

红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型
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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
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	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
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
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42

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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
§ 8 基金份额持有人信息.....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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.....	44
§ 9 开放式基金份额变动.....	44
§ 10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	46
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
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.....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
§ 12 备查文件目录.....	47
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金	
基金简称	红土创新科技创新 3 个月定开混合	
基金主代码	009467	
基金运作方式	契约型定期开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 3 日	
基金管理人	红土创新基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	173,304,035.05 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	红土创新科技创新 3 个月定开混合 A	红土创新科技创新 3 个月定开混合 C
下属分级基金的交易代码	009467	013173
报告期末下属分级基金的份额总额	135,413,553.85 份	37,890,481.20 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于科技创新主题的上市公司发行的股票，精选具备较高流动性和市值代表性、具有核心成长能力的优质公司。在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以封闭期为周期进行投资运作。本基金在封闭期与开放期采取不同投资策略。 (一) 封闭期投资策略：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略、其他金融工具投资策略； (二) 开放期投资策略
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率*70%+中证全债指数收益率*30%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险收益水平高于债券型基金和货币市场基金，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	红土创新基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
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	95559
传真	0755-33011855	021-62701216

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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	深圳市南山区海德三道 1066 号深创投广场 48 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	518048	200336
法定代表人	阮菲	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.htcxfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

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)	
	红土创新科技创新 3 个月定开混合 A	红土创新科技创新 3 个月定开混合 C
本期已实现收益	-14,525,222.49	-4,004,620.45
本期利润	-1,108,617.01	-355,456.72
加权平均基金份 额本期利润	-0.0080	-0.0092
本期加权平均净 值利润率	-1.25%	-1.47%
本期基金份额净 值增长率	-1.25%	-1.43%
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	-52,290,102.62	-14,865,645.94
期末可供分配基 金份额利润	-0.3862	-0.3923

期末基金资产净值	87,434,315.41	24,210,270.21
期末基金份额净值	0.6457	0.6390
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	-35.43%	-36.10%

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

红土创新科技创新 3 个月定开混合 A

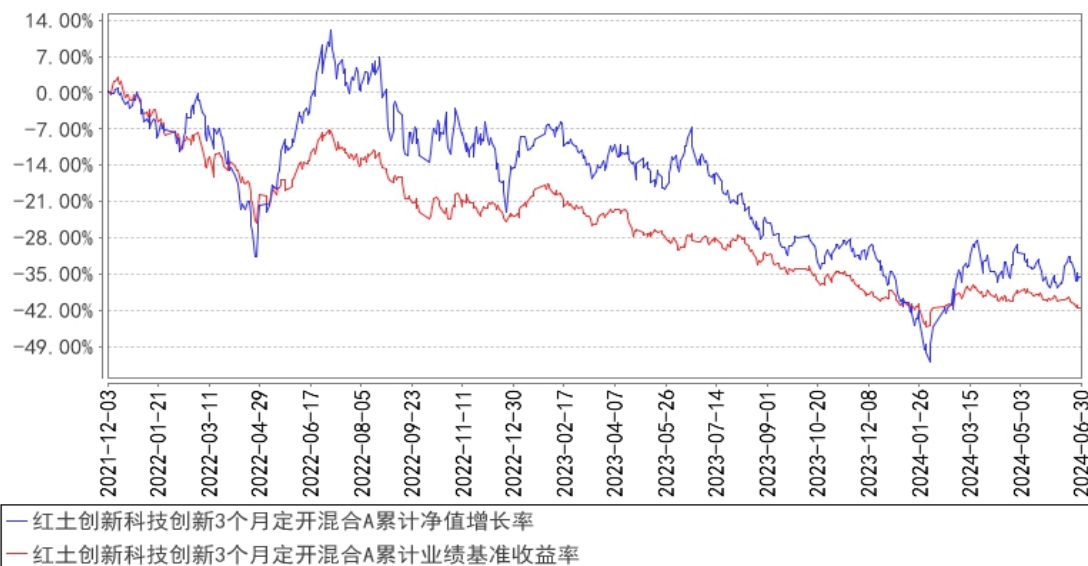
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.41%	1.82%	-2.65%	0.63%	6.06%	1.19%
过去三个月	-4.57%	1.78%	-4.10%	0.81%	-0.47%	0.97%
过去六个月	-1.25%	2.37%	-5.84%	1.01%	4.59%	1.36%
过去一年	-26.71%	1.89%	-18.71%	0.92%	-8.00%	0.97%
自基金合同生效起至今	-35.43%	1.94%	-41.65%	1.01%	6.22%	0.93%

红土创新科技创新 3 个月定开混合 C

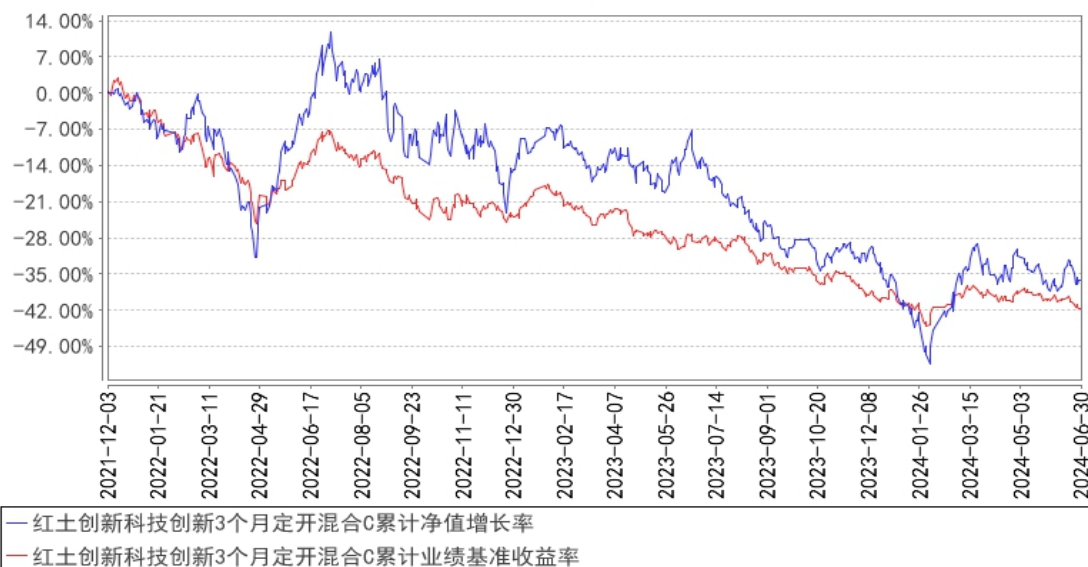
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.38%	1.83%	-2.65%	0.63%	6.03%	1.20%
过去三个月	-4.67%	1.79%	-4.10%	0.81%	-0.57%	0.98%
过去六个月	-1.43%	2.37%	-5.84%	1.01%	4.41%	1.36%
过去一年	-27.00%	1.89%	-18.71%	0.92%	-8.29%	0.97%
自基金合同生效起至今	-36.10%	1.94%	-41.65%	1.01%	5.55%	0.93%

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

红土创新科技创新3个月定开混合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



红土创新科技创新3个月定开混合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



3.3 其他指标

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

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		
赵波	本基金的基金经理	2024年2月7日	-	16年	伦敦大学皇家霍洛威学院理学学士、英国城市大学卡斯商学院理学硕士、中国社会科学院经济学博士。历任中银国际证券有限责任公司高级分析员，长城基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、基金经理，招商证券资产管理有限公司基金经理。现任本公司红土创新科技创新3个月定期开放混合型证券投资基金、红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金基金经理。
盖俊龙	本基金的基金经理	2021年12月3日	2024年2月7日	18年	历任长城基金管理有限公司行业研究员；宝盈基金管理有限公司研究员、专户投资经理、基金经理。现任本公司投资部总监，红土创新转型精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）、红土创新新科技股票型发起式证券投资基金、红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金基金经理。

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合规守信情况的说明

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、《红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型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

报告期内未发现本基金存在不公平交易及异常交易的情况。

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

复盘一季度，市场对今年极度悲观，市场 2 月底见底，然后春节后开始快速的修复极度悲观的预期，反弹迅速。进入二季度市场反弹后重新进入缩量下跌的趋势，究其原因还是因为地产的持续疲弱以及经济复苏节奏较慢导致，沪指重新回到 3000 点下方。分行业看红利相对表现抗跌，也代表市场较低的风险偏好。成长方向仅 AI 仍然是行业相对较热，海外的 AI 龙头公司表现良好让行业前景展现乐观。

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科技创新 3 个月定开混合 A 的基金份额净值为 0.6457 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.25%，同期业绩比较基准收益率为-5.84%；截至本报告期末红土创新科

技创新 3 个月定开混合 C 的基金份额净值为 0.6390 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.43%，同期业绩比较基准收益率为-5.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度美国进入大选年，上半年相对比较强的出口可能会受到大选影响回调。另外美国的数据也是在变弱，降息的预期越来越强。如果降息将会给中国国内的利率政策给出更多的空间，判断市场仍然不会在指数上有较大行情，结构上成长在经历上半年的大跌后，悲观预期将会得到修复，看好方向仍然是 AI、智能驾驶、苹果链和半导体等。

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

本报告期内，基金托管人在红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，红土创新基金管理有限公司在红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收

益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由红土创新基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关红土创新科技创新3个月定期开放混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：红土创新科技创新3个月定期开放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
资产：			
货币资金	6.4.7.1	136,102.67	1,181,336.34
结算备付金		6,319,385.88	17,670,939.27
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	105,415,152.40	103,108,839.32
其中：股票投资		105,415,152.40	103,108,839.32
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	12,729.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		111,870,640.95	121,973,844.41

负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	1,139,670.99
应付管理人报酬		110,211.55	168,787.17
应付托管费		18,368.62	28,131.18
应付销售服务费		7,967.56	9,426.53
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	89,507.60	180,000.00
负债合计		226,055.33	1,526,015.87
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	173,304,035.05	184,543,011.30
未分配利润	6.4.7.12	-61,659,449.43	-64,095,182.76
净资产合计		111,644,585.62	120,447,828.54
负债和净资产总计		111,870,640.95	121,973,844.41

注： 报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 173,304,035.05 份，其中红土创新科技创新 3 个月定开混合 A 基金份额总额 135,413,553.85 份，基金份额净值 0.6457 元；红土创新科技创新 3 个月定开混合 C 基金份额总额 37,890,481.20 份，基金份额净值 0.6390 元。

6.2 利润表

会计主体：红土创新科技创新 3 个月定期开放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
一、营业总收入		-544,744.79	8,027,924.32
1. 利息收入		8,731.95	25,656.50
其中：存款利息收入	6.4.7.13	8,731.95	25,656.50
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		-	-

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-17,619,264.43	11,202,640.32
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-18,068,936.80	11,162,856.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-826,305.75
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	449,672.37	866,089.51
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	17,065,769.21	-3,200,497.15
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	18.48	124.65
减：二、营业总支出		919,328.94	1,936,376.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	669,892.61	1,510,922.72
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	111,648.78	251,820.42
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	48,045.51	84,147.13
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	50.90
8. 其他费用	6.4.7.23	89,742.04	89,435.15
三、利润总额（亏损总 额以“-”号填列）		-1,464,073.73	6,091,548.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		-1,464,073.73	6,091,548.00
五、其他综合收益的税 后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,464,073.73	6,091,548.00

6.3 净资产变动表

会计主体：红土创新科技创新 3 个月定期开放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	184,543,011.30	-	-64,095,182.76	120,447,828.54
二、本期期初净资产	184,543,011.30	-	-64,095,182.76	120,447,828.54
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-11,238,976.25	-	2,435,733.33	-8,803,242.92
(一)、综合收益总额	-	-	-1,464,073.73	-1,464,073.73
(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)	-11,238,976.25	-	3,899,807.06	-7,339,169.19
其中：1. 基金申购款	227,823.19	-	-77,846.80	149,976.39
2. 基金赎回款	-11,466,799.44	-	3,977,653.86	-7,489,145.58
(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	173,304,035.05	-	-61,659,449.43	111,644,585.62
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	240,027,343.66	-	-34,920,162.84	205,107,180.82
二、本期期初净资产	240,027,343.66	-	-34,920,162.84	205,107,180.82
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-17,156,253.28	-	8,132,647.61	-9,023,605.67
(一)、综合收益总额	-	-	6,091,548.00	6,091,548.00
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数	-17,156,253.28	-	2,041,099.61	-15,115,153.67

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	915,124.57	-	-85,205.25	829,919.32
2. 基金赎回款	-18,071,377.85	-	2,126,304.86	-15,945,072.99
(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	222,871,090.38	-	-26,787,515.23	196,083,575.15

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：

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

红土创新科技创新 3 个月定期开放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”)[2020]446 号《关于准予红土创新科技创新三个月滚动持有混合型证券投资基金注册的批复》及证监许可[2021]2030 号《关于准予红土创新科技创新三个月滚动持有混合型证券投资基金变更注册的批复》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《红土创新科技创新 3 个月定期开放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人民币 374,919,643.91 元,业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(2021)第 1132 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 12 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 374,964,605.65 份基金份额,其中认购资金利息折合 44,961.74 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金以定期开放方式运作,即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效日起(包括该日)至 3 个月后对日的前一日(包括该日)的期间。第二个封

闭期为自首个开放期结束之日次日起(包括该日)至 3 个月后对日的前一日(包括该日)的期间,以此类推。本基金在封闭期内不接受申购、赎回、转换转入、转换转出等交易的申请。本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日起(包括该日)进入开放期,期间可以办理申购与赎回等业务。本基金每个开放期不少于 5 个工作日并且最长不超过 20 个工作日,开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。

根据《红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金合同》,本基金根据认购、申购费用收取方式的不同,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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括科创板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、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)。基金的投资组合比例为:封闭期内,本基金的股票及存托凭证投资比例为基金资产的 60%-95%,投资于科创主题的证券资产比例不低于非现金基金资产的 80%;但在每次开放期前 5 个工作日、开放期及开放期结束后 5 个工作日的期间内,不受前述投资组合比例的限制。封闭期内,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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。开放期内,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,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。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:中国战略新兴产业成份指数收益率*70%+中证全债指数收益率*30%。

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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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期末和上年度末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产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会计年度报告一致。

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。

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 2018 年 1 月 1 日起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。

(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	136,102.67
等于：本金	136,095.07
加：应计利息	7.60
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	136,102.67

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	88,880,109.68	-	105,415,152.40	16,535,042.72
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	88,880,109.68	-	105,415,152.40	16,535,042.72

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,507.60
合计	89,507.60

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

红土创新科技创新 3 个月定开混合 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	145,256,902.39	145,256,902.39
本期申购	147,555.88	147,555.88
本期赎回（以“-”号填列）	-9,990,904.42	-9,990,904.42
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	135,413,553.85	135,413,553.85

红土创新科技创新 3 个月定开混合 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	39,286,108.91	39,286,108.91
本期申购	80,267.31	80,267.31
本期赎回（以“-”号填列）	-1,475,895.02	-1,475,895.02
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	37,890,481.20	37,890,481.20

注：申购含红利再投、级别调整入份额。赎回含级别调整出份额。

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

红土创新科技创新 3 个月定开混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-41,214,552.48	-9,064,918.88	-50,279,471.36
本期期初	-41,214,552.48	-9,064,918.88	-50,279,471.36
本期利润	-14,525,222.49	13,416,605.48	-1,108,617.01
本期基金份额交易产生的变动数	3,449,672.35	-40,822.42	3,408,849.93
其中：基金申购款	-52,562.40	2,917.20	-49,645.20
基金赎回款	3,502,234.75	-43,739.62	3,458,495.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-52,290,102.62	4,310,864.18	-47,979,238.44

红土创新科技创新 3 个月定开混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-11,376,519.95	-2,439,191.45	-13,815,711.40
本期期初	-11,376,519.95	-2,439,191.45	-13,815,711.40
本期利润	-4,004,620.45	3,649,163.73	-355,456.72
本期基金份额交易产生的变动数	515,494.46	-24,537.33	490,957.13
其中：基金申购款	-28,450.26	248.66	-28,201.60
基金赎回款	543,944.72	-24,785.99	519,158.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-14,865,645.94	1,185,434.95	-13,680,210.99

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	312.60
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	8,419.35
其他	-
合计	8,731.95

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	-18,068,936.80
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	-18,068,936.80

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	404,566,434.28
减：卖出股票成本总额	421,873,309.17
减：交易费用	762,061.91
买卖股票差价收入	-18,068,936.80

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

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

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	449,672.37
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	449,672.37

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	17,065,769.21
股票投资	17,065,769.21
债券投资	-
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	17,065,769.21

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	14.64

基金转换费收入	3.84
合计	18.48

注：1、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。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

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	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	70.00
存托服务费	164.44
合计	89,742.04

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作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

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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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

无。

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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	669,892.61	1,510,922.72
其中：应支付销售机构的客户维护费	297,567.43	680,034.93
应支付基金管理人的净管理费	372,325.18	830,887.79

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 1.20% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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
----	---------------------------------------	--

当期发生的基金应支付的托管费	111,648.78	251,820.42
----------------	------------	------------

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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		
	红土创新科技创新 3 个月定开混合 A	红土创新科技创新 3 个月定开混合 C	合计
交通银行	-	10,270.17	10,270.17
红土创新	-	2,147.16	2,147.16
合计	-	12,417.33	12,417.33
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		
	红土创新科技创新 3 个月定开混合 A	红土创新科技创新 3 个月定开混合 C	合计
交通银行	-	15,679.11	15,679.11
红土创新	-	3,030.90	3,030.90
合计	-	18,710.01	18,710.01

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 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给红土创新基金公司，再由红土创新基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

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

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

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自有资金投资本基金的情况

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

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
交通银行	136,102.67	312.60	988,010.08	836.50

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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以及进行投资风险分析与绩效评估，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交通银行，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。

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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

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

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

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，有效保障基金份额持有人利益。

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，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上市公司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未来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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。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、存出保证金和买入返售金融资产等。

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
资产					
货币资金	136,102.67	-	-	-	136,102.67
结算备付金	6,319,385.88	-	-	-	6,319,385.88
交易性金融资产	-	-	-	-105,415,152.40	105,415,152.40
资产总计	6,455,488.55	-	-	-105,415,152.40	111,870,640.95
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	110,211.55	110,211.55
应付托管费	-	-	-	18,368.62	18,368.62
应付销售服务费	-	-	-	7,967.56	7,967.56
其他负债	-	-	-	89,507.60	89,507.60
负债总计	-	-	-	226,055.33	226,055.33
利率敏感度缺口	6,455,488.55	-	-	-105,189,097.07	111,644,585.62
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	1,181,336.34	-	-	-	1,181,336.34
结算备付金	17,670,939.27	-	-	-	17,670,939.27
交易性金融资产	-	-	-	-103,108,839.32	103,108,839.32
应收申购款	-	-	-	12,729.48	12,729.48
资产总计	18,852,275.61	-	-	-103,121,568.80	121,973,844.41
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,139,670.99	1,139,670.99
应付管理人报酬	-	-	-	168,787.17	168,787.17
应付托管费	-	-	-	28,131.18	28,131.18
应付销售服务费	-	-	-	9,426.53	9,426.53
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	1,526,015.87	1,526,015.87
利率敏感度缺口	18,852,275.61	-	-	-101,595,552.93	120,447,828.54

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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的股票，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	105,415,152.40	94.42	103,108,839.32	85.60
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	105,415,152.40	94.42	103,108,839.32	85.60

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%	3,039,107.60	8,362,021.81
2. 沪深 300 指数下降 5%	-3,039,107.60	-8,362,021.81	

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	105,415,152.40	103,108,839.32
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	105,415,152.40	103,108,839.32

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

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	105,415,152.40	94.23
	其中：股票	105,415,152.40	94.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	6,455,488.55	5.77
8	其他各项资产	-	-
9	合计	111,870,640.95	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	-	-

C	制造业	97,663,300.98	87.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	263,500.00	0.24
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,365,151.42	6.60
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	-	-
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	123,200.00	0.11
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	105,415,152.40	94.42

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	300502	新易盛	90,000	9,499,500.00	8.51
2	300308	中际旭创	63,000	8,686,440.00	7.78
3	002463	沪电股份	194,000	7,081,000.00	6.34
4	002281	光迅科技	141,800	5,299,066.00	4.75
5	300476	胜宏科技	150,000	4,839,000.00	4.33
6	688256	寒武纪	23,700	4,708,479.00	4.22
7	002475	立讯精密	118,000	4,638,580.00	4.15
8	002938	鹏鼎控股	108,000	4,294,080.00	3.85
9	300394	天孚通信	44,000	3,890,480.00	3.48
10	002594	比亚迪	15,000	3,753,750.00	3.36
11	002371	北方华创	11,000	3,518,790.00	3.15
12	601138	工业富联	123,000	3,370,200.00	3.02
13	603986	兆易创新	33,000	3,155,460.00	2.83
14	688183	生益电子	145,000	2,810,100.00	2.52
15	002085	万丰奥威	200,500	2,654,620.00	2.38

16	688981	中芯国际	53,000	2,443,300.00	2.19
17	300552	万集科技	64,000	2,392,320.00	2.14
18	002922	伊戈尔	100,000	2,186,000.00	1.96
19	300661	圣邦股份	26,000	2,152,280.00	1.93
20	300570	太辰光	65,000	2,122,900.00	1.90
21	688676	金盘科技	38,808	2,023,837.20	1.81
22	689009	九号公司	50,000	1,840,500.00	1.65
23	688766	普冉股份	18,878	1,834,375.26	1.64
24	001309	德明利	21,000	1,814,400.00	1.63
25	688631	莱斯信息	29,021	1,799,882.42	1.61
26	600487	亨通光电	110,000	1,734,700.00	1.55
27	002384	东山精密	80,000	1,656,000.00	1.48
28	002130	沃尔核材	105,000	1,482,600.00	1.33
29	688076	诺泰生物	17,000	1,330,760.00	1.19
30	688518	联赢激光	52,844	882,494.80	0.79
31	600150	中国船舶	20,000	814,200.00	0.73
32	603171	税友股份	30,000	811,200.00	0.73
33	002273	水晶光电	44,000	747,120.00	0.67
34	300857	协创数据	12,000	684,000.00	0.61
35	300779	惠城环保	11,000	532,400.00	0.48
36	300757	罗博特科	5,600	489,160.00	0.44
37	688608	恒玄科技	2,944	430,942.72	0.39
38	600114	东睦股份	20,000	287,800.00	0.26
39	001267	汇绿生态	50,000	263,500.00	0.24
40	002947	恒铭达	4,000	140,800.00	0.13
41	000526	学大教育	2,000	123,200.00	0.11
42	301486	致尚科技	2,000	84,620.00	0.08
43	605499	东鹏饮料	300	64,725.00	0.06
44	300496	中科创达	1,000	45,590.00	0.04

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	300394	天孚通信	10,376,149.00	8.61
2	300857	协创数据	7,521,574.00	6.24
3	001309	德明利	7,116,160.00	5.91
4	300570	太辰光	6,862,002.00	5.70
5	002371	北方华创	5,772,265.00	4.79
6	300573	兴齐眼药	5,573,283.00	4.63
7	688631	莱斯信息	5,380,406.79	4.47
8	601766	中国中车	5,219,389.00	4.33

9	603283	赛腾股份	5,108,068.00	4.24
10	300017	网宿科技	5,068,943.00	4.21
11	688256	寒武纪	4,892,550.31	4.06
12	300476	胜宏科技	4,849,697.92	4.03
13	601138	工业富联	4,841,191.00	4.02
14	002714	牧原股份	4,838,007.00	4.02
15	002916	深南电路	4,484,147.00	3.72
16	689009	九号公司	4,412,117.35	3.66
17	300552	万集科技	4,287,636.00	3.56
18	002475	立讯精密	4,262,039.34	3.54
19	300364	中文在线	4,076,436.00	3.38
20	603129	春风动力	4,009,372.00	3.33
21	601567	三星医疗	4,001,946.00	3.32
22	603606	东方电缆	3,901,098.00	3.24
23	688037	芯源微	3,879,786.96	3.22
24	605296	神农集团	3,792,420.00	3.15
25	601111	中国国航	3,767,675.00	3.13
26	600557	康缘药业	3,748,698.00	3.11
27	002938	鹏鼎控股	3,736,772.00	3.10
28	605499	东鹏饮料	3,705,383.00	3.08
29	603486	科沃斯	3,601,396.00	2.99
30	002594	比亚迪	3,582,745.00	2.97
31	301308	江波龙	3,535,451.08	2.94
32	688498	源杰科技	3,463,626.02	2.88
33	000725	京东方 A	3,348,700.00	2.78
34	001696	宗申动力	3,309,255.00	2.75
35	002085	万丰奥威	3,306,683.00	2.75
36	603993	洛阳钼业	3,272,833.00	2.72
37	000977	浪潮信息	3,243,838.00	2.69
38	300181	佐力药业	3,191,657.00	2.65
39	600114	东睦股份	3,145,682.00	2.61
40	300133	华策影视	3,049,672.00	2.53
41	000100	TCL 科技	3,017,427.90	2.51
42	600160	巨化股份	2,958,168.00	2.46
43	603337	杰克股份	2,956,297.00	2.45
44	002705	新宝股份	2,916,766.00	2.42
45	000568	泸州老窖	2,891,220.00	2.40
46	603986	兆易创新	2,836,902.00	2.36
47	601899	紫金矿业	2,833,860.00	2.35
48	688208	道通科技	2,799,827.20	2.32
49	688259	创耀科技	2,785,639.94	2.31
50	600519	贵州茅台	2,779,819.00	2.31
51	600809	山西汾酒	2,767,998.00	2.30

52	300661	圣邦股份	2,727,976.00	2.26
53	688169	石头科技	2,704,096.23	2.25
54	688076	诺泰生物	2,695,645.05	2.24
55	688981	中芯国际	2,679,585.70	2.22
56	002281	光迅科技	2,624,411.00	2.18
57	688183	生益电子	2,605,220.59	2.16
58	000099	中信海直	2,581,574.00	2.14
59	300496	中科创达	2,580,880.00	2.14
60	603444	吉比特	2,558,862.80	2.12
61	300280	紫天科技	2,521,238.00	2.09
62	600487	亨通光电	2,499,025.00	2.07
63	688095	福昕软件	2,472,375.77	2.05
64	688676	金盘科技	2,454,812.84	2.04
65	603200	上海洗霸	2,440,213.00	2.03

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	300394	天孚通信	8,962,556.01	7.44
2	300570	太辰光	7,331,341.00	6.09
3	000997	新大陆	7,169,288.00	5.95
4	300757	罗博特科	7,137,978.00	5.93
5	300857	协创数据	6,448,082.00	5.35
6	001309	德明利	6,041,750.10	5.02
7	300017	网宿科技	5,542,489.00	4.60
8	300573	兴齐眼药	5,386,831.00	4.47
9	601766	中国中车	5,291,775.00	4.39
10	688123	聚辰股份	4,958,451.55	4.12
11	002714	牧原股份	4,685,587.57	3.89
12	603283	赛腾股份	4,669,645.00	3.88
13	300130	新国都	4,638,563.00	3.85
14	688631	莱斯信息	4,552,587.92	3.78
15	601567	三星医疗	4,385,307.00	3.64
16	002916	深南电路	4,215,200.00	3.50
17	300364	中文在线	4,060,573.74	3.37
18	002085	万丰奥威	3,956,864.30	3.29
19	603606	东方电缆	3,900,263.00	3.24
20	603129	春风动力	3,819,477.00	3.17
21	000977	浪潮信息	3,721,841.00	3.09
22	601111	中国国航	3,721,175.00	3.09
23	605296	神农集团	3,711,853.20	3.08
24	301308	江波龙	3,619,110.00	3.00
25	605499	东鹏饮料	3,545,617.00	2.94

26	688498	源杰科技	3,531,869.12	2.93
27	603993	洛阳钼业	3,527,655.00	2.93
28	300181	佐力药业	3,480,131.00	2.89
29	002465	海格通信	3,409,562.00	2.83
30	688037	芯源微	3,407,880.02	2.83
31	688048	长光华芯	3,374,601.73	2.80
32	600557	康缘药业	3,311,571.00	2.75
33	603486	科沃斯	3,277,354.00	2.72
34	688008	澜起科技	3,255,070.91	2.70
35	001696	宗申动力	3,248,633.00	2.70
36	300502	新易盛	3,179,935.00	2.64
37	002371	北方华创	3,136,192.00	2.60
38	000725	京东方 A	3,116,000.00	2.59
39	688439	振华风光	3,101,019.97	2.57
40	300133	华策影视	3,094,284.00	2.57
41	603712	七一二	3,092,486.00	2.57
42	002281	光迅科技	3,079,628.00	2.56
43	002705	新宝股份	3,078,667.00	2.56
44	600809	山西汾酒	2,982,516.00	2.48
45	000100	TCL 科技	2,885,700.00	2.40
46	600519	贵州茅台	2,859,542.00	2.37
47	603337	杰克股份	2,853,854.00	2.37
48	688208	道通科技	2,833,794.67	2.35
49	688169	石头科技	2,828,257.00	2.35
50	600114	东睦股份	2,801,445.00	2.33
51	688270	臻镭科技	2,724,848.01	2.26
52	600160	巨化股份	2,721,823.00	2.26
53	300951	博硕科技	2,721,363.00	2.26
54	301391	卡莱特	2,707,233.00	2.25
55	601899	紫金矿业	2,702,020.00	2.24
56	689009	九号公司	2,652,313.64	2.20
57	000568	泸州老窖	2,626,356.00	2.18
58	002558	巨人网络	2,623,211.00	2.18
59	603444	吉比特	2,588,269.00	2.15
60	300308	中际旭创	2,560,386.00	2.13
61	601858	中国科传	2,558,503.00	2.12
62	300280	紫天科技	2,502,061.00	2.08
63	603200	上海洗霸	2,482,640.00	2.06
64	000676	智度股份	2,449,172.00	2.03

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	407,113,853.04
卖出股票收入（成交）总额	404,566,434.28

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

无。

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

无。

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

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

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

无。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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 科技创新 3 个月定 开混合 A	2,029	66,739.06	98,834.23	0.07	135,314,719.62	99.93
红土创新 科技创新 3 个月定 开混合 C	2,855	13,271.62	410,018.00	1.08	37,480,463.20	98.92
合计	4,823	35,932.83	508,852.23	0.29	172,795,182.82	99.71

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	红土创新科技创新 3 个月定开 混合 A	115,636.34	0.09

有从业人员持有本基金	红土创新科技创新 3 个月定开混合 C	553,533.61	1.46
	合计	669,169.95	0.39

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	红土创新科技创新 3 个月定开混合 A	10~50
	红土创新科技创新 3 个月定开混合 C	50~100
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	红土创新科技创新 3 个月定开混合 A	0
	红土创新科技创新 3 个月定开混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	红土创新科技创新 3 个月定开混合 A	红土创新科技创新 3 个月定开混合 C
基金合同生效日 (2021 年 12 月 3 日) 基金份额总额	271,603,968.88	103,360,636.77
本报告期期初基金份额总额	145,256,902.39	39,286,108.91
本报告期基金总申购份额	147,555.88	80,267.31
减：本报告期基金总赎回份额	9,990,904.42	1,475,895.02
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	135,413,553.85	37,890,481.20

§ 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 (%)	
招商证券	2	811,680,287.32	100.00	-	-	-

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 (%)
招商证券	-	-	-	-	-	-

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	红土创新科技创新3个月定期开放混合型证券投资基金基金经理变更公告	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2月9日
2	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
3	红土创新科技创新3个月定期开放混合型证券投资基金开放日常申购（赎回、转换）业务公告	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29日
4	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增平安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4月3日
5	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
6	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
7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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

15	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
16	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
17	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
18	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
19	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
20	红土创新科技创新 3 个月定期开放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
21	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科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金合同
- (3) 红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金托管协议
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (5) 报告期内红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型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

红土创新基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日