

红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置 混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 30 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 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	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
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	8
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	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
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 所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	14
§ 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	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41

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	41
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	41
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	41
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	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末上市基金前十名持有人	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.4 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	43
§ 9 开放式基金份额变动	43
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
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	48
§ 12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
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 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	科创红土
场内简称	科创红土
基金主代码	501201
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 7 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	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	235,445,468.54 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 3 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要投资于通过战略配售取得的股票。本基金投资策略主要包括战略配售投资策略、股票投资策略和固定收益投资策略。
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分指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%
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。本基金以投资战略配售股票为主要投资策略，需参与并接受发行人战略配售股票，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张洗尘
	联系电话	0755-33011878
	电子邮箱	zhangxc@htcxfund.com
客户服务电话	0755-33011866	95588
传真	0755-33011855	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	阮菲	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	红土创新基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	65,322,372.33
本期利润	58,429,147.84
加权平均基金份额本期利润	0.2482
本期加权平均净值利润率	17.28%
本期基金份额净值增长率	16.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	121,985,798.19
期末可供分配基金份额利润	0.5181
期末基金资产净值	406,030,158.76
期末基金份额净值	1.7245
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	72.45%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

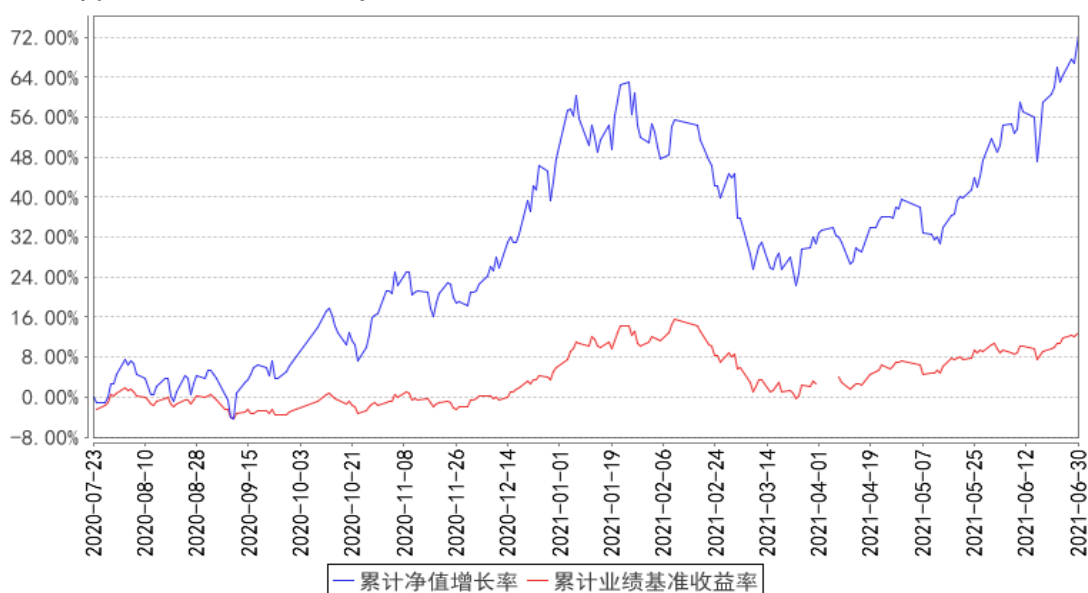
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	13.58%	2.33%	2.28%	0.70%	11.30%	1.63%
过去三个月	31.91%	1.82%	9.88%	0.77%	22.03%	1.05%
过去六个月	16.80%	2.23%	6.57%	1.03%	10.23%	1.20%
自基金合同生效起至今	72.45%	2.14%	12.88%	0.91%	59.57%	1.23%

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

科创红土 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，注册资本金为 4 亿元人民币，是国内首家创投系公募基金管理公司。公司股东为深圳市创新投资集团有限公司，持有股权 100%。

红土创新基金在公募基金业务的优良传承基础上，借力股东对创业投资行业的深入理解，外加国内独创的博士后工作站研究支持，充分利用一级市场优势向二级市场延伸，将红土创新基金打造成为以权益类投资为特色的创新型资产管理机构。截至 2021 年 6 月 30 日，红土创新基金共管理 14 只公募基金，资产管理规模 86.58 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		
朱然	本基金的基金经理	2018 年 9 月 14 日	2021 年 08 月 03 日	7 年	北京大学硕士，曾在英特尔，甲骨文等高科技公司任职；历任广发证券(香港)海外市场分析师；本公司 TMT 行业高级研究员；曾任红土创新转型精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、红土创新新科技股票型发起式证券投资基金、红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
盖俊龙	本基金的基金经理	2021 年 08 月 03 日	-	15 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。现任本公司研究部总监，红土创新转型精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、红土创新医疗保健股票型发起式证券投资基金、红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1 季度 A 股市场面临强劲的经济基本面和流动性边际收紧的担忧，以及核心资产和非核心资产估值差距大等两大矛盾，整体市场波动较大。新能源，半导体元器件，军工等科技成长板块，经历前期的大幅上涨后回调较多。从产业趋势研判和中长期空间的角度，我们依然看好以上板块内具备长期成长动力且短期基本面稳健的个股，相信随着业绩的高成长和时间的消化，以半年维度来看股价依然有不错的表现。同时，针对各个板块的估值状态和景气度趋势，我们对持仓结构做了一定的调整，减仓了部分高估值和周期性过强的品种，增持了一些估值和中期成长性更加匹配的个股。

2 季度随着市场对流动性收缩和通胀的担忧消除，A 股市场风险偏好逐步回升；成长板块在强劲的基本面驱动下，大幅反弹。我们管理的产品虽然在 1 季度有较为明显的回调，但基于对产业发展趋势的深入研究和对基本面的密切跟踪，2 季度很好的把握住了电动车，光伏，半导体等板块的投资机会，取得了不错的超额收益。

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 1.7245 元；本报告期基金份额净值增长率为 16.80%，业绩比较基准收益率为 6.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年的经济形势，疫情脉冲式冲击或拖累经济复苏。全球经济总体延续复苏趋势，但在疫情反复和各国疫苗供应能力不同的情况下，世界经济复苏分化可能加剧，对经济恢复形成拖累。国内方面，在国内经济复苏尚不稳固的背景下，货币政策将保持稳定，制造业增强自主性，发展双循环新经济格局。

目前 A 股市场面临的形势是，随着过去 2、3 年 A 股绝大部分优质公司都已经历大幅上涨，例如医药医疗、白酒、半导体、光伏、新能源汽车等，加上去年下半年以来的工业品（大宗商品）大幅上涨，所以下半年这些前期较为景气的行业，无论是成长、消费、还是周期都可能面临大幅波动。我们将更加谨慎的采取自下而上与自上而下相结合的方式精选投资标的，把握结构性投资机会，防范组合净值大幅回撤。

7月30日，中共中央政治局召开会议，分析研究当前经济形势和经济工作，为下半年经济发展把脉定调。会议指出，要强化科技创新和产业链供应链韧性，加强基础研究，推动应用研究，开展补链强链专项行动，加快解决“卡脖子”难题，发展“专精特新”中小企业。未来一段时期，我们工作的重点将在这些“专精特新”的公司中，结合细分行业的景气度，不断挖掘未来潜在的优质资产。

此外，我们也将从中长期的角度，在新兴产业中，结合公司历史经营和财务情况、行业发展趋势和公司竞争力，精选优质公司，例如5G建设及应用、新能源（汽车和光伏）产业链、TMT等行业。

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，本基金托管人在对红土创新科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，红土创新科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的管理人——红土创新基金管理有限公司在红土创新科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的投资

运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金 2021 年 1 月 20 日持有的配售转债星源转 2 债项评级为 AA，经本托管人以函件形式提示后，红土创新基金管理有限公司对红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的投资组合进行了调整。

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

本托管人依法对红土创新基金管理有限公司编制和披露的红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,013,065.20	4,851,344.97
结算备付金		2,964,875.82	1,550,070.09
存出保证金		275,693.79	161,489.11
交易性金融资产	6.4.7.2	405,675,538.68	345,713,518.02
其中：股票投资		405,675,538.68	345,713,518.02
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	47,862.54
应收利息	6.4.7.5	1,852.94	1,558.57
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		413,931,026.43	352,325,843.30
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		4,736,637.88	3,298,235.78
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		457,231.84	393,645.11
应付托管费		76,205.33	65,607.54
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,541,532.47	867,343.95
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,260.15	100,000.00
负债合计		7,900,867.67	4,724,832.38
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	235,445,468.54	235,445,468.54
未分配利润	6.4.7.10	170,584,690.22	112,155,542.38
所有者权益合计		406,030,158.76	347,601,010.92
负债和所有者权益总计		413,931,026.43	352,325,843.30

注：本基金合同生效日为 2020 年 07 月 23 日，本报告期自基金合同生效日 2020 年 07 月 23 日起至 2021 年 06 月 30 日止。报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.7245 元，基金份额总额 235,445,468.54 份。

6.2 利润表

会计主体：红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		66,405,504.31
1. 利息收入		39,451.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	38,604.62
债券利息收入		847.20
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		73,259,276.98

其中：股票投资收益	6.4.7.12	72,137,767.93
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	142,906.14
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	978,602.91
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-6,893,224.49
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-
减：二、费用		7,976,356.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,522,103.97
2. 托管费	6.4.10.2.2	420,350.74
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,944,099.55
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		3.06
7. 其他费用	6.4.7.20	89,799.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		58,429,147.84
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		58,429,147.84

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：红土创新科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	235,445,468.54	112,155,542.38	347,601,010.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	58,429,147.84	58,429,147.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申	-	-	-

购款			
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	235,445,468.54	170,584,690.22	406,030,158.76

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告-至-财务报表由下列负责人签署：

阮菲

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 年封闭运作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[2020]68 号《关于准予红土创新科技创新 3 年封闭运作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《红土创新科技创新 3 年封闭运作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，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 235,291,739.71 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(2020)第 0514 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 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 7 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 235,445,468.54 份基金份额，其中认购资金利息折合 153,728.83 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金在基金合同生效的前三年为封闭运作期。在封闭运作期内，本基金不办理申购、赎回业务，但投资者可在其持有的基金份额上市交易后通过上海证券交易所转让基金份额。封闭运作期届满后，本基金将转为上市开放式基金(LOF)，基金名称调整为“红土创新科技创新股票型证券投资基金(LOF)”，并接受场内、场外申购和赎回。

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 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含科创板、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(包括国债、政策性金融债、中央银行票据、信用等级在 AAA(含)以上的债券及非金融企业债务融资工具等)、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具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)。本基金封闭运作期内，股票及存托凭证资产投资比例为基金资产的 0%-100%，其中，投资于科技创新主题相关证券资产比例不低于非现金基金资产的 80%；投资同业存单的比例不得超过基金资产的 20%。基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成分指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《红土创新科技创新 3 年封闭运作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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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

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：

(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的转让收入免征增值税，对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，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 年 6 月 30 日
活期存款	5,013,065.20
定期存款	-
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	-
合计	5,013,065.20

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	357,076,646.65	405,675,538.68	48,598,892.03
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	357,076,646.65	405,675,538.68	48,598,892.03

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	394.64
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	1,334.20
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	124.10
合计	1,852.94

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,541,532.47
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,541,532.47

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-
预提费用	89,260.15
合计	89,260.15

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	235,445,468.54	235,445,468.54
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
- 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	235,445,468.54	235,445,468.54

6.4.7.10 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	56,663,425.86	55,492,116.52	112,155,542.38
本期利润	65,322,372.33	-6,893,224.49	58,429,147.84
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	121,985,798.19	48,598,892.03	170,584,690.22

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	14,295.38
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	22,384.19
其他	1,925.05
合计	38,604.62

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	72,137,767.93
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	72,137,767.93

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	1,904,847,398.20
减：卖出股票成本总额	1,832,709,630.27
买卖股票差价收入	72,137,767.93

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	142,906.14
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	142,906.14

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,545,878.90
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,402,100.00
减：应收利息总额	872.76
买卖债券差价收入	142,906.14

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	978,602.91
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	978,602.91

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
------	----------------------------

1. 交易性金融资产	-6,893,224.49
股票投资	-6,893,224.49
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	-6,893,224.49

6.4.7.18 其他收入

无。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	4,944,099.55
银行间市场交易费用	-
合计	4,944,099.55

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	539.00
合计	89,799.15

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
红土创新基金管理有限公司（“红土创新”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
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
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,522,103.97
其中：支付销售机构的客户维护费	1,127,530.76

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 1.50%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	420,350.74

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金合同生效日(2020 年 7 月 23 日)持有的基金份额	20,004,500.00
报告期初持有的基金份额	20,004,500.00	
报告期间申购/买入总份额	-	
报告期间因拆分变动份额	-	
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	
报告期末持有的基金份额	20,004,500.00	
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	8.50%	

注：基金管理人红土创新投资本基金适用的交易费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	5,013,065.20	14,295.38

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 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(2021 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	可流通日	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
002139	拓邦股份	2021年6月3日	2021年12月3日	非公开发行流通受限	11.40	16.38	1,052,631	11,999,993.40	17,242,095.78	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	创业板新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	创业板新股锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月20日	创业板新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	创业板新股锁定	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	创业板新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	创业板新股锁定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	创业板新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	创业板新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-

300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	创业板新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	创业板新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	创业板新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	创业板新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	创业板新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	创业板新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	创业板新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	创业板新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	创业板新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	创业板新股锁定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301018	申菱	2021	2021	新股	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-

	环境	年6月28日	年7月7日	未上市						
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688067	爱威科技	2021年6月7日	2021年12月16日	非公开发行流通受限	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
688161	威高骨科	2021年6月23日	2021年12月30日	非公开发行流通受限	36.22	82.27	2,544	92,143.68	209,294.88	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688656	浩欧博	2021年1月6日	2021年7月13日	非公开发行流通受限	35.26	72.60	1,371	48,341.46	99,534.60	-
688685	迈信林	2021年4月30日	2021年11月15日	非公开发行流通受限	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688368	晶丰明源	2021年6月21日	重大事项停牌	335.26	2021年7月5日	402.31	31,177	10,012,109.43	10,452,401.02	-
600460	士兰	2021	重大	56.35	2021	59.49	7,300	240,786.00	411,355.00	-

	微	年 6 月 30 日	事项 停牌		年 7 月 1 日					
--	---	---------------	----------	--	-----------------	--	--	--	--	--

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

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中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无债券投资。

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约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,013,065.20	-	-	-	5,013,065.20
结算备付金	2,964,875.82	-	-	-	2,964,875.82
存出保证金	275,693.79	-	-	-	275,693.79
交易性金融资产	-	-	-	-405,675,538.68	405,675,538.68
应收利息	-	-	-	1,852.94	1,852.94
资产总计	8,253,634.81	-	-	-405,677,391.62	413,931,026.43
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	457,231.84	457,231.84
应付托管费	-	-	-	76,205.33	76,205.33
应付证券清算款	-	-	-	4,736,637.88	4,736,637.88
应付交易费用	-	-	-	2,541,532.47	2,541,532.47
其他负债	-	-	-	89,260.15	89,260.15
负债总计	-	-	-	7,900,867.67	7,900,867.67
利率敏感度缺口	8,253,634.81	-	-	-397,776,523.95	406,030,158.76
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,851,344.97	-	-	-	4,851,344.97
结算备付金	1,550,070.09	-	-	-	1,550,070.09
存出保证金	161,489.11	-	-	-	161,489.11
交易性金融资产	-	-	-	-345,713,518.02	345,713,518.02
应收证券清算款	-	-	-	47,862.54	47,862.54
应收利息	-	-	-	1,558.57	1,558.57
资产总计	6,562,904.17	-	-	-345,762,939.13	352,325,843.30
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,298,235.78	3,298,235.78
应付管理人报酬	-	-	-	393,645.11	393,645.11
应付托管费	-	-	-	65,607.54	65,607.54
应付交易费用	-	-	-	867,343.95	867,343.95
其他负债	-	-	-	100,000.00	100,000.00
负债总计	-	-	-	4,724,832.38	4,724,832.38
利率敏感度缺口	6,562,904.17	-	-	-341,038,106.75	347,601,010.92

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 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。在本基金封闭运作期内，股票及存托凭证资产投资比例为基金资产的 0%-100%，其中，投资于科技创新主题相关证券资产比例不低于非现金基金资产的 80%；投资同业存单的比例不得超过基金资产的 20%。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 2021年6月30日		上年度末 2020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	405,675,538.68	99.91	345,713,518.02	99.46
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	405,675,538.68	99.91	345,713,518.02	99.46

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
	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(2021年6月30日)	上年度末(2020年12月31日)
分析	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	4,254.08	3,928.64
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-4,254.08	-3,928.64

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 405,675,538.68 元,无属于第二、三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活

跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外,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	405,675,538.68	98.01
	其中:股票	405,675,538.68	98.01
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	7,977,941.02	1.93
8	其他各项资产	277,546.73	0.07
9	合计	413,931,026.43	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	354,505,409.72	87.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	300,288.78	0.07
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	24,322,743.72	5.99
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	17,288,993.00	4.26
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,732.05	0.00
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	9,227,336.58	2.27
	合计	405,675,538.68	99.91

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	002709	天赐材料	184,500	19,664,010.00	4.84
2	300769	德方纳米	93,598	19,345,770.62	4.76
3	002027	分众传媒	1,837,300	17,288,993.00	4.26
4	002139	拓邦股份	1,052,631	17,242,095.78	4.25
5	002407	多氟多	468,200	16,639,828.00	4.10
6	600110	诺德股份	1,258,700	15,330,966.00	3.78
7	300408	三环集团	356,300	15,114,246.00	3.72
8	002460	赣锋锂业	122,100	14,785,089.00	3.64
9	603986	兆易创新	76,415	14,358,378.50	3.54
10	300014	亿纬锂能	137,400	14,279,982.00	3.52
11	300687	赛意信息	647,552	13,838,186.24	3.41
12	300223	北京君正	125,600	12,675,552.00	3.12
13	002026	山东威达	814,000	11,119,240.00	2.74

14	300477	合纵科技	1,595,000	10,989,550.00	2.71
15	688345	博力威	149,121	10,967,849.55	2.70
16	600884	杉杉股份	456,200	10,638,584.00	2.62
17	688368	晶丰明源	31,177	10,452,401.02	2.57
18	300476	胜宏科技	453,880	9,917,278.00	2.44
19	605117	德业股份	77,508	9,890,020.80	2.44
20	002326	永太科技	490,100	9,797,099.00	2.41
21	002812	恩捷股份	41,834	9,793,339.40	2.41
22	601233	桐昆股份	398,359	9,596,468.31	2.36
23	000009	中国宝安	505,054	9,227,336.58	2.27
24	601689	拓普集团	238,500	8,927,055.00	2.20
25	605111	新洁能	46,320	8,350,106.40	2.06
26	603799	华友钴业	70,152	8,011,358.40	1.97
27	603185	上机数控	41,800	7,480,110.00	1.84
28	603659	璞泰来	52,620	7,187,892.00	1.77
29	002080	中材科技	238,000	6,228,460.00	1.53
30	002245	蔚蓝锂芯	312,900	6,164,130.00	1.52
31	603212	赛伍技术	187,600	6,057,604.00	1.49
32	688599	天合光能	199,458	5,654,634.30	1.39
33	688388	嘉元科技	54,692	4,974,784.32	1.23
34	002459	晶澳科技	87,000	4,263,000.00	1.05
35	688029	南微医学	13,460	4,195,347.40	1.03
36	300750	宁德时代	7,700	4,117,960.00	1.01
37	002136	安纳达	211,800	3,045,684.00	0.75
38	603906	龙蟠科技	69,640	2,437,400.00	0.60
39	300390	天华超净	47,300	2,271,819.00	0.56
40	688268	华特气体	27,723	2,084,215.14	0.51
41	603678	火炬电子	30,500	2,058,750.00	0.51
42	000733	振华科技	33,300	2,033,631.00	0.50
43	601012	隆基股份	15,120	1,343,260.80	0.33
44	300623	捷捷微电	25,450	962,773.50	0.24
45	300037	新宙邦	9,200	920,920.00	0.23
46	002759	天际股份	14,900	553,535.00	0.14
47	002049	紫光国微	3,100	477,989.00	0.12
48	600460	士兰微	7,300	411,355.00	0.10
49	002493	荣盛石化	22,050	380,803.50	0.09
50	688276	百克生物	2,520	263,541.60	0.06
51	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.06
52	688613	奥精医疗	2,617	237,597.43	0.06
53	688161	威高骨科	2,544	209,294.88	0.05
54	002623	亚玛顿	3,100	131,099.00	0.03
55	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.03

56	688656	浩欧博	1,371	99,534.60	0.02
57	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
58	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.01
59	300992	泰福泵业	1,998	55,828.42	0.01
60	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.01
61	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.01
62	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
63	300894	火星人	679	46,172.00	0.01
64	688016	心脉医疗	101	45,915.61	0.01
65	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
66	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.01
67	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.01
68	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.01
69	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.01
70	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
71	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
72	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
73	300932	三友联众	518	16,437.22	0.00
74	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
75	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
76	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
77	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
78	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
79	300926	博俊科技	384	8,534.80	0.00
80	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
81	300927	江天化学	263	7,928.72	0.00
82	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
83	300929	华骐环保	227	6,732.05	0.00
84	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
85	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
86	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
87	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
88	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
89	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
90	688036	传音控股	18	3,771.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002709	天赐材料	55,119,770.36	15.86
2	002459	晶澳科技	52,708,870.22	15.16

3	300014	亿纬锂能	47,003,898.94	13.52
4	300037	新宙邦	40,146,576.00	11.55
5	002027	分众传媒	39,895,547.80	11.48
6	300568	星源材质	39,197,879.02	11.28
7	000636	风华高科	37,158,829.06	10.69
8	688036	传音控股	35,359,047.15	10.17
9	002139	拓邦股份	35,247,644.40	10.14
10	300073	当升科技	34,423,213.90	9.90
11	300394	天孚通信	33,590,770.08	9.66
12	300476	胜宏科技	31,028,328.22	8.93
13	603678	火炬电子	29,584,115.89	8.51
14	688408	中信博	28,940,359.39	8.33
15	300408	三环集团	28,723,076.00	8.26
16	603806	福斯特	28,040,782.45	8.07
17	600089	特变电工	26,722,174.86	7.69
18	002594	比亚迪	26,373,894.00	7.59
19	688005	容百科技	26,151,183.55	7.52
20	300750	宁德时代	26,037,753.00	7.49
21	600884	杉杉股份	25,134,308.78	7.23
22	002812	恩捷股份	24,054,179.52	6.92
23	688680	海优新材	23,924,556.81	6.88
24	002049	紫光国微	23,706,784.00	6.82
25	600110	诺德股份	23,305,914.50	6.70
26	002460	赣锋锂业	22,018,053.70	6.33
27	300373	扬杰科技	21,771,803.85	6.26
28	603799	华友钴业	21,630,472.34	6.22
29	300782	卓胜微	21,349,508.09	6.14
30	603659	璞泰来	21,192,639.60	6.10
31	002850	科达利	21,074,712.50	6.06
32	300769	德方纳米	20,132,978.00	5.79
33	300623	捷捷微电	19,955,575.96	5.74
34	002407	多氟多	19,882,556.31	5.72
35	300274	阳光电源	19,703,572.00	5.67
36	601012	隆基股份	19,370,998.27	5.57
37	300115	长盈精密	18,944,351.84	5.45
38	688396	华润微	18,680,845.31	5.37
39	002484	江海股份	17,904,942.44	5.15
40	003022	联泓新科	17,661,060.10	5.08
41	600563	法拉电子	17,594,696.42	5.06
42	688390	固德威	17,450,683.95	5.02
43	002245	蔚蓝锂芯	17,129,432.12	4.93
44	300953	震裕科技	16,424,462.00	4.73

45	603185	上机数控	16,235,121.04	4.67
46	601865	福莱特	15,545,155.00	4.47
47	002859	洁美科技	15,402,247.96	4.43
48	002876	三利谱	14,663,350.60	4.22
49	603212	赛伍技术	14,378,386.30	4.14
50	688388	嘉元科技	14,319,554.83	4.12
51	688063	派能科技	14,286,690.50	4.11
52	603986	兆易创新	14,257,613.20	4.10
53	600885	宏发股份	13,987,589.00	4.02
54	002026	山东威达	13,787,511.00	3.97
55	688598	金博股份	13,338,079.20	3.84
56	688106	金宏气体	12,810,996.90	3.69
57	300687	赛意信息	12,737,286.42	3.66
58	000547	航天发展	12,638,320.85	3.64
59	002623	亚玛顿	12,563,939.00	3.61
60	000733	振华科技	12,448,124.18	3.58
61	688345	博力威	12,252,307.59	3.52
62	605117	德业股份	12,149,289.00	3.50
63	000977	浪潮信息	11,698,528.44	3.37
64	300477	合纵科技	11,626,839.00	3.34
65	603906	龙蟠科技	10,992,011.60	3.16
66	300223	北京君正	10,669,802.20	3.07
67	601689	拓普集团	10,597,683.00	3.05
68	300253	卫宁健康	10,480,702.41	3.02
69	688599	天合光能	10,440,495.27	3.00
70	002466	天齐锂业	10,386,112.00	2.99
71	600760	中航沈飞	10,235,758.00	2.94
72	002824	和胜股份	10,164,635.00	2.92
73	688368	晶丰明源	10,012,109.43	2.88
74	688016	心脉医疗	9,900,661.51	2.85
75	688819	天能股份	9,614,619.92	2.77
76	688116	天奈科技	9,595,096.61	2.76
77	300059	东方财富	9,433,177.46	2.71
78	000100	TCL 科技	9,088,877.00	2.61
79	601233	桐昆股份	9,060,180.29	2.61
80	002236	大华股份	9,001,978.00	2.59
81	002415	海康威视	8,862,436.00	2.55
82	688311	盟升电子	8,679,346.24	2.50
83	300850	新强联	8,630,675.00	2.48
84	000009	中国宝安	8,403,356.22	2.42
85	600309	万华化学	8,333,556.00	2.40
86	605111	新洁能	8,257,117.80	2.38

87	002074	国轩高科	8,139,640.70	2.34
88	688268	华特气体	8,080,969.28	2.32
89	002326	永太科技	8,023,120.00	2.31
90	002636	金安国纪	7,974,868.00	2.29
91	601311	骆驼股份	7,774,624.35	2.24
92	300659	中孚信息	7,579,767.00	2.18
93	603489	八方股份	7,553,660.45	2.17
94	002759	天际股份	7,202,128.00	2.07

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	300568	星源材质	59,225,594.00	17.04
2	000636	风华高科	55,478,990.02	15.96
3	688036	传音控股	55,355,290.82	15.92
4	300014	亿纬锂能	51,346,984.96	14.77
5	002459	晶澳科技	47,871,536.54	13.77
6	002709	天赐材料	45,816,403.68	13.18
7	300073	当升科技	45,238,673.44	13.01
8	603678	火炬电子	43,463,723.38	12.50
9	603806	福斯特	43,228,647.46	12.44
10	002049	紫光国微	41,601,299.36	11.97
11	300037	新宙邦	39,671,885.73	11.41
12	002139	拓邦股份	39,249,277.43	11.29
13	601012	隆基股份	38,605,985.47	11.11
14	300274	阳光电源	36,533,475.46	10.51
15	300394	天孚通信	35,330,896.63	10.16
16	601865	福莱特	34,675,017.73	9.98
17	688408	中信博	33,683,119.93	9.69
18	002594	比亚迪	33,535,863.00	9.65
19	002027	分众传媒	30,251,935.92	8.70
20	603799	华友钴业	28,880,937.66	8.31
21	688005	容百科技	26,240,972.59	7.55
22	600089	特变电工	24,861,597.04	7.15
23	300750	宁德时代	23,867,933.14	6.87
24	688680	海优新材	23,288,877.40	6.70
25	688390	固德威	22,552,552.08	6.49
26	300373	扬杰科技	22,445,803.96	6.46
27	603659	璞泰来	22,385,460.02	6.44
28	002859	洁美科技	22,065,640.96	6.35
29	300476	胜宏科技	21,454,725.00	6.17
30	300782	卓胜微	21,299,279.90	6.13

31	002812	恩捷股份	21,167,275.50	6.09
32	002623	亚玛顿	20,027,846.52	5.76
33	688396	华润微	20,002,790.03	5.75
34	002850	科达利	19,670,113.00	5.66
35	600563	法拉电子	19,501,621.00	5.61
36	300623	捷捷微电	18,503,927.50	5.32
37	300115	长盈精密	18,240,291.91	5.25
38	002484	江海股份	18,205,427.20	5.24
39	603489	八方股份	17,756,468.00	5.11
40	300953	震裕科技	17,298,400.72	4.98
41	300408	三环集团	17,256,248.00	4.96
42	003022	联泓新科	16,805,368.74	4.83
43	600884	杉杉股份	16,459,302.55	4.74
44	688598	金博股份	16,260,230.90	4.68
45	603212	赛伍技术	16,105,601.00	4.63
46	000547	航天发展	15,822,655.51	4.55
47	300253	卫宁健康	15,611,658.44	4.49
48	600885	宏发股份	14,501,116.00	4.17
49	603218	日月股份	14,352,787.24	4.13
50	002245	蔚蓝锂芯	14,117,393.00	4.06
51	002460	赣锋锂业	14,011,272.85	4.03
52	002876	三利谱	13,816,105.50	3.97
53	688063	派能科技	13,593,152.24	3.91
54	300850	新强联	13,472,833.00	3.88
55	688106	金宏气体	12,601,123.98	3.63
56	002824	和胜股份	12,587,001.00	3.62
57	000977	浪潮信息	11,852,491.01	3.41
58	600110	诺德股份	10,539,956.00	3.03
59	688116	天奈科技	10,456,432.32	3.01
60	688016	心脉医疗	10,039,562.52	2.89
61	688388	嘉元科技	10,031,235.59	2.89
62	600760	中航沈飞	9,684,103.00	2.79
63	000733	振华科技	9,605,737.20	2.76
64	603185	上机数控	9,080,281.06	2.61
65	300763	锦浪科技	9,042,051.00	2.60
66	002236	大华股份	9,028,888.00	2.60
67	603906	龙蟠科技	8,975,394.00	2.58
68	002466	天齐锂业	8,860,800.52	2.55
69	688819	天能股份	8,796,403.30	2.53
70	601636	旗滨集团	8,766,404.00	2.52
71	300059	东方财富	8,757,505.00	2.52
72	000100	TCL 科技	8,747,398.00	2.52

73	002415	海康威视	8,664,709.00	2.49
74	002074	国轩高科	8,469,577.22	2.44
75	002407	多氟多	8,338,237.00	2.40
76	002636	金安国纪	8,170,212.00	2.35
77	601311	骆驼股份	7,732,381.50	2.22
78	688311	盟升电子	7,441,081.50	2.14
79	002138	顺络电子	7,386,562.00	2.13
80	688567	孚能科技	7,277,831.47	2.09
81	002759	天际股份	7,120,462.00	2.05
82	600309	万华化学	7,026,955.00	2.02

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	1,899,564,875.42
卖出股票收入（成交）总额	1,904,847,398.20

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

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	275,693.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,852.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	277,546.73

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002139	拓邦股份	17,242,095.78	4.25	-

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

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 (%)
4,850	48,545.46	20,009,500.00	8.50	215,435,968.54	91.50

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	红土创新基金管理有 限公司	20004500.00	8.50
2	熊海涛	7154647.58	3.04
3	吴宇婷	3467854.37	1.47
4	张恩光	2989802.81	1.27
5	王喜艳	2989529.63	1.27
6	余诗慧	2986523.24	1.27
7	余卫华	1992571.87	0.85
8	邝立群	1992481.87	0.85
9	叶树明	1992481.87	0.85
10	郭东荣	1992481.87	0.85

8.3 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	200,194.81	0.09

8.4 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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2020 年 7 月 23 日) 基金份额总额	-
本报告期期初基金份额总额	235,445,468.54
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少 以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	235,445,468.54

§ 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

2021 年 4 月 29 日，经本公司董事会决议通过并经中国证监会核准，任命冀洪涛先生担任

本公司总经理，公司董事长阮菲女士不再代为行使总经理职责。2021 年 4 月 30 日，公司在《证券时报》上刊登《红土创新基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

2021 年 4 月 29 日，经公司第二届董事会第十六次会议决议通过，同意程志田先生于 2021 年 5 月 7 日辞去副总经理职务。2021 年 5 月 7 日，公司在《证券时报》上刊登《红土创新基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

2021 年 5 月 21 日，经工商行政管理部门核准，红土创新基金管理有限公司法定代表人变更为阮菲女士。2021 年 5 月 26 日，公司在《证券时报》上刊登《红土创新基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告》。

2021 年 8 月 4 日，公司在《证券日报》上刊登了《红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》，公告增聘盖俊龙先生为本基金的基金经理，解聘朱然先生的本基金基金经理职务；现盖俊龙先生为本基金唯一基金经理。

中国工商银行股份有限公司根据工作需要，任命刘彤女士担任公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任公司资产托管部总经理职务。

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，本基金无涉及基金管理人、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

本基金聘任普华永道中天会计师事务所（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

本报告期内，基金管理人、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	
华创证券	2	1,786,533,762.94	47.14%	1,270,764.70	47.14%	-
中银国际 证券	2	1,552,438,527.07	40.96%	1,104,252.04	40.96%	-
中泰证券	1	451,112,336.54	11.90%	320,875.84	11.90%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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
华创证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	1,545,878.90	100.00%	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

华西证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投 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终止部分基金销售公司办理本公司旗下基金销售业务的提示	证券时报、公司网站	2021 年 01 月 22 日
2	红土创新基金管理有限公司关于红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金暂停跨系统转托管业务的公告	证券日报、公司网站	2021 年 02 月 25 日
3	红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金上市交易公告书	证券日报、公司网站	2021 年 03 月 02 日
4	红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金上市交易公告书提示性公告	证券日报、公司网站	2021 年 03 月 05 日
5	红土创新基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、公司网站	2021 年 04 月 30 日
6	红土创新基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、公司网站	2021 年 05 月 07 日
7	红土创新基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	证券时报、公司网站	2021 年 05 月 26 日
8	红土创新基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	证券时报、公司网站	2021 年 06 月 08 日
9	红土创新基金管理有限公司关于红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	证券日报、公司网站	2021 年 07 月 14 日
10	红土创新基金管理有限公司关于红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示及临时停牌公告	证券日报、公司网站	2021 年 07 月 15 日
11	红土创新基金管理有限公司关于红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金二级市场交易价	证券日报、公司网站	2021 年 07 月 16 日

	格溢价风险提示公告		
12	红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券日报、公司网站	2021 年 8 月 4 日
13	红土创新基金管理有限公司关于红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	证券日报、公司网站	2021 年 08 月 10 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

1. 巨额赎回风险

(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；

(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；

(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。

2. 转换运作方式或终止基金合同的风险；

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；

3. 流动性风险

单一投资者巨额赎回可能导致本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。

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红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；

(2) 红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同；

(3) 红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金托管协议；

(4) 红土创新科技创新 3 年封闭运作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) 报告期内红土创新科技创新 3 年封闭运作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

深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 楼

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

2021 年 8 月 31 日