

红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资
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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	7
§ 4 管理人报告	8
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	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§ 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	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	34
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	40
7.12	投资组合报告附注	41
§ 8	基金份额持有人信息	41
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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
§ 9	开放式基金份额变动	42
§ 10	重大事件揭示	42
10.1	基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4	基金投资策略的改变	42
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
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	45
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	46
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	47
§ 12	备查文件目录	47
12.1	备查文件目录	47
12.2	存放地点	47
12.3	查阅方式	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	红土创新新兴产业混合
基金主代码	001753
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 9 月 23 日
基金管理人	红土创新基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	153,424,882.97 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过灵活的资产配置和对新兴产业的投资管理，拓展大类资产配置空间，在精选处于新兴产业中个股的基础上适度集中投资，在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期增值。
投资策略	本基金的资产配置主要是基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。在股票投资策略方面，本基金将从新兴产业中优选预期成长性较好的公司的股票进行投资。本基金所指的预期成长性较好的公司是指公司所在行业景气度较高且具有可持续性、公司所在行业竞争格局良好以及公司管理层素质较高等标准的公司。在债券投资策略方面，本基金主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。同时，本基金将根据对现货和期货市场的分析，采取多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60% + 中证全债指数收益率×40%
风险收益特征	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。

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	中国建设银行股份有限公司
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	021-60637228
传真	0755-33011855	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市南山区海德三道 1066 号深创投广场 48 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518048	100033

法定代表人	阮菲	张金良
-------	----	-----

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)
本期已实现收益	-12,308,257.24
本期利润	-3,982,658.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0255
本期加权平均净值利润率	-2.62%
本期基金份额净值增长率	-2.26%
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	-17,651,810.92
期末可供分配基金份额利润	-0.1151
期末基金资产净值	152,412,451.80
期末基金份额净值	0.993
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	-0.70%

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。

4. 本基金合同生效日为 2015 年 09 月 23 日。

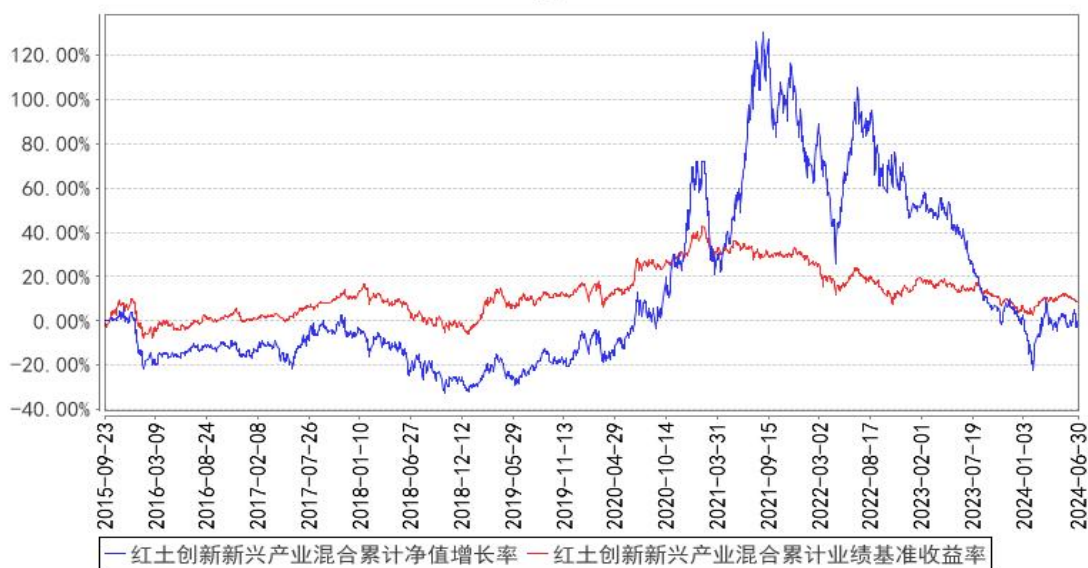
3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.27%	1.71%	-1.69%	0.29%	3.96%	1.42%
过去三个月	0.20%	1.49%	-0.78%	0.44%	0.98%	1.05%
过去六个月	-2.26%	2.04%	1.77%	0.53%	-4.03%	1.51%
过去一年	-26.99%	1.58%	-4.58%	0.52%	-22.41%	1.06%
过去三年	-43.58%	2.00%	-19.14%	0.62%	-24.44%	1.38%
自基金合同生效起至今	-0.70%	1.76%	8.72%	0.72%	-9.42%	1.04%

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

红土创新新兴产业混合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：基金合同生效日至本报告期末已满一年。本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月内，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

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		
廖星昊	本基金的基金经理	2022年12月16日	-	14年	武汉大学生物学学士，上海财经大学金融数学与金融工程硕士。先后任职于招商证券研究发展中心、太平基金、金信基金、华润元大基金，从事投资研究工作。现任本公司红土创新医疗保健股票基金、红土创新新兴产业灵活配置混合型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、《红土创新新兴产业灵活配置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。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

目前时点来看，随着硅料产能释放，预计硅料价格中枢未来一年将逐步下行，这将持续刺激全球加快装机；国、内外大储在新能源装机消纳需求的倒逼下也将加快启动。近年来国际形势错综复杂，同时新一代国防装备建设进入加速期，军工指数估值已消化至相对低位。伴随着美国对我国科技的制裁加深，国产替代更为重要，未来像信创、半导体的政策扶持力度将进一步提速，再叠加消费电子、汽车的销量数据有望见底回升，产业景气度回升可期。2022 年 4 季度以来，医药领域的集采政策边际趋缓，国内创新药企业已有出海的实力。

本基金将按照基金合同的约定，不断在新兴产业中寻找投资机会，增加配置景气度向上的细分行业中的优质公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.993 元；本报告期基金份额净值增长率为-2.26%，业绩比较基准收益率为 1.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在目前时点，展望 2024 年下半年：

(1) 对指数，我们始终认为 A 股有其内在的自身运行逻辑，无需过分担忧外围市场的走势影响 A 股。无论从国内宏观经济周期，还是从政策周期来看，相信 2024 年的 A 股表现大概率会好于 2023 年。从库存周期来看，中、美两国均有望在下半年迎来补库存的周期，经济复苏的内在动能

增强。短期看，国内出台一系列经济托底政策的可能性在加大。综上，我们认为 2024 年下半年指数的表现会优于上半年；

(2) 对经济，中、美经济在 2024 年将出现错配：中国经济复苏向上，而美国经济相对走弱。与市场观点不同之处在于，我们并不认为美国经济会出现明显的衰退，中国的出口增速可能会好于预期；

(3) 对汇率，中国经济向好是人民币走强的基础。党的二十届三中全会召开后，政策不断优化，经济刺激政策陆续出台，市场信心明显增强；

(4) 对新兴产业，依然重点看好具有全球领先优势的新能源板块，国产替代背景下逐步崛起的信创、半导体等科技产业，新一代国防装备建设进入加速期后的军工行业，逐步具备出海实力的中国创新药企业，以及国家政策大力支持且业绩不断兑现的中药板块等。

总之，我们对 2024 年的市场行情整体保持乐观的态度，影响逐步消退，中国经济回到正常轨道。成长性板块预计今年业绩仍有望维持较高增长，但估值收缩不可避免。

展望全年，预计市场风格将在高估值的成长性板块与低估值的高股息板块之间反复切换。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：红土创新新兴产业灵活配置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	13,300,837.11	8,852,229.17
结算备付金		1,365,621.85	1,753,043.58
存出保证金		116,444.20	301,450.67
交易性金融资产	6.4.7.2	142,917,694.01	151,689,667.09
其中：股票投资		142,917,694.01	151,689,667.09
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		-	952,146.96
应收股利		-	-
应收申购款		82,357.73	27,698.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		157,782,954.90	163,576,236.01
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		4,198,159.43	966,156.97
应付赎回款		156,019.10	183,718.18
应付管理人报酬		152,168.07	207,589.68
应付托管费		25,361.34	34,598.26
应付销售服务费		-	-
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	838,795.16	1,066,907.75
负债合计		5,370,503.10	2,458,970.84
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	153,424,882.97	158,558,586.79
未分配利润	6.4.7.12	-1,012,431.17	2,558,678.38
净资产合计		152,412,451.80	161,117,265.17
负债和净资产总计		157,782,954.90	163,576,236.01

注：本基金合同生效日为 2015 年 09 月 23 日，本报告期自基金合同生效日 2015 年 09 月 23 日起至 2024 年 06 月 30 日止。报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.993 元，基金份额总额 153,424,882.97 份。

6.2 利润表

会计主体：红土创新新兴产业灵活配置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		-2,836,708.88	-23,949,943.97
1. 利息收入		28,149.64	71,230.51
其中：存款利息收入	6.4.7.13	28,149.64	71,230.51
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-11,211,311.45	-28,156,268.33
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-12,081,925.43	-30,833,141.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	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	870,613.98	2,676,872.76
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	8,325,599.21	4,056,273.59
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	20,853.72	78,820.26
减：二、营业总支出		1,145,949.15	2,470,359.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	905,277.68	2,040,710.78
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	150,879.64	340,118.51
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	89,791.83	89,530.15

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,982,658.03	-26,420,303.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,982,658.03	-26,420,303.41
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,982,658.03	-26,420,303.41

6.3 净资产变动表

会计主体：红土创新新兴产业灵活配置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	158,558,586.79	-	2,558,678.38	161,117,265.17
二、本期期初净资产	158,558,586.79	-	2,558,678.38	161,117,265.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,133,703.82	-	-3,571,109.55	-8,704,813.37
（一）、综合收益总额	-	-	-3,982,658.03	-3,982,658.03
（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）	-5,133,703.82	-	411,548.48	-4,722,155.34
其中：1. 基金申购款	6,459,281.23	-	-84,115.81	6,375,165.42
2. 基金赎回款	-11,592,985.05	-	495,664.29	-11,097,320.76
（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	153,424,882.97	-	-1,012,431.17	152,412,451.80
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	176,441,648.68	-	88,043,616.74	264,485,265.42
二、本期期初净资产	176,441,648.68	-	88,043,616.74	264,485,265.42
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	9,253,411.49	-	-21,262,270.98	-12,008,859.49
(一)、综合收益总额	-	-	-26,420,303.41	-26,420,303.41
(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)	9,253,411.49	-	5,158,032.43	14,411,443.92
其中：1. 基金申购款	33,702,092.54	-	17,111,752.51	50,813,845.05
2. 基金赎回款	-24,448,681.05	-	-11,953,720.08	-36,402,401.13
(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	185,695,060.17	-	66,781,345.76	252,476,405.93

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

红土创新新兴产业灵活配置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[2015]1625号《关于准予红土创新新兴产业灵活配置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《红土创新新兴产业灵活配置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 244,770,309.73 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(2015)第 1099 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 9 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 244,976,374.41 份基金份额，其中认购资金利息折合 206,064.68 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新新兴产业灵活配置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(包括中小板、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、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购等)、货币市场工具、银行存款、权证、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 0%-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，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证、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的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

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<年度报告和半年度报告>》、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》、《红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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。

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

本报告期采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

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[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：

(a) 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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b) 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。

(c) 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。

(d) 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。

(e) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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	13,300,837.11
等于：本金	13,299,820.96
加：应计利息	1,016.15
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	13,300,837.11

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	128,602,188.61	-	142,917,694.01	14,315,505.40
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	128,602,188.61	-	142,917,694.01	14,315,505.40

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。

6.4.7.5 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	134.05
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	749,153.51
其中：交易所市场	749,153.51
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,507.60
合计	838,795.16

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	158,558,586.79	158,558,586.79
本期申购	6,459,281.23	6,459,281.23
本期赎回（以“-”号填列）	-11,592,985.05	-11,592,985.05
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	153,424,882.97	153,424,882.97

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

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,782,648.62	8,341,327.00	2,558,678.38
本期期初	-5,782,648.62	8,341,327.00	2,558,678.38
本期利润	-12,308,257.24	8,325,599.21	-3,982,658.03
本期基金份额交易产生的变动数	439,094.94	-27,546.46	411,548.48
其中：基金申购款	-726,275.30	642,159.49	-84,115.81
基金赎回款	1,165,370.24	-669,705.95	495,664.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-17,651,810.92	16,639,379.75	-1,012,431.17

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	18,363.20
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	8,328.49
其他	1,457.95
合计	28,149.64

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	-12,081,925.43
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	-12,081,925.43

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	789,318,992.09
减：卖出股票成本总额	799,747,575.33
减：交易费用	1,653,342.19
买卖股票差价收入	-12,081,925.43

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

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	870,613.98
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	870,613.98

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	8,325,599.21
股票投资	8,325,599.21
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	8,325,599.21

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	20,837.38
基金转换费收入	16.34
合计	20,853.72

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	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	240.00
存托服务费	44.23
合计	89,791.83

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**

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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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	905,277.68	2,040,710.78
其中：应支付销售机构的客户维护费	228,623.44	526,208.20
应支付基金管理人的净管理费	676,654.24	1,514,502.58

注：支付基金管理人红土创新基金管理有限公司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	150,879.64	340,118.51

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

份额单位：份

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
基金合同生效日（2015年9月23日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	9,857,845.37	6,493,107.82
报告期间申购/买入总份额	0.00	3,364,737.55
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	9,857,845.37	9,857,845.37
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	6.4300%	5.3100%

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
深创投	50,060,750.00	32.6300	50,060,750.00	31.5700

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
建设银行	13,300,837.11	18,363.20	13,486,837.44	44,183.59

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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行中国建设银行，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。

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，对本基金组合持仓集中度指标、流通受限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、结算备付金及存出保证金等。

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	13,300,837.11	-	-	-	13,300,837.11
结算备付金	1,365,621.85	-	-	-	1,365,621.85

存出保证金	116,444.20	-	-	-	116,444.20
交易性金融资产	-	-	-	-142,917,694.01	142,917,694.01
应收申购款	-	-	-	82,357.73	82,357.73
资产总计	14,782,903.16	-	-	-143,000,051.74	157,782,954.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	156,019.10	156,019.10
应付管理人报酬	-	-	-	152,168.07	152,168.07
应付托管费	-	-	-	25,361.34	25,361.34
应付清算款	-	-	-	4,198,159.43	4,198,159.43
其他负债	-	-	-	838,795.16	838,795.16
负债总计	-	-	-	5,370,503.10	5,370,503.10
利率敏感度缺口	14,782,903.16	-	-	-137,629,548.64	152,412,451.80
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	8,852,229.17	-	-	-	8,852,229.17
结算备付金	1,753,043.58	-	-	-	1,753,043.58
存出保证金	301,450.67	-	-	-	301,450.67
交易性金融资产	-	-	-	-151,689,667.09	151,689,667.09
应收申购款	-	-	-	27,698.54	27,698.54
应收清算款	-	-	-	952,146.96	952,146.96
资产总计	10,906,723.42	-	-	-152,669,512.59	163,576,236.01
负债					
应付赎回款	-	-	-	183,718.18	183,718.18
应付管理人报酬	-	-	-	207,589.68	207,589.68
应付托管费	-	-	-	34,598.26	34,598.26
应付清算款	-	-	-	966,156.97	966,156.97
其他负债	-	-	-	1,066,907.75	1,066,907.75
负债总计	-	-	-	2,458,970.84	2,458,970.84
利率敏感度缺口	10,906,723.42	-	-	-150,210,541.75	161,117,265.17

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

注：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	142,917,694.01	93.77	151,689,667.09	94.15
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	142,917,694.01	93.77	151,689,667.09	94.15

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	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）
	1. 沪深 300 指数上升 5%		11,445,856.40
2. 沪深 300 指数下降 5%		-11,445,856.40	-2,377,848.63

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	142,917,694.01	151,689,667.09
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	142,917,694.01	151,689,667.09

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

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

无。

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	142,917,694.01	90.58
	其中：股票	142,917,694.01	90.58
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	14,666,458.96	9.30
8	其他各项资产	198,801.93	0.13
9	合计	157,782,954.90	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	129,472,185.46	84.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	13,445,508.55	8.82
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	142,917,694.01	93.77

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	300308	中际旭创	97,020	13,377,117.60	8.78
2	300394	天孚通信	134,720	11,911,942.40	7.82
3	601138	工业富联	399,500	10,946,300.00	7.18
4	300502	新易盛	97,400	10,280,570.00	6.75
5	300476	胜宏科技	246,700	7,958,542.00	5.22
6	002594	比亚迪	31,000	7,757,750.00	5.09
7	688183	生益电子	396,597	7,686,049.86	5.04
8	002463	沪电股份	208,500	7,610,250.00	4.99
9	688256	寒武纪	36,515	7,254,435.05	4.76
10	600150	中国船舶	167,400	6,814,854.00	4.47
11	603228	景旺电子	199,921	6,357,487.80	4.17
12	688691	N 灿芯	115,721	6,191,073.50	4.06
13	600487	亨通光电	368,800	5,815,976.00	3.82
14	300529	健帆生物	202,000	5,496,420.00	3.61
15	001309	德明利	54,034	4,668,537.60	3.06
16	300857	协创数据	80,100	4,565,700.00	3.00
17	002409	雅克科技	60,400	3,799,764.00	2.49
18	000528	柳工	332,700	3,722,913.00	2.44
19	300677	英科医疗	114,620	3,072,962.20	2.02
20	002938	鹏鼎控股	77,000	3,061,520.00	2.01
21	601989	中国重工	618,800	3,050,684.00	2.00
22	600522	中天科技	95,700	1,516,845.00	1.00

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（%）
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	300394	天孚通信	19,786,613.60	12.28
2	300308	中际旭创	18,816,284.80	11.68
3	603439	贵州三力	17,095,293.00	10.61
4	300002	神州泰岳	16,753,225.00	10.40
5	300017	网宿科技	16,648,549.00	10.33
6	600487	亨通光电	16,613,593.00	10.31
7	601989	中国重工	16,278,469.00	10.10
8	600150	中国船舶	15,371,331.00	9.54
9	600129	太极集团	14,943,114.00	9.27
10	300857	协创数据	13,500,026.00	8.38
11	002463	沪电股份	12,938,624.80	8.03
12	601138	工业富联	12,127,679.00	7.53
13	603191	望变电气	11,654,745.00	7.23
14	300529	健帆生物	11,630,324.28	7.22
15	000977	浪潮信息	10,634,042.00	6.60
16	300628	亿联网络	10,611,510.00	6.59
17	601127	赛力斯	10,213,593.00	6.34
18	601899	紫金矿业	9,980,602.00	6.19
19	601975	招商南油	9,733,111.00	6.04
20	300476	胜宏科技	9,716,586.00	6.03
21	300502	新易盛	9,249,808.10	5.74
22	603283	赛腾股份	9,062,509.80	5.62
23	300677	英科医疗	8,345,034.20	5.18
24	688691	N 灿芯	8,063,509.38	5.00
25	300570	太辰光	7,947,645.00	4.93
26	688177	百奥泰	7,599,664.54	4.72
27	605117	德业股份	7,477,191.00	4.64
28	600572	康恩贝	7,436,163.50	4.62
29	603486	科沃斯	7,424,394.00	4.61
30	002594	比亚迪	7,184,094.00	4.46
31	301589	N 诺瓦	7,116,219.71	4.42
32	600422	昆药集团	6,853,290.00	4.25
33	603998	方盛制药	6,822,350.00	4.23
34	688256	寒武纪	6,793,805.44	4.22
35	603707	健友股份	6,759,270.00	4.20
36	002675	东诚药业	6,751,800.00	4.19
37	605123	派克新材	6,415,879.00	3.98
38	600183	生益科技	6,366,951.00	3.95
39	688183	生益电子	6,324,769.32	3.93
40	688027	国盾量子	6,300,356.59	3.91
41	600976	健民集团	6,246,499.00	3.88
42	300049	福瑞股份	6,239,262.00	3.87

43	603993	洛阳钼业	6,126,600.00	3.80
44	600246	万通发展	6,117,966.00	3.80
45	000975	银泰黄金	6,077,585.00	3.77
46	002317	众生药业	6,065,044.00	3.76
47	603228	景旺电子	6,008,139.56	3.73
48	002737	葵花药业	5,977,317.00	3.71
49	301015	百洋医药	5,970,858.00	3.71
50	000589	贵州轮胎	5,921,266.83	3.68
51	002916	深南电路	5,825,929.00	3.62
52	689009	九号公司	5,815,327.37	3.61
53	301188	力诺特玻	5,814,488.00	3.61
54	601689	拓普集团	5,793,832.00	3.60
55	600535	天士力	5,764,589.00	3.58
56	688677	海泰新光	5,675,993.33	3.52
57	301391	卡莱特	5,645,172.00	3.50
58	000048	京基智农	5,633,651.00	3.50
59	002275	桂林三金	5,396,986.72	3.35
60	603588	高能环境	5,338,150.00	3.31
61	600685	中船防务	5,285,063.00	3.28
62	002281	光迅科技	5,266,922.00	3.27
63	600418	江淮汽车	5,157,740.00	3.20
64	603666	亿嘉和	4,993,632.00	3.10
65	000949	新乡化纤	4,919,667.00	3.05
66	001309	德明利	4,806,849.40	2.98
67	000657	中钨高新	4,783,034.00	2.97
68	000516	国际医学	4,758,354.00	2.95
69	300573	兴齐眼药	4,756,003.00	2.95
70	600389	江山股份	4,744,489.00	2.94
71	300003	乐普医疗	4,718,544.00	2.93
72	002601	龙佰集团	4,653,236.00	2.89
73	000425	徐工机械	4,636,596.00	2.88
74	002019	亿帆医药	4,614,610.00	2.86
75	600993	马应龙	4,588,078.00	2.85
76	002096	易普力	4,582,383.04	2.84
77	688276	百克生物	4,516,118.83	2.80
78	688687	凯因科技	4,492,168.89	2.79
79	000762	西藏矿业	4,420,329.00	2.74
80	688025	杰普特	4,409,825.31	2.74
81	688136	科兴制药	4,402,455.04	2.73
82	300181	佐力药业	4,280,626.50	2.66
83	688169	石头科技	3,968,834.66	2.46
84	300492	华图山鼎	3,936,286.00	2.44
85	002409	雅克科技	3,883,146.00	2.41

86	688351	微电生理	3,857,597.63	2.39
87	300750	宁德时代	3,849,355.00	2.39
88	600062	华润双鹤	3,840,578.20	2.38
89	000528	柳工	3,837,061.00	2.38
90	000028	国药一致	3,824,564.60	2.37
91	688166	博瑞医药	3,821,524.11	2.37
92	002851	麦格米特	3,817,562.00	2.37
93	600285	羚锐制药	3,774,056.00	2.34
94	002465	海格通信	3,684,096.00	2.29
95	300401	花园生物	3,683,263.00	2.29
96	300337	银邦股份	3,631,156.00	2.25
97	300751	迈为股份	3,546,298.00	2.20
98	002241	歌尔股份	3,428,339.00	2.13
99	600416	湘电股份	3,245,040.00	2.01

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	600129	太极集团	20,491,468.30	12.72
2	300017	网宿科技	17,997,040.00	11.17
3	600150	中国船舶	17,454,137.00	10.83
4	603439	贵州三力	16,111,768.00	10.00
5	300002	神州泰岳	16,001,075.00	9.93
6	600422	昆药集团	13,834,472.00	8.59
7	600535	天士力	12,928,742.00	8.02
8	601989	中国重工	12,799,903.00	7.94
9	300308	中际旭创	12,318,564.00	7.65
10	301015	百洋医药	11,603,669.00	7.20
11	603707	健友股份	11,511,134.00	7.14
12	603191	望变电气	11,365,124.00	7.05
13	600685	中船防务	11,160,217.00	6.93
14	300181	佐力药业	11,068,601.00	6.87
15	600487	亨通光电	11,019,486.00	6.84
16	300628	亿联网络	10,837,741.00	6.73
17	603998	方盛制药	10,356,415.00	6.43
18	000977	浪潮信息	9,952,706.76	6.18
19	300394	天孚通信	9,785,286.14	6.07
20	601899	紫金矿业	9,506,213.00	5.90
21	601975	招商南油	9,328,571.00	5.79
22	601127	赛力斯	9,212,104.00	5.72

23	300857	协创数据	9,056,921.00	5.62
24	600557	康缘药业	8,546,045.00	5.30
25	300049	福瑞股份	8,336,277.00	5.17
26	603283	赛腾股份	8,091,678.00	5.02
27	603712	七一二	8,002,867.00	4.97
28	300570	太辰光	7,977,947.00	4.95
29	600572	康恩贝	7,542,028.85	4.68
30	688177	百奥泰	7,451,998.07	4.63
31	688378	奥来德	7,253,605.41	4.50
32	603486	科沃斯	7,209,384.00	4.47
33	300529	健帆生物	7,061,267.00	4.38
34	301589	N 诺瓦	6,878,379.00	4.27
35	605117	德业股份	6,837,002.00	4.24
36	000589	贵州轮胎	6,790,700.00	4.21
37	002465	海格通信	6,750,709.00	4.19
38	600246	万通发展	6,574,628.72	4.08
39	601689	拓普集团	6,473,523.00	4.02
40	002675	东诚药业	6,423,578.00	3.99
41	600183	生益科技	6,322,866.00	3.92
42	002463	沪电股份	6,312,546.00	3.92
43	600764	中国海防	6,214,244.00	3.86
44	603993	洛阳钼业	6,137,542.00	3.81
45	002317	众生药业	6,076,669.00	3.77
46	600976	健民集团	6,040,642.00	3.75
47	688027	国盾量子	5,988,947.81	3.72
48	000975	银泰黄金	5,893,918.00	3.66
49	301188	力诺特玻	5,789,141.00	3.59
50	002737	葵花药业	5,770,886.00	3.58
51	002916	深南电路	5,767,258.00	3.58
52	605123	派克新材	5,558,867.00	3.45
53	688677	海泰新光	5,526,618.07	3.43
54	603588	高能环境	5,521,440.00	3.43
55	600399	抚顺特钢	5,438,211.00	3.38
56	688266	泽璟制药	5,355,971.59	3.32
57	603658	安图生物	5,324,883.29	3.30
58	689009	九号公司	5,308,620.25	3.29
59	600416	湘电股份	5,294,542.17	3.29
60	300677	英科医疗	5,289,170.00	3.28
61	601138	工业富联	5,265,879.66	3.27
62	002601	龙佰集团	5,172,891.00	3.21
63	600418	江淮汽车	5,097,193.00	3.16
64	000048	京基智农	5,060,184.00	3.14
65	600993	马应龙	5,034,379.00	3.12

66	002096	易普力	5,025,827.55	3.12
67	688626	翔宇医疗	4,999,387.77	3.10
68	600114	东睦股份	4,950,949.60	3.07
69	301391	卡莱特	4,945,064.00	3.07
70	002275	桂林三金	4,944,336.68	3.07
71	002387	维信诺	4,869,559.00	3.02
72	002281	光迅科技	4,848,206.00	3.01
73	600389	江山股份	4,756,514.20	2.95
74	603666	亿嘉和	4,675,190.00	2.90
75	300573	兴齐眼药	4,573,091.80	2.84
76	002019	亿帆医药	4,568,533.00	2.84
77	000516	国际医学	4,559,232.00	2.83
78	300492	华图山鼎	4,475,687.00	2.78
79	000949	新乡化纤	4,457,756.00	2.77
80	000425	徐工机械	4,378,587.00	2.72
81	300502	新易盛	4,360,721.00	2.71
82	300003	乐普医疗	4,339,286.00	2.69
83	300775	三角防务	4,319,775.00	2.68
84	000657	中钨高新	4,276,341.00	2.65
85	688276	百克生物	4,267,082.98	2.65
86	688136	科兴制药	4,219,588.05	2.62
87	000028	国药一致	4,163,430.60	2.58
88	688687	凯因科技	4,125,176.88	2.56
89	000762	西藏矿业	4,088,673.00	2.54
90	600062	华润双鹤	4,001,265.60	2.48
91	600201	生物股份	3,990,441.00	2.48
92	688025	杰普特	3,986,595.88	2.47
93	600285	羚锐制药	3,941,589.00	2.45
94	300337	银邦股份	3,843,364.00	2.39
95	688351	微电生理	3,812,869.72	2.37
96	688166	博瑞医药	3,807,614.30	2.36
97	688169	石头科技	3,746,483.41	2.33
98	002851	麦格米特	3,658,694.00	2.27
99	002150	通润装备	3,541,142.17	2.20
100	300136	信维通信	3,525,953.00	2.19
101	300750	宁德时代	3,483,570.00	2.16
102	002241	歌尔股份	3,438,695.00	2.13
103	688076	诺泰生物	3,432,310.75	2.13
104	688260	昀冢科技	3,412,369.79	2.12
105	300751	迈为股份	3,408,448.00	2.12
106	300401	花园生物	3,332,158.00	2.07
107	300482	万孚生物	3,284,288.00	2.04

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	782,650,003.04
卖出股票收入（成交）总额	789,318,992.09

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

本基金在进行股指期货投资时将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险，如预期大额申购赎回、大量分红等。

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没有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	116,444.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	82,357.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	198,801.93

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。

§ 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

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 (%)
10,902	14,073.10	60,258,739.91	39.28	93,166,143.06	60.72

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	888,189.69	0.5800
------------------	------------	--------

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	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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 9 月 23 日） 基金份额总额	244,976,374.41
本报告期期初基金份额总额	158,558,586.79
本报告期基金总申购份额	6,459,281.23
减：本报告期基金总赎回份额	11,592,985.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	153,424,882.97

§ 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 (%)	
东吴证券	2	675,359,736.57	42.96	496,999.39	42.92	-
兴业证券	2	562,762,106.47	35.80	414,240.99	35.77	-
西部证券	1	124,522,237.51	7.92	91,635.43	7.91	-
申万宏源	2	109,081,981.68	6.94	81,363.99	7.03	-
中邮证券	2	100,242,932.90	6.38	73,766.12	6.37	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	6	-	-	-	-	-

注：1、为节约交易单元资源，我公司在交易所交易系统升级的基础上，对同一银行托管基金进行了席位整合。

2、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- a、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- b、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- c、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- d、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B: 选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比,并根据评比的结果选择交易单元:

- a、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座;
- b、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实,投资建议是否准确;
- c、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

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(%)
东吴证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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
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	红土创新新兴产业灵活配置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

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	20240101-20240630	50,060,750.00	0.00	0.00	50,060,750.00	32.6300
产品特有风险							
<p>1. 巨额赎回风险</p> <p>(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>(3) 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，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。</p> <p>2. 转换运作方式或终止基金合同的风险：</p> <p>单一投资者巨额赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；</p> <p>3. 流动性风险</p> <p>单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短期内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险。</p>							

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新兴产业灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- (2) 《红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《红土创新新兴产业灵活配置混合型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) 报告期内红土创新新兴产业灵活配置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