

# 红塔红土盛利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：红塔红土基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 27 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	8
<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	12
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	12
<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	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
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 .....	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	43
7.12 投资组合报告附注 .....	43
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
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 .....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>45</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>48</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 .....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	49
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录 .....	49
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	红塔红土盛利混合型证券投资基金	
基金简称	红塔红土盛利混合	
基金主代码	012216	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 2 日	
基金管理人	红塔红土基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	13,037,770.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	红塔红土盛利混合 A	红塔红土盛利混合 C
下属分级基金的交 易代码	012216	012217
报告期末下属分级 基金的份额总额	326,375.24 份	12,711,395.04 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将在严格控制投资组合风险的前提下，寻找有持续增长潜力且相对被市场低估的个券，优化投资组合，力求实现持续稳健的资产增值。
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、股指期货投资策略、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、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×55%+中债总指数（财富）收益率×45%
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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王园	张立学
	联系电话	0755-33328600	010-68858113
	电子邮箱	htservice@htamc.com.cn	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		4001-666-916（免长途话费）	95580
传真		0755-33379015	010-68858120
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	北京市西城区金融大街 3 号
办公地址		深圳市前海深港合作区南山街道	北京市西城区金融大街 3 号 A 座

	前湾一路 399 号前海嘉里商务中心四期 1 栋 2301	
邮政编码	518052	100808
法定代表人	龚香林	刘建军

## 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	<a href="http://www.htamc.com.cn">http://www.htamc.com.cn</a>
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	深圳市前海深港合作区南山街道前湾一路 399 号前海嘉里商务中心四期 1 栋 2301

## § 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)		
	红塔红土盛利混合 A	红塔红土盛利混合 C	
本期已实现收益	-6,455,400.39	-2,539,921.40	
本期利润	5,834,091.87	589,354.79	
加权平均基金份额本期利润	0.0477	0.0431	
本期加权平均净值利润率	5.37%	4.85%	
本期基金份额净值增长率	1.90%	1.68%	
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	-89,221.63	-3,579,128.51
	期末可供分配基金份额利润	-0.2734	-0.2816
	期末基金资产净值	294,407.63	11,331,121.22
	期末基金份额净值	0.9021	0.8914

值		
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	-9.79%	-10.86%

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。

### 3.2 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

红塔红土盛利混合 A

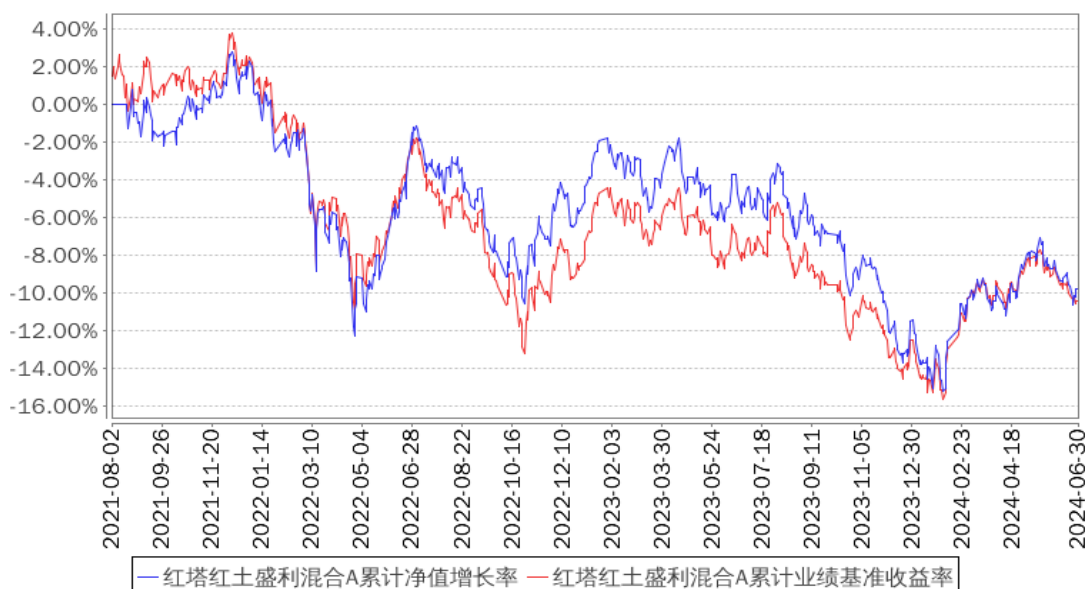
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.20%	0.34%	-1.41%	0.26%	0.21%	0.08%
过去三个月	0.71%	0.45%	-0.36%	0.40%	1.07%	0.05%
过去六个月	1.90%	0.54%	2.33%	0.48%	-0.43%	0.06%
过去一年	-5.03%	0.53%	-2.84%	0.47%	-2.19%	0.06%
自基金合同生效起至今	-9.79%	0.58%	-10.45%	0.56%	0.66%	0.02%

红塔红土盛利混合 C

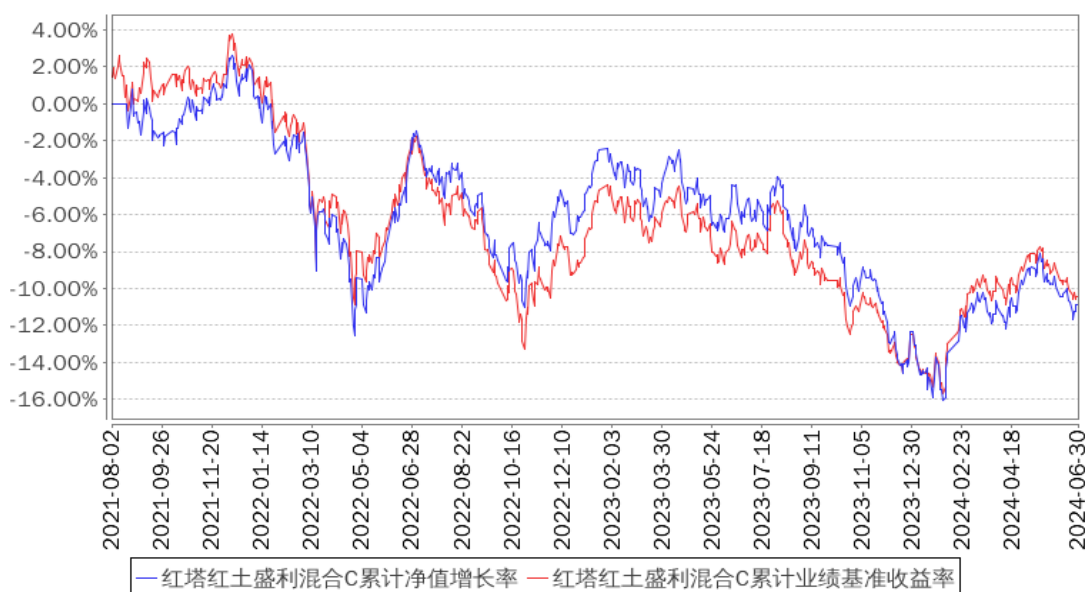
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.24%	0.34%	-1.41%	0.26%	0.17%	0.08%
过去三个月	0.60%	0.45%	-0.36%	0.40%	0.96%	0.05%
过去六个月	1.68%	0.54%	2.33%	0.48%	-0.65%	0.06%
过去一年	-5.43%	0.53%	-2.84%	0.47%	-2.59%	0.06%
自基金合同生效起至今	-10.86%	0.58%	-10.45%	0.56%	-0.41%	0.02%

### 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

红塔红土盛利混合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



红塔红土盛利混合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

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%。公司业务范围包括公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理。

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，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。

截止至 2024 年 6 月 30 日，公司共有员工 61 人，其中 38 人具有硕士或博士学位；截止 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 20 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		
吴秋松	基金经理	2021 年 8 月 2 日	-	8 年	复旦大学管理学硕士，哈尔滨工业大学工学学士，CFA。曾先后任职于君证资本管理有限公司、银泰证券有限责任公司，2017 年 10 月加入红塔红土基金管理有限公司，现任职红塔红土基金管理有限公司公募投资部，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法律法规、行业协会关于从业人员资格管理的相关规定。

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

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

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

2024 年上半年，国内实际 GDP 同比增长 5.0%，其中二季度实际 GDP 同比增长 4.7%，低于一季度的同比增速。2024 年上半年固定资产投资同比增长 3.9%，其中狭义基建投资同比增长 5.4%、制造业投资同比增速为 9.5%，这两项仍是固定资产投资增速的主要支撑，而房地产开发投资同比增速为-10.1%，仍是主要拖累项。2024 年上半年社会消费品零售总额同比增长 3.7%，其中商品零售额同比增长 3.2%，而餐饮收入、服务零售额分别同比增长 7.9%、7.5%，延续较高的增速。出口方面，2024 年上半年出口总额（按美元计）同比增长 3.6%，主要原因或是外需回暖以及 2023 年同期基数较低。货币流动性方面，央行在 2024 年 2 月 5 日降准 0.5 个百分点，向市场提供长期流动性约 1 万亿元；在 2 月 20 日，5 年期以上 LPR 报价下降 25BP，降息幅度超出市场预期；而在二季度，央行并无降准或降息，主要是缩量平价续作 MLF。总的来看，2024 年上半年资金利率水平虽有波动，但资金面整体保持平稳。

2024 年上半年，A 股市场整体呈现震荡走势，先是年初监管层密集出台政策支持，市场流动性风险得到缓解，A 股市场迎来反弹上行的行情，后自 5 月份开始，或因受部分经济数据以及社

融数据不及预期等因素的影响，主要宽基指数震荡下行。2024 年上半年行业指数（申万一级行业）的表现分化明显，银行、煤炭、公用事业行业指数涨幅领先，上涨幅度均超过了 10%，而综合、计算机、商贸零售、社会服务行业指数跌幅靠前，下跌幅度均超过了 24%。

报告期内，本基金行业配置较为均衡，优选行业内优质龙头公司以及具备中长期成长空间的公司个股。

#### 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利混合 A 基金份额净值为 0.9021 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.90%；截至本报告期末红塔红土盛利混合 C 基金份额净值为 0.8914 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.68%；同期业绩比较基准收益率为 2.33%。

#### 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 2024 年下半年，国内宏观经济方面，我们预计制造业投资仍能保持较高的增速，尤其是高技术制造业；稳增长政策或进一步加力，基建投资有望保持一定的增速；地产政策或需进一步的调整优化，从而促使房地产开发投资增速下降幅度有可能收窄；出口增速在 2023 年同期低基数效应下预计能保持较好的韧性。此外，我们预计 PPI 同比降幅有望继续收窄，工业企业利润水平也有望回升。资金流动性方面，下半年经济要实现稳增长仍需货币政策呵护，此外，美联储有较大概率在年内开启降息，国内货币政策在下半年降准降息都有一定空间，所以我们预计下半年资金面大概率能保持平稳宽松。

结合宏观经济与货币流动性的判断，同时 A 股整体估值水平（截至 2024 年年中）处于历史低位水平，我们认为 2024 年下半年 A 股市场仍具备较好的中长期投资配置机会，但考虑到市场风险偏好的回升需要一定的时间，预计市场整体呈现震荡的情形，把握结构性的投资机会或更为重要。

#### 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、中国证券投资基金业协会相关指引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。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。基金管理人改

变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

#### 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，本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形；

本报告期内，本基金连续二十个工作日出现基金资产净值低于五千万元情形，时间范围为 2024 年 5 月 20 日至 2024 年 6 月 30 日。

## § 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在红塔红土盛利混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、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：红塔红土盛利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	1,284,802.00	2,088,665.41
结算备付金		995,201.30	158,843.85
存出保证金		57,795.60	38,405.40
交易性金融资产	6.4.7.2	7,291,668.61	153,148,445.51
其中：股票投资		6,072,930.53	98,439,144.10
基金投资		-	-
债券投资		1,218,738.08	54,709,301.41
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	2,200,000.00	4,003,523.70
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		68,561.30	1,485,529.56
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		11,898,028.81	160,923,413.43
<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		-	-
应付清算款		99,477.87	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,885.23	81,057.22
应付托管费		1,471.32	20,264.27
应付销售服务费		3,815.34	2,200.00
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	5,051.70
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	161,850.20	345,694.88
负债合计		272,499.96	454,268.07
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	13,037,770.28	181,339,220.03
未分配利润	6.4.7.12	-1,412,241.43	-20,870,074.67
净资产合计		11,625,528.85	160,469,145.36
负债和净资产总计		11,898,028.81	160,923,413.43

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，红塔红土盛利混合型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 0.9021 元，A 类基金份额 326,375.24 份；C 类基金份额净值人民币 0.8914 元，C 类基金份额 12,711,395.04 份；红塔红土盛利混合型证券投资基金基金份额总额合计为 13,037,770.28 份。

## 6.2 利润表

会计主体：红塔红土盛利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>		7,008,615.50	2,890,932.74
1. 利息收入		300,095.43	173,787.50
其中：存款利息收入	6.4.7.13	30,085.88	36,601.51
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		270,009.55	137,185.99
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-8,710,279.16	4,086,088.50
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-9,175,477.48	1,888,571.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	280,225.63	911,017.22
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	184,972.69	1,286,499.74
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	15,418,768.45	-1,369,084.81
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	30.78	141.55
<b>减: 二、营业总支出</b>		585,168.84	948,087.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	367,345.53	662,309.75
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	91,836.37	165,577.41
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	24,574.71	14,300.13
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		462.99	2,997.26
8. 其他费用	6.4.7.23	100,949.24	102,902.56
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		6,423,446.66	1,942,845.63
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		6,423,446.66	1,942,845.63
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		6,423,446.66	1,942,845.63

### 6.3 净资产变动表

会计主体: 红塔红土盛利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	181,339,220.03	-	-20,870,074.67	160,469,145.36
二、本期期初净资产	181,339,220.03	-	-20,870,074.67	160,469,145.36
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-168,301,449.75	-	19,457,833.24	-148,843,616.51
(一)、综合收益总额	-	-	6,423,446.66	6,423,446.66
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以	-168,301,449.75	-	13,034,386.58	-155,267,063.17

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	12,210,634.19	-	-1,867,369.09	10,343,265.10
2. 基金赎回款	-180,512,083.94	-	14,901,755.67	-165,610,328.27
(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	13,037,770.28	-	-1,412,241.43	11,625,528.85
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	245,263,705.14	-	-13,864,934.32	231,398,770.82
二、本期期初净资产	245,263,705.14	-	-13,864,934.32	231,398,770.82
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-17,947,358.73	-	2,422,062.19	-15,525,296.54
(一)、综合收益总额	-	-	1,942,845.63	1,942,845.63
(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)	-17,947,358.73	-	479,216.56	-17,468,142.17
其中：1. 基金申购款	2,858,933.24	-	-173,508.62	2,685,424.62
2. 基金赎回款	-20,806,291.97	-	652,725.18	-20,153,566.79
(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	227,316,346.41	-	-11,442,872.13	215,873,474.28

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：



杨洁

基金管理人负责人

杨洁

主管会计工作负责人

李志朋

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

红塔红土盛利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[2021]1303 号文《关于准予红塔红土盛利混合型证券投资基金注册的批复》核准,由红塔红土基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《红塔红土盛利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 220,284,451.00 元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2021)验字第 61014670\_H05 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《红塔红土盛利混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 8 月 2 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 220,285,337.44 份基金份额,其中认购资金利息折合 886.40 份基金份额。本基金的基金管理人为红塔红土基金管理有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《红塔红土盛利混合型证券投资基金基金合同》,在投资者认/申购时收取认/申购费,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别,称为 A 类基金份额;在投资者认/申购时不收取认/申购费,但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。计算公式为:计算日某类基金份额净值=计算日该类别基金资产净值/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《红塔红土盛利混合型证券投资基金基金合同》,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、分离交易债券、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、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: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；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×55%+中债总指数(财富)收益率×45%。

#### 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》、基金合同和中国证监会、中国基金业协会发布的其他相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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间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。

#### 6.4.5 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	1,284,802.00
等于：本金	1,284,525.67
加：应计利息	276.33

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	1,284,802.00

#### 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	6,435,873.19	-	6,072,930.53	-362,942.66	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,194,156.00	18,498.08	1,218,738.08	6,084.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,194,156.00	18,498.08	1,218,738.08	6,084.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	7,630,029.19	18,498.08	7,291,668.61	-356,858.66	

#### 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。

#### 6.4.7.4 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,200,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,200,000.00	-

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 其他资产

无。

6.4.7.7 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	70,500.96
其中：交易所市场	70,500.96
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	59,672.34
预提审计费	22,376.90
预提银行间账户维护费	9,300.00
合计	161,850.20

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

红塔红土盛利混合 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	173,892,813.52	173,892,813.52
本期申购	6,584.99	6,584.99
本期赎回（以“-”号填列）	-173,573,023.27	-173,573,023.27
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	326,375.24	326,375.24

红塔红土盛利混合 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	7,446,406.51	7,446,406.51
本期申购	12,204,049.20	12,204,049.20
本期赎回（以“-”号填列）	-6,939,060.67	-6,939,060.67
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	12,711,395.04	12,711,395.04

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

红塔红土盛利混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-14,030,859.42	-5,920,851.51	-19,951,710.93
本期期初	-14,030,859.42	-5,920,851.51	-19,951,710.93
本期利润	-6,455,400.39	12,289,492.26	5,834,091.87
本期基金份额交易产生的变动数	20,397,038.18	-6,311,386.73	14,085,651.45
其中：基金申购款	-1,459.87	847.54	-612.33
基金赎回款	20,398,498.05	-6,312,234.27	14,086,263.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-89,221.63	57,254.02	-31,967.61

红塔红土盛利混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-664,173.97	-254,189.77	-918,363.74
本期期初	-664,173.97	-254,189.77	-918,363.74
本期利润	-2,539,921.40	3,129,276.19	589,354.79
本期基金份额交易产生的变动数	-375,033.14	-676,231.73	-1,051,264.87
其中：基金申购款	-1,199,597.70	-667,159.06	-1,866,756.76
基金赎回款	824,564.56	-9,072.67	815,491.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,579,128.51	2,198,854.69	-1,380,273.82

6.4.7.10 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	20,344.92
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	9,354.69
其他	386.27
合计	30,085.88

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 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	123,254,471.81
减：卖出股票成本总额	132,248,890.53
减：交易费用	181,058.76
买卖股票差价收入	-9,175,477.48

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 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	348,933.43
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-68,707.80
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	280,225.63

##### 6.4.7.12.2 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	53,768,010.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	52,612,222.80
减：应计利息总额	1,224,495.06
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-68,707.80

##### 6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

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

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

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

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 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	184,972.69
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	184,972.69

#### 6.4.7.17 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	15,418,768.45
股票投资	15,425,405.65
债券投资	-6,637.20
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	15,418,768.45

#### 6.4.7.18 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	30.78
合计	30.78

#### 6.4.7.19 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.20 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	22,376.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,600.00
其他	300.00
合计	100,949.24

#### 6.4.7.21 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。

## 6.4.8 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，本基金无须披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须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未发生变化。

### 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
红塔红土基金管理有限公司（“红塔红土基金公司”）	基金管理人、注册登记机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司（“中国邮政储蓄银行”）	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

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 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	
	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	-	-	116,880,914.77	63.42

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	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 (%)
-	-	-	-	-
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 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	108,851.51	68.83	36,565.02	70.57

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 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等。

#### 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	367,345.53
其中：应支付销售机构的客户维护 费	14,380.66	197,766.28
应支付基金管理人的净管理费	352,964.87	464,543.47

注：支付基金管理人红塔红土基金公司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 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	91,836.37

注：支付基金托管人中国邮政储蓄银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

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		
	红塔红土盛利混合 A	红塔红土盛利混合 C	合计
红塔红土基金公司	-	-	-
红塔证券	-	6,987.99	6,987.99
合计	-	6,987.99	6,987.99
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		
	红塔红土盛利混合 A	红塔红土盛利混合 C	合计
红塔红土基金公司	-	1,391.99	1,391.99
红塔证券	-	11,395.21	11,395.21
合计	-	12,787.20	12,787.20

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，按月支付给红塔红土基金公司，再由红塔红土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固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
中国邮政储蓄银行	1,284,802.00	20,344.92	3,080,422.33	24,635.71

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管，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

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	受限期	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
688717	艾罗能源	2023年12月26日	6个月	新股锁定	55.66	47.02	2,158	120,114.28	101,469.16	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股锁定	19.86	42.51	192	3,813.12	8,161.92	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股锁定	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都	2024年1月	6个月	新股锁定	15.69	18.79	307	4,816.83	5,768.53	-

	华微	31 日								
601033	永兴股份	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股锁定	16.20	15.96	221	3,580.20	3,527.16	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股锁定	26.00	37.49	91	2,366.00	3,411.59	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.18	22.66	94	1,802.92	2,130.04	-
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股锁定	21.28	29.49	71	1,510.88	2,093.79	-
603375	盛景微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	新股锁定	38.18	38.90	44	1,679.92	1,711.60	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股锁定	72.46	68.06	24	1,739.04	1,633.44	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定	29.02	25.36	55	1,596.10	1,394.80	-

注：1、基金作为特定投资者认购的由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为特定投资者认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让；发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期；基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

3、基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

4、基金通过询价转让受让的科创板上市公司股东首次公开发行前已发行股份，在受让后 6 个月内不得转让。

5、本基金在持有上述受限证券期间，若获得送股配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

#### 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

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种，本基金的预期风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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利用数量化模型与定性分析相结合的方法，通过股票资产和债券资产等各类资产的灵活配置，在有效控制投资组合风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的收益。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、监事会、管理层和各专业委员会、监察稽核部等职能部门、各业务及业务管理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监察及风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金运作过程进行合规检查和风险控制评估等；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策略和控制措施等；监察稽核部负责指导各业务及业务管理部门开展风险管理工作，协调其他各部门开展运作风险管理，并进行投资风险分析与绩效评估。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，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主要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；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	1,218,738.08	34,423,719.45
合计	1,218,738.08	34,423,719.45

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。

3、债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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	-	9,927,040.98
合计	-	9,927,040.98

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一年的同业存单。

3、债券投资以全价列示。

#### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	10,358,540.98
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	10,358,540.98

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。

3、债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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于开放期内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于开放期内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。此外，本基金还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。

于2024年6月30日，除卖出回购金融资产款将在1个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 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。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，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%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，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。于本期末，本基金确认的净赎回申请未超过 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。

#### 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。

##### 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	1,284,802.00	-	-	-	1,284,802.00
结算备付金	995,201.30	-	-	-	995,201.30
存出保证金	57,795.60	-	-	-	57,795.60
交易性金融资产	1,218,738.08	-	-	6,072,930.53	7,291,668.61
买入返售金融资产	2,200,000.00	-	-	-	2,200,000.00
应收清算款	-	-	-	68,561.30	68,561.30
资产总计	5,756,536.98	-	-	6,141,491.83	11,898,028.81
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	5,885.23	5,885.23
应付托管费	-	-	-	1,471.32	1,471.32
应付清算款	-	-	-	99,477.87	99,477.87
应付销售服务费	-	-	-	3,815.34	3,815.34
其他负债	-	-	-	161,850.20	161,850.20
负债总计	-	-	-	272,499.96	272,499.96
利率敏感度缺口	5,756,536.98	-	-	5,868,991.87	11,625,528.85
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	2,088,665.41	-	-	-	2,088,665.41
结算备付金	158,843.85	-	-	-	158,843.85
存出保证金	38,405.40	-	-	-	38,405.40
交易性金融资产	54,709,301.41	-	-	98,439,144.10	153,148,445.51
买入返售金融资产	4,003,523.70	-	-	-	4,003,523.70
应收清算款	-	-	-	1,485,529.56	1,485,529.56
资产总计	60,998,739.77	-	-	99,924,673.66	160,923,413.43
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	81,057.22	81,057.22
应付托管费	-	-	-	20,264.27	20,264.27
应付销售服务费	-	-	-	2,200.00	2,200.00
应交税费	-	-	-	5,051.70	5,051.70
其他负债	-	-	-	345,694.88	345,694.88
负债总计	-	-	-	454,268.07	454,268.07
利率敏感度缺口	60,998,739.77	-	-	99,470,405.59	160,469,145.36

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	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	
相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	

	动	本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
分析	1、市场利率上升 25 个基点	-222.25	-39,649.61
	2、市场利率下降 25 个基点	222.55	39,715.35

#### 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。本基金主要投资于上市交易的证券，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，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	6,072,930.53	52.24	98,439,144.10	61.34
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	6,072,930.53	52.24	98,439,144.10	61.34
----	--------------	-------	---------------	-------

#### 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。		
	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）
分析	1. 本基金业绩比较基准上升 5%	623,802.09	8,518,991.08
	2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-623,802.09	-8,518,991.08

#### 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	5,935,760.20	97,588,821.67
第二层次	1,218,738.08	54,880,845.53
第三层次	137,170.33	678,778.31
合计	7,291,668.61	153,148,445.51

**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证券，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证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，确定相关证券的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**

于本期末，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	6,072,930.53	51.04
	其中：股票	6,072,930.53	51.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,218,738.08	10.24
	其中：债券	1,218,738.08	10.24
	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	2,200,000.00	18.49
	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	2,280,003.30	19.16
8	其他各项资产	126,356.90	1.06
9	合计	11,898,028.81	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	412,229.00	3.55
C	制造业	3,202,677.15	27.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	206,230.00	1.77
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	354,490.22	3.05
J	金融业	1,543,893.00	13.28
K	房地产业	228,984.00	1.97
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	3,527.16	0.03
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	120,900.00	1.04
S	综合	-	-
	合计	6,072,930.53	52.24

### 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	601988	中国银行	64,900	299,838.00	2.58
2	603296	华勤技术	4,900	270,627.00	2.33
3	601939	建设银行	34,900	258,260.00	2.22
4	601998	中信银行	37,900	253,930.00	2.18
5	002594	比亚迪	1,000	250,250.00	2.15
6	000725	京东方 A	50,000	204,500.00	1.76
7	688018	乐鑫科技	2,000	197,360.00	1.70
8	603228	景旺电子	6,000	190,800.00	1.64
9	601628	中国人寿	5,300	164,565.00	1.42
10	002371	北方华创	500	159,945.00	1.38
11	600584	长电科技	5,000	158,550.00	1.36
12	601899	紫金矿业	8,700	152,859.00	1.31
13	002139	拓邦股份	14,000	148,680.00	1.28

14	600519	贵州茅台	100	146,739.00	1.26
15	688568	中科星图	3,000	143,100.00	1.23
16	300638	广和通	8,000	136,800.00	1.18
17	601800	中国交建	14,900	133,206.00	1.15
18	600760	中航沈飞	3,300	132,330.00	1.14
19	601066	中信建投	6,800	130,832.00	1.13
20	601601	中国太保	4,500	125,370.00	1.08
21	000002	万科 A	18,000	124,740.00	1.07
22	002384	东山精密	6,000	124,200.00	1.07
23	601688	华泰证券	10,000	123,900.00	1.07
24	600132	重庆啤酒	2,000	121,400.00	1.04
25	002739	万达电影	10,000	120,900.00	1.04
26	601818	光大银行	37,200	117,924.00	1.01
27	300750	宁德时代	600	108,018.00	0.93
28	600048	保利发展	11,900	104,244.00	0.90
29	688717	艾罗能源	2,158	101,469.16	0.87
30	600256	广汇能源	14,900	99,830.00	0.86
31	600893	航发动力	2,300	84,065.00	0.72
32	600547	山东黄金	3,000	82,140.00	0.71
33	002947	恒铭达	2,300	80,960.00	0.70
34	600887	伊利股份	3,000	77,520.00	0.67
35	000333	美的集团	1,200	77,400.00	0.67
35	601857	中国石油	7,500	77,400.00	0.67
36	603806	福斯特	5,040	74,088.00	0.64
37	601390	中国中铁	11,200	73,024.00	0.63
38	600309	万华化学	900	72,774.00	0.63
39	601100	恒立液压	1,500	69,870.00	0.60
40	600030	中信证券	3,800	69,274.00	0.60
41	600176	中国巨石	6,000	66,300.00	0.57
42	600600	青岛啤酒	900	65,493.00	0.56
43	002415	海康威视	2,000	61,820.00	0.53
44	000063	中兴通讯	2,000	55,940.00	0.48
45	002475	立讯精密	1,300	51,103.00	0.44
46	300724	捷佳伟创	900	48,609.00	0.42
47	000999	华润三九	1,040	44,283.20	0.38
48	688691	灿芯股份	192	8,161.92	0.07
49	688695	中创股份	186	5,868.30	0.05
50	688709	成都华微	307	5,768.53	0.05
51	601033	永兴股份	221	3,527.16	0.03
52	603341	龙旗科技	91	3,411.59	0.03
53	603344	星德胜	94	2,130.04	0.02
54	603082	北自科技	71	2,093.79	0.02
55	603375	盛景微	44	1,711.60	0.01



56	603325	博隆技术	24	1,633.44	0.01
57	603312	西典新能	55	1,394.80	0.01

#### 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	601138	工业富联	2,279,943.00	1.42
2	601998	中信银行	1,871,957.00	1.17
3	600383	金地集团	1,462,500.00	0.91
4	601336	新华保险	1,305,998.00	0.81
5	601988	中国银行	1,124,500.00	0.70
6	688381	帝奥微	1,063,549.57	0.66
7	601390	中国中铁	1,009,500.00	0.63
8	600438	通威股份	998,379.00	0.62
9	601688	华泰证券	985,600.00	0.61
10	688018	乐鑫科技	970,475.20	0.60
11	600030	中信证券	969,500.00	0.60
12	688008	澜起科技	946,993.70	0.59
13	603501	韦尔股份	905,897.00	0.56
14	600600	青岛啤酒	892,080.00	0.56
15	600498	烽火通信	890,761.00	0.56
16	688568	中科星图	806,050.93	0.50
17	605111	新洁能	794,825.20	0.50
18	601818	光大银行	622,000.00	0.39
19	603806	福斯特	523,200.00	0.33
20	600536	中国软件	510,150.00	0.32

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	601818	光大银行	6,415,498.00	4.00
2	601939	建设银行	5,371,862.00	3.35
3	601138	工业富联	4,802,822.00	2.99
4	600519	贵州茅台	4,102,397.40	2.56
5	300750	宁德时代	3,091,842.00	1.93
6	601800	中国交建	2,933,377.00	1.83
7	600886	国投电力	2,365,685.00	1.47
8	601225	陕西煤业	2,300,444.00	1.43
9	601688	华泰证券	2,226,803.40	1.39
10	603198	迎驾贡酒	2,154,100.00	1.34

11	601628	中国人寿	2,121,548.00	1.32
12	601899	紫金矿业	2,032,912.00	1.27
13	601998	中信银行	1,889,089.00	1.18
14	601066	中信建投	1,854,568.00	1.16
15	000333	美的集团	1,815,118.00	1.13
16	000063	中兴通讯	1,814,196.00	1.13
17	600132	重庆啤酒	1,783,190.00	1.11
18	605111	新洁能	1,735,853.05	1.08
19	000001	平安银行	1,734,929.00	1.08
20	601857	中国石油	1,666,026.00	1.04

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	24,457,271.31
卖出股票收入（成交）总额	123,254,471.81

#### 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	1,218,738.08	10.48
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	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,218,738.08	10.48

#### 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	019709	23 国债 16	12,000	1,218,738.08	10.48

#### 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

中国银行（代码：601988）发行主体中国银行股份有限公司的如下违法违规事实于 2023 年 12 月 28 日受到国家金融监督管理总局合计 430 万元的处罚：（一）部分重要信息系统识别不全面，灾备建设和灾难恢复能力不符合监管要求；（二）重要信息系统投产及变更未向监管部门报告，且投产及变更长期不规范引发重要信息系统较大及以上突发事件；（三）信息系统运行风险识别不到位、处置不及时，引发重要信息系统重大突发事件等，共计 9 条违规行为。

建设银行（代码：601939）发行主体中国建设银行股份有限公司的如下违法违规事实于 2023 年 12 月 27 日受到国家金融监督管理总局罚款合计 170 万元的处罚：（一）并表管理内部审计存在不足；（二）母行对境外机构案件管理不到位；（三）未及时报告境外子行高级管理人员任职情况等，共计 4 条违规行为。

中信银行（代码：601998）发行主体中信银行股份有限公司的如下违法违规事实于 2023 年 12 月 29 日受到国家金融监督管理总局没收违法所得并处罚款合计 400 万元的处罚：（一）部分重要信息系统应认定未认定，相关系统未建灾备或灾难恢复能力不符合监管要求；（二）同城数据中心长期存在基础设施风险隐患未得到整改；（三）对外包数据中心的准入前尽职调查和日常管理不符合监管要求，部分数据中心存在风险隐患等，共计 6 条违规行为。于 2023 年 11 月 16 日受到国家金融监督管理总局没收违法所得并处罚款合计 15242.59 万元、没收违法所得 462.59 万元的处罚：（一）违反高管准入管理相关规定；（二）贷关联贷款管理不合规；（三）绩效考核不符合规定等，共计 56 条违规行为。

中国人寿（代码：601628）发行主体中国人寿保险股份有限公司的如下违法违规事实于 2023 年 8 月 23 日受到国家金融监督管理总局罚款合计 100 万元的处罚：（一）信息披露及资料、文件

等上报违规；（二）内部管理与控制制度不健全或执行监督不力，内控管理未形成有效风险控制，共计 2 条违规行为。

基金的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。

除中国银行（代码：601988）、建设银行（代码：601939）、中信银行（代码：601998）、中国人寿（代码：601628），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是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 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	57,795.60
2	应收清算款	68,561.30
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	126,356.90

### 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
红塔红土 盛利混合 A	60	5,439.59	0.00	0.00	326,375.24	100.00
红塔红土 盛利混合 C	136	93,466.14	10,860,128.35	85.44	1,851,266.69	14.56
合计	196	66,519.24	10,860,128.35	83.30	2,177,641.93	16.70

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	红塔红土盛利混合 A	4,623.45	1.4166
	红塔红土盛利混合 C	0.00	0.0000
	合计	4,623.45	0.0355

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	红塔红土盛利混合 A	0
	红塔红土盛利混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本 开放式基金	红塔红土盛利混合 A	0
	红塔红土盛利混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	红塔红土盛利混合 A	红塔红土盛利混合 C
----	------------	------------

基金合同生效日 (2021 年 8 月 2 日) 基金份额总额	220,072,193.21	213,144.23
本报告期期初基金份额总额	173,892,813.52	7,446,406.51
本报告期基金总申购份额	6,584.99	12,204,049.20
减:本报告期基金总赎回份额	173,573,023.27	6,939,060.67
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	326,375.24	12,711,395.04

## § 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

本报告期,基金管理人无重大人事变动。

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

本基金本报告期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

#### 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,本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 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,本基金托管人的托管业务部门及其相关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(%)	
国投证券	1	115,405,943.83	78.27	86,082.20	78.27	-
海通证券	1	32,035,908.07	21.73	23,895.56	21.73	-
红塔证券	2	-	-	-	-	-

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，由研究部和投资部门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(%)
国投证券	11,799,775.00	100.00	1,193,600,000.00	100.00	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-

## 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	红塔红土基金管理有限公司旗下基金产品风险等级划分结果（2023年下半年）	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月19日
2	红塔红土基金管理有限公司旗下基金2023年第4季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月22日
3	红塔红土盛利混合型证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月22日
4	红塔红土盛利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	2024年2月29日
5	红塔红土盛利混合型证券投资基金更新招募说明书（2024年1号）	中国证监会指定报刊及网站	2024年2月29日
6	红塔红土盛利混合型证券投资基金（红塔红土盛利混合A类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024年2月29日

7	红塔红土盛利混合型证券投资基金 (红塔红土盛利混合 C 类份额) 基金 产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及 网站	2024 年 2 月 29 日
8	红塔红土基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及 网站	2024 年 3 月 30 日
9	红塔红土盛利混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定报刊及 网站	2024 年 3 月 30 日
10	红塔红土基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及 网站	2024 年 4 月 22 日
11	红塔红土盛利混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及 网站	2024 年 4 月 22 日
12	红塔红土盛利混合型证券投资基金 (红塔红土盛利混合 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	2024 年 6 月 28 日
13	红塔红土盛利混合型证券投资基金 (红塔红土盛利混合 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	2024 年 6 月 28 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

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	2024-01-01 至 2024-05-19	109,999,900.00	0.00	109,999,900.00	0.00	0.00
	2	2024-01-01 至 2024-05-21	62,999,900.00	0.00	62,999,900.00	0.00	0.00
	3	2024-05-21 至 2024-06-30	0.00	6,508,875.74	0.00	6,508,875.74	49.92
	4	2024-05-22 至 2024-06-30	0.00	3,372,781.07	0.00	3,372,781.07	25.87

#### 产品特有风险

##### 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。

##### 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。

##### 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。

#### 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。

#### 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。

#### 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。

## 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、红塔红土盛利混合型证券投资基金基金合同；
- 3、红塔红土盛利混合型证券投资基金托管协议；
- 4、红塔红土盛利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

广东省深圳市前海深港合作区南山街道前湾一路 399 号前海嘉里商务中心四期 1 栋 2301

### 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

2024 年 8 月 29 日