化	220,000	1,390,400.00	0.11
15	600399	抚顺特钢	120,000	675,600.00	0.05
16	601985	中国核电	52,000	554,320.00	0.04
17	603806	福斯特	28,000	411,600.00	0.03
18	002223	鱼跃医疗	10,000	376,000.00	0.03

19	600377	宁沪高速	21,536	271,353.60	0.02
20	600887	伊利股份	10,000	258,400.00	0.02
21	603368	柳药集团	10,000	175,000.00	0.01
22	600372	中航机载	11,000	131,670.00	0.01
23	300347	泰格医药	2,500	121,500.00	0.01
24	002850	科达利	1,000	76,380.00	0.01
25	600760	中航沈飞	1,000	40,100.00	0.00
26	600765	中航重机	1,000	20,400.00	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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	20,118,591.08	2.39
2	600546	山煤国际	10,999,703.00	1.31
3	001965	招商公路	5,680,701.55	0.67
4	601088	中国神华	4,927,437.00	0.58
5	002422	科伦药业	3,955,830.83	0.47
6	600674	川投能源	2,274,543.28	0.27
7	605599	莱百股份	1,821,149.00	0.22
8	600886	国投电力	1,300,815.00	0.15
9	000513	丽珠集团	909,607.00	0.11
10	603806	福斯特	476,137.00	0.06
11	600028	中国石化	325,360.00	0.04
12	600760	中航沈飞	39,850.00	0.00
13	600372	中航机载	37,464.00	0.00
14	600389	江山股份	17,190.00	0.00

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	9,508,564.00	1.13
2	600012	皖通高速	1,479,529.00	0.18
3	001965	招商公路	581,197.00	0.07
4	600389	江山股份	14,310.00	0.00

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（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	52,884,378.74
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	11,583,600.00
--------------	---------------

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 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	10,112,612.02	0.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	221,823,504.16	17.77
	其中：政策性金融债	82,060,422.97	6.57
4	企业债券	142,110,252.61	11.38
5	企业短期融资券	545,747,637.25	43.72
6	中期票据	315,834,665.92	25.30
7	可转债（可交换债）	116,591,078.50	9.34
8	同业存单	99,680,837.57	7.99
9	其他	-	-
10	合计	1,451,900,588.03	116.31

### 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	01248029 6	24 电网 SCP001	1,150,000	116,118,830.60	9.30
2	110059	浦发转债	948,680	104,616,037.88	8.38
3	230421	23 农发 21	600,000	61,096,655.74	4.89
4	10228007 0	22 中文天地 MTN001	500,000	50,984,098.36	4.08
5	10228029 9	22 国际港务 MTN001	500,000	50,844,508.20	4.07

### 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

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

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

无。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。



### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编辑日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 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	26,034.74
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,487,898.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,513,933.07

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110059	浦发转债	104,616,037.88	8.38
2	113042	上银转债	7,594,526.99	0.61
3	123104	卫宁转债	2,474,695.19	0.20
4	127066	科利转债	1,322,199.02	0.11
5	113044	大秦转债	466,628.57	0.04
6	113661	福 22 转债	116,990.85	0.01

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 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，分项之和与合计可能有尾差。

## § 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 (%)
红土创新稳进混合 A	2,541	59,818.95	57,313,450.35	37.71	94,686,504.84	62.29
红土创新稳进混合 C	9,824	85,906.94	44,846,423.43	5.31	799,103,357.58	94.69
合计	12,210	81,568.36	102,159,873.78	10.26	893,789,862.42	89.74

### 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	红土创新稳进混合 A	2,762,288.75	1.82
	红土创新稳进混合 C	654,474.53	0.08
	合计	3,416,763.28	0.34

### 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	红土创新稳进混合 A	0~10
	红土创新稳进混合 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	红土创新稳进混合 A	0~10
	红土创新稳进混合 C	-
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	红土创新稳进混合 A	红土创新稳进混合 C
基金合同生效日 (2020 年 3 月 6 日) 基金份额总额	127,745,020.35	267,502,827.73

本报告期期初基金份额总额	82,714,914.84	607,806,442.89
本报告期基金总申购份额	131,478,621.46	1,548,261,451.56
减：本报告期基金总赎回份额	62,193,581.11	1,312,118,113.44
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	151,999,955.19	843,949,781.01

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

本报告期基金管理人、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

本报告期，无涉及基金管理人、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

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任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。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 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 (%)	

兴业证券	2	55,870,016.66	100.00	41,113.49	100.00	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-

### 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(%)
兴业证券	157,441,751.82	100.00	1,071,470,000.00	100.00	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-

### 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	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华夏银行为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024年3月14日
2	红土创新基金管理有限公司关于旗下	中国证监会基金电子披	2024年4月3日

	部分基金新增平安银行为销售机构的公告	露网站、规定报社及本公司网站	
3	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增邮储银行（“邮你同赢”平台）为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 4 月 8 日
4	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增金元证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 4 月 8 日
5	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增京东肯特瑞为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 4 月 9 日
6	红土创新基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在盈米基金销售有限公司申购起点金额的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 4 月 9 日
7	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信建投为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 4 月 10 日
8	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 4 月 24 日
9	红土创新基金管理有限公司关于谨防不法分子假冒“红土创新基金”名义进行非法活动的声明	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 5 月 7 日
10	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 5 月 17 日
11	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海挖财基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 5 月 29 日
12	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京雪球基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 5 月 31 日
13	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增山西证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 5 月 31 日
14	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华宝证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 6 月 3 日
15	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增恒泰证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 6 月 12 日
16	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国泰君安为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 6 月 17 日

17	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增山西证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 6 月 27 日
18	红土创新稳进混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 6 月 29 日
19	红土创新基金管理有限公司旗下基金改聘会计师事务所公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 6 月 29 日

## § 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

无。

### 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) 中国证监会批准红土创新稳进混合证券投资基金设立的文件
- (2) 红土创新稳进混合证券投资基金基金合同
- (3) 红土创新稳进混合证券投资基金托管协议
- (4) 红土创新稳进混合证券投资基金招募说明书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (6) 报告期内红土创新稳进混合证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 12.3 查阅方式

公司网站：[www.htcxfund.com](http://www.htcxfund.com)

红土创新基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日