

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 2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 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.....	9
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的真实、准确和完整发表意见.....	10
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	16
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47

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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
§ 8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
§ 9 开放式基金份额变动.....	49
§ 10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
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.....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§ 12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 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5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	殷喆
	联系电话	0755-33011858
	电子邮箱	yinz@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.htxfund.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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-89,208,073.89
本期利润	-70,505,875.28
加权平均基金份额本期利润	-0.2995
本期加权平均净值利润率	-17.28%
本期基金份额净值增长率	-13.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	167,926,383.44
期末可供分配基金份额利润	0.7132
期末基金资产净值	435,461,748.83
期末基金份额净值	1.8495
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	84.95%

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

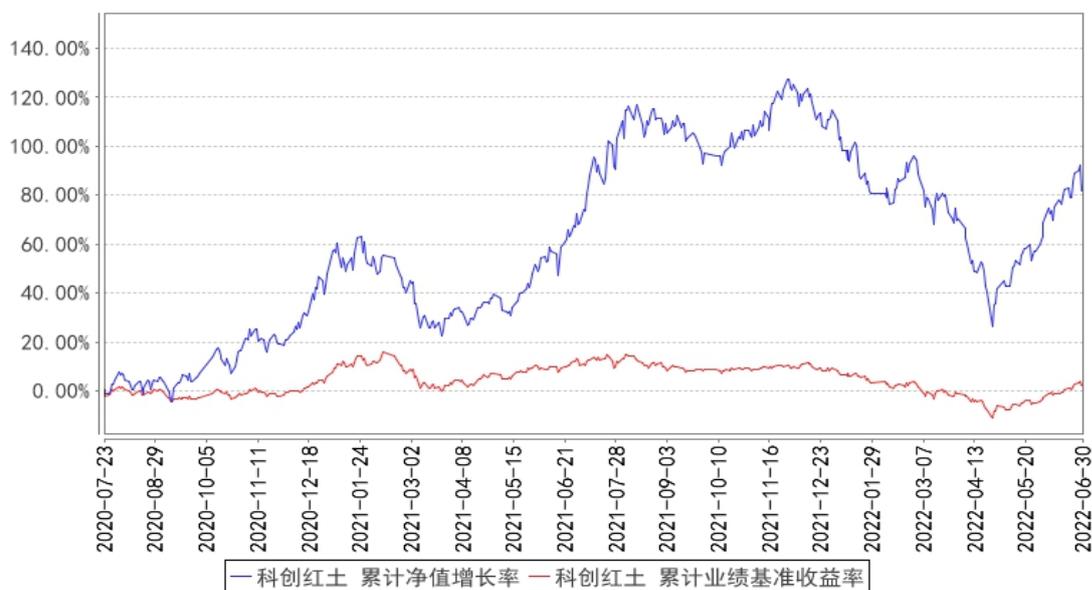
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	14.35%	2.17%	7.32%	0.78%	7.03%	1.39%
过去三个月	9.06%	2.55%	4.80%	1.02%	4.26%	1.53%
过去六个月	-13.94%	2.33%	-5.46%	0.96%	-8.48%	1.37%
过去一年	7.25%	2.13%	-8.44%	0.83%	15.69%	1.30%
自基金合同生效起至今	84.95%	2.13%	3.34%	0.87%	81.61%	1.26%

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2022年6月30日，红土创新基金共管理16只公募基金，资产管理规模114.01亿元。

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		
盖俊龙	本基金的基金经理	2021年8月3日	-	16年	历任长城基金管理有限公司行业研究员；宝盈基金管理有限公司研究员、专户投资经理、基金经理。现任本公司投资部总监，红土创新转型精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、红土创新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、红土创新科技创新3个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《红土创新科技创新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

报告期内未发现本基金存在不公平交易及异常交易的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金上半年主要配置了有色资源、装备制造、汽车及零部件、军工、光伏、半导体、医药等板块，科技成长类公司比重超过 80%，这类公司在 1 季度受美联储缩表、俄乌冲突和上海疫情的负面影响较大，所以基金净值在 1 季度回撤也较大。直到 4 月底，随着上海疫情的缓解，成长类公司开始有所反弹，特别是景气度较高的新能源和汽车板块涨幅较大。本基金在 6 月份减持了部分反弹幅度较大的公司，增配了一些相对低位的医药和半导体公司，但换仓效果一般。

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 1.8495 元；本报告期基金份额净值增长率为-13.94%，业绩比较基准收益率为-5.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年上半年 A 股市场波动较大。首先是 1-4 月底的下跌阶段，在美联储缩表预期、俄乌冲突、上海疫情等负面因素的影响下，A 股市场整体回落较大，特别是成长类公司；然后 4 月底开始进入反弹阶段，随着国内疫情开始逐步控制，各项宏观经济政策开始逐步发力，一系列“稳经济”的政策逐步出台，能源和汽车相关公司涨幅较大。展望 2022 年下半年，国内外经济环境仍然相对复杂。国内上半年财政政策和货币政策在疫情的影响下发挥余地不大，预期下半年政策将维护一个较好的经济和市场环境。而外围经济在高通胀环境下的走向较难预测，但本轮美联储加息在 8 月份后可能将逐步减缓，外部约束逐步缓解。

对于 A 股市场，下半年我们将从景气行业和经济复苏两个角度去关注下业绩兑现上较强的公司。景气行业重点关注“能源体系”和“自主汽车产业链”。大国博弈和“碳中和”形势下，保障能源安全和重构能源结构将成为重要战略。随着技术进步，以及人才和产业链的逐步成长，中国汽车产业已经发生了质变，特别在新能源车领域，未来在电气化和智能化的驱动下，我们认为自主品牌整车和国内汽车零部件产业链将面临巨大的成长空间。此外，我们也看好军工、高端装备等景气行业的投资机会。

同时，我们也将积极关注下半年经济复苏带来的投资机会。上半年制约 A 股风险偏好的美联储加息和俄乌地缘冲突的影响有望逐步减退，预计稳增长政策将进入密集落地期，基本面、流动性有望持续改善，预计会存在着较多的结构性投资机会，我们将重点关注科技创新类公司的投资机会。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——红土创新基金管理有限公司在本基金的投资运作、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。

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本基金 2022 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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	36,667,210.50	5,374,373.76
结算备付金		3,241,791.19	3,813,585.14
存出保证金		360,213.04	347,558.23
交易性金融资产	6.4.7.2	407,945,545.56	500,530,464.98
其中：股票投资		407,945,545.56	500,530,464.98
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		-	6,818,803.01
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	2,954.15
资产总计		448,214,760.29	516,887,739.27
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		10,351,008.80	8,068,096.97
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		515,897.60	652,743.16
应付托管费		85,982.93	108,790.53
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	1,800,122.13	2,090,484.50
负债合计		12,753,011.46	10,920,115.16
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	235,445,468.54	235,445,468.54
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	200,016,280.29	270,522,155.57
净资产合计		435,461,748.83	505,967,624.11
负债和净资产总计		448,214,760.29	516,887,739.27

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 2022 年 06 月 30 日止。报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.8495 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-66,875,891.74	66,405,504.31
1. 利息收入		88,417.07	39,451.82
其中：存款利息收入	6.4.7.13	88,417.07	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）		-85,666,507.42	73,259,276.98
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-87,016,187.31	72,137,767.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	142,906.14
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	1,349,679.89	978,602.91
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-

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	18,702,198.61	-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）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		3,629,983.54	7,976,356.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,034,538.47	2,522,103.97
2. 托管费	6.4.10.2.2	505,756.37	420,350.74
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
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		-	3.06
8. 其他费用	6.4.7.23	89,688.70	5,033,898.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-70,505,875.28	58,429,147.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-70,505,875.28	58,429,147.84
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-70,505,875.28	58,429,147.84

6.3 净资产（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：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022年1月1日至2022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（基金净值）	235,445,468.54	-	270,522,155.57	505,967,624.11
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本 期初 净资 产（基 金 净 值）	235,445,468.54	-	270,522,155.57	505,967,624.11
三、本 期 增 减 变 动 额（减 少 以“-” 号 填 列）	-	-	-70,505,875.28	-70,505,875.28
（一）、 综 合 收 益 总 额	-	-	-70,505,875.28	-70,505,875.28
（二）、 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	-	-	-	-
（三）、 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）	-	-	-	-
（四）、 其 他 综 合 收 益 结 转 留 存 收 益	-	-	-	-
四、本 期 期 末 净 资 产（基 金 净 值）	235,445,468.54	-	200,016,280.29	435,461,748.83

项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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（基金净值）	235,445,468.54	-	112,155,542.38	347,601,010.92
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	235,445,468.54	-	112,155,542.38	347,601,010.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	58,429,147.84	58,429,147.84
（一）、综合收益总额	-	-	58,429,147.84	58,429,147.84
（二）、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	-	-	-	-
（三）、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）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（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：

冀洪涛

周厚桥

焦小川

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

红土创新科技创新 3 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 \times 50%+中证全债指数收益率 \times 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

除下述会计政策和会计估计外，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。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际

利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外,中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 5,374,373.76 元、3,813,585.14 元、347,558.23 元、2,954.15 元和 6,818,803.01 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 5,375,268.16 元、3,815,472.85 元、347,730.27 元、0.00 元和 6,818,803.01 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 500,530,464.98 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 500,530,464.98 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费和应付交易费用，金额分别为 8,068,096.97 元、652,743.16 元、108,790.53 元和 1,910,484.50 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-应付交易费用，金额分别为 8,068,096.97 元、652,743.16 元、108,790.53 元和 1,910,484.50 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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

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 2022年6月30日
----	-------------------

活期存款	36,667,210.50
等于：本金	36,664,848.99
加：应计利息	2,361.51
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	36,667,210.50

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	375,855,648.71	-	407,945,545.56	32,089,896.85
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	375,855,648.71	-	407,945,545.56	32,089,896.85

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 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 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	1,650,861.98
其中：交易所市场	1,650,861.98
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	149,260.15
合计	1,800,122.13

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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

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。

6.4.7.8 其他综合收益

6.4.7.9 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
本期期初	257,134,457.33	13,387,698.24	270,522,155.57
本期利润	-89,208,073.89	18,702,198.61	-70,505,875.28
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	167,926,383.44	32,089,896.85	200,016,280.29

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	60,177.69
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	25,079.12
其他	3,160.26
合计	88,417.07

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-87,016,187.31
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	-87,016,187.31

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,198,598,904.83
减：卖出股票成本总额	2,279,902,070.85
减：交易费用	5,713,021.29
买卖股票差价收入	-87,016,187.31

6.4.7.12 贵金属投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,349,679.89
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	1,349,679.89

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	18,702,198.61
股票投资	18,702,198.61
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	18,702,198.61

6.4.7.16 其他收入

无。

6.4.7.17 信用减值损失

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-
银行划款手续费	428.55
合计	89,688.70

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”)	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
深创投红土资产管理(深圳)有限公司(“深创投红土资管”)	基金管理人的全资子公司
深圳市创新投资集团有限公司(“深创投”)	基金管理人的控股股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 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	3,034,538.47	2,522,103.97
其中：支付销售机构的客户维护费	1,331,944.20	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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 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	505,756.37	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：

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

6.4.10.2.3 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 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	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	20,004,500.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	8.5000%

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
工商银行	36,667,210.50	60,177.69	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(2022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
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	创业板新股锁定	55.57	30.03	331	18,393.67	9,939.93	-
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	创业板新股锁定	39.88	31.09	491	19,581.08	15,265.19	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	创业板新股锁定	42.50	32.02	491	16,065.00	15,721.82	-
301109	军信股份	2022年4月6日	6个月	创业板新股锁定	34.81	16.14	1,020	23,670.80	16,462.80	-
301110	青木股份	2022年3月4日	6个月	创业板新股锁定	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	创业板新股锁定	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	创业板新股锁定	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301120	新特电气	2022年4月11日	6个月	创业板新股锁定	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301122	采纳股份	2022年1月19日	6个月	创业板新股锁定	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301125	腾亚精工	2022年5月27日	6个月	创业板新股锁定	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301135	瑞德智能	2022年4月1日	6个月	创业板新股锁定	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-

301137	哈焊 华通	2022年3 月14日	6个月	创业板 新股锁 定	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301139	元道 通信	2022年6 月30日	1个月内 (含)	新股未 上市	38.46	38.46	4,973	191,261.58	191,261.58	-
301148	嘉戎 技术	2022年4 月14日	6个月	创业板 新股锁 定	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-
301150	中一 科技	2022年4 月14日	6个月	创业板 新股锁 定	163.56	82.76	163	17,828.04	13,489.88	-
301153	中科 江南	2022年5 月10日	6个月	创业板 新股锁 定	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301160	翔楼 新材	2022年5 月25日	6个月	创业板 新股锁 定	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-
301162	国能 日新	2022年4 月19日	6个月	创业板 新股锁 定	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301181	标榜 股份	2022年2 月11日	6个月	创业板 新股锁 定	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301187	欧圣 电气	2022年4 月13日	6个月	创业板 新股锁 定	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	-
301196	唯科 科技	2022年1 月4日	6个月	创业板 新股锁 定	64.08	37.52	190	12,175.20	7,128.80	-
301200	大族 数控	2022年2 月18日	6个月	创业板 新股锁 定	76.56	51.92	297	22,738.32	15,420.24	-
301201	诚达 药业	2022年1 月12日	6个月	创业板 新股锁 定	72.69	71.54	298	21,661.62	21,318.92	-
301207	华兰 疫苗	2022年2 月10日	6个月	创业板 新股锁 定	56.88	56.42	268	15,243.84	15,120.56	-
301215	中汽 股份	2022年2 月28日	6个月	创业板 新股锁 定	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301216	万凯 新材	2022年3 月21日	6个月	创业板 新股锁 定	35.68	29.84	486	17,340.48	14,502.24	-

301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	创业板新股锁定	17.27	14.83	1,548	26,733.96	22,956.84	-
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	创业板新股锁定	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	创业板新股锁定	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301237	和顺科技	2022年3月16日	6个月	创业板新股锁定	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	创业板新股锁定	19.18	32.07	1,123	21,539.14	36,014.61	-
301248	杰创智能	2022年4月13日	6个月	创业板新股锁定	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	创业板新股锁定	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	创业板新股锁定	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301259	艾布鲁	2022年4月18日	6个月	创业板新股锁定	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301266	宇邦新材	2022年5月30日	6个月	创业板新股锁定	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-
301286	侨源股份	2022年6月6日	6个月	创业板新股锁定	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301298	东利机械	2022年5月27日	6个月	创业板新股锁定	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301302	华如科技	2022年6月16日	6个月	创业板新股锁定	52.03	56.42	381	19,823.43	21,496.02	-
600938	中国海油	2022年4月14日	6个月	非公开发行流通受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-

688153	唯捷创芯	2022年4月1日	6个月	非公开发行流通受限	66.60	44.24	3,305	220,113.00	146,213.20	-
688170	德龙激光	2022年4月22日	6个月	非公开发行流通受限	30.18	47.04	6,175	186,361.50	290,472.00	-
688306	均普智能	2022年3月15日	6个月	非公开发行流通受限	5.08	5.19	28,347	144,002.76	147,120.93	-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	8,047	176,470.71	176,470.71	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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。

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，对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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 2022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	36,667,210.50	-	-	-	36,667,210.50
结算备付金	3,241,791.19	-	-	-	3,241,791.19
存出保证金	360,213.04	-	-	-	360,213.04
交易性金融资产	-	-	-	-407,945,545.56	407,945,545.56
资产总计	40,269,214.73	-	-	-407,945,545.56	448,214,760.29
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	515,897.60	515,897.60
应付托管费	-	-	-	85,982.93	85,982.93
应付清算款	-	-	-	10,351,008.80	10,351,008.80
其他负债	-	-	-	1,800,122.13	1,800,122.13
负债总计	-	-	-	12,753,011.46	12,753,011.46
利率敏感度缺口	40,269,214.73	-	-	-395,192,534.10	435,461,748.83
上年度末 2021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	5,374,373.76	-	-	-	5,374,373.76
结算备付金	3,813,585.14	-	-	-	3,813,585.14
存出保证金	347,558.23	-	-	-	347,558.23
交易性金融资产	-	-	-	-500,530,464.98	500,530,464.98
应收证券清算款	-	-	-	6,818,803.01	6,818,803.01
其他资产	-	-	-	2,954.15	2,954.15
资产总计	9,535,517.13	-	-	-507,352,222.14	516,887,739.27
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	652,743.16	652,743.16
应付托管费	-	-	-	108,790.53	108,790.53
应付证券清算款	-	-	-	8,068,096.97	8,068,096.97
其他负债	-	-	-	2,090,484.50	2,090,484.50
负债总计	-	-	-	10,920,115.16	10,920,115.16
利率敏感度缺口	9,535,517.13	-	-	-496,432,106.98	505,967,624.11

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 2022年6月30日		上年度末 2021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	407,945,545.56	93.68	500,530,464.98	98.93
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	407,945,545.56	93.68	500,530,464.98	98.93

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 6.4.1)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(2022年6月30日)	上年度末(2021年12月31日)	

分析	1. 业绩比较基准 (附注 6.4.1) 上升 5%	69,173,593.58	47,374,932.34
	2. 业绩比较基准 (附注 6.4.1) 下降 5%	-69,173,593.58	-47,374,932.34

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	405,020,925.07	499,190,415.13
第二层次	433,167.81	286,068.21
第三层次	2,491,452.68	1,053,981.64
合计	407,945,545.56	500,530,464.98

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

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	407,945,545.56	91.02
	其中：股票	407,945,545.56	91.02
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	39,909,001.69	8.90
8	其他各项资产	360,213.04	0.08
9	合计	448,214,760.29	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	1,332,303.44	0.31
C	制造业	381,264,294.26	87.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,444.75	0.00
F	批发和零售业	11,340.06	0.00
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	15,540,266.00	3.57
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	15,265.19	0.00
M	科学研究和技术服务业	9,699,314.77	2.23

N	水利、环境和公共设施管理业	59,595.27	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,721.82	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	407,945,545.56	93.68

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	601127	赛力斯	265,300	21,513,177.00	4.94
2	605123	派克新材	134,900	18,983,128.00	4.36
3	603595	东尼电子	446,800	18,448,372.00	4.24
4	300613	富瀚微	179,900	15,255,520.00	3.50
5	300726	宏达电子	238,100	14,564,577.00	3.34
6	600166	福田汽车	5,141,700	14,551,011.00	3.34
7	002011	盾安环境	1,117,100	13,729,159.00	3.15
8	600141	兴发集团	279,200	12,282,008.00	2.82
9	688077	大地熊	145,414	12,259,854.34	2.82
10	300595	欧普康视	204,000	11,666,760.00	2.68
11	688408	中信博	124,709	11,533,088.32	2.65
12	603338	浙江鼎力	222,200	11,265,540.00	2.59
13	600519	贵州茅台	5,500	11,247,500.00	2.58
14	605111	新洁能	86,540	10,887,597.40	2.50
15	002897	意华股份	230,200	10,151,820.00	2.33
16	300416	苏试试验	392,800	9,655,024.00	2.22
17	605376	博迁新材	156,100	9,100,630.00	2.09
18	600399	抚顺特钢	490,800	8,785,320.00	2.02
19	000422	湖北宜化	422,700	8,585,037.00	1.97
20	300806	斯迪克	293,120	8,321,676.80	1.91
21	000550	江铃汽车	515,200	8,284,416.00	1.90
22	300447	全信股份	382,100	7,783,377.00	1.79
23	002594	比亚迪	23,000	7,670,270.00	1.76
24	688556	高测股份	93,570	7,551,099.00	1.73
25	600521	华海药业	332,400	7,545,480.00	1.73
26	600456	宝钛股份	125,600	7,460,640.00	1.71
27	300438	鹏辉能源	108,200	6,648,890.00	1.53
28	600888	新疆众和	704,100	6,477,720.00	1.49

29	003031	中瓷电子	89,356	5,772,397.60	1.33
30	300850	新强联	62,360	5,551,910.80	1.27
31	002906	华阳集团	120,500	5,459,855.00	1.25
32	002025	航天电器	77,400	5,404,068.00	1.24
33	300395	菲利华	117,715	5,297,175.00	1.22
34	688596	正帆科技	258,054	5,114,630.28	1.17
35	000661	长春高新	21,277	4,966,477.34	1.14
36	600765	中航重机	146,540	4,715,657.20	1.08
37	688345	博力威	76,080	4,676,637.60	1.07
38	300776	帝尔激光	26,800	4,631,040.00	1.06
39	600862	中航高科	163,100	4,583,110.00	1.05
40	605358	立昂微	66,900	4,507,722.00	1.04
41	688180	君实生物	59,487	4,481,750.58	1.03
42	600460	士兰微	85,400	4,440,800.00	1.02
43	688300	联瑞新材	56,394	4,378,994.10	1.01
44	605399	晨光新材	95,500	4,063,525.00	0.93
45	002101	广东鸿图	122,364	2,789,899.20	0.64
46	000707	双环科技	132,300	2,247,777.00	0.52
47	300855	图南股份	53,000	2,214,870.00	0.51
48	002326	永太科技	64,600	2,127,278.00	0.49
49	688123	聚辰股份	13,885	1,479,030.20	0.34
50	601012	隆基绿能	21,168	1,410,423.84	0.32
51	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.31
52	300696	爱乐达	22,300	980,085.00	0.23
53	300268	佳沃食品	20,100	597,975.00	0.14
54	688297	中无人机	8,268	439,692.24	0.10
55	688320	禾川科技	6,048	312,076.80	0.07
56	688170	德龙激光	6,175	290,472.00	0.07
57	301139	元道通信	4,973	191,261.58	0.04
58	688400	凌云光	8,047	176,470.71	0.04
59	688306	均普智能	28,347	147,120.93	0.03
60	688153	唯捷创芯	3,305	146,213.20	0.03
61	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
62	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
63	301238	瑞泰新材	1,123	36,014.61	0.01
64	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.01
65	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.01
66	301217	铜冠铜箔	1,548	22,956.84	0.01
67	301302	华如科技	381	21,496.02	0.00
68	301201	诚达药业	298	21,318.92	0.00
69	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
70	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00

71	301101	明月镜片	371	19,043.43	0.00
72	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
73	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
74	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
75	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
76	301109	军信股份	1,020	16,462.80	0.00
77	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
78	301103	何氏眼科	491	15,721.82	0.00
79	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
80	301200	大族数控	297	15,420.24	0.00
81	301102	兆讯传媒	491	15,265.19	0.00
82	301207	华兰疫苗	268	15,120.56	0.00
83	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
84	301216	万凯新材	486	14,502.24	0.00
85	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
86	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
87	301096	百诚医药	177	13,983.00	0.00
88	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.00
89	301150	中一科技	163	13,489.88	0.00
90	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
91	301100	风光股份	599	12,926.42	0.00
92	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
93	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
94	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
95	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
96	301126	达嘉维康	662	11,340.06	0.00
97	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
98	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
99	301111	粤万年青	379	10,392.18	0.00
100	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
101	300834	星辉环材	331	9,939.93	0.00
102	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
103	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
104	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
105	301108	洁雅股份	213	8,428.41	0.00
106	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
107	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
108	301098	金埔园林	307	7,444.75	0.00
109	301196	唯科科技	190	7,128.80	0.00
110	688208	道通科技	100	3,292.00	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	002101	广东鸿图	38,940,679.36	7.70
2	002291	星期六	38,153,456.38	7.54
3	002603	以岭药业	31,105,844.01	6.15
4	688408	中信博	28,118,202.17	5.56
5	600141	兴发集团	27,782,472.00	5.49
6	688556	高测股份	27,545,690.02	5.44
7	002011	盾安环境	27,465,643.04	5.43
8	600456	宝钛股份	24,399,980.80	4.82
9	300395	菲利华	23,207,839.00	4.59
10	300447	全信股份	22,339,880.08	4.42
11	601127	赛力斯	22,329,101.00	4.41
12	301117	佳缘科技	21,850,577.77	4.32
13	300529	健帆生物	21,836,457.60	4.32
14	688533	上声电子	21,663,639.16	4.28
15	002810	山东赫达	21,052,144.00	4.16
16	688499	利元亨	20,975,246.69	4.15
17	002317	众生药业	20,930,190.17	4.14
18	002906	华阳集团	20,851,935.00	4.12
19	002594	比亚迪	20,799,598.00	4.11
20	002245	蔚蓝锂芯	20,648,112.00	4.08
21	300438	鹏辉能源	20,479,152.00	4.05
22	600460	士兰微	20,401,595.00	4.03
23	603595	东尼电子	20,105,899.00	3.97
24	688077	大地熊	20,004,411.38	3.95
25	300595	欧普康视	19,729,038.00	3.90
26	605123	派克新材	19,717,830.00	3.90
27	300820	英杰电气	19,663,090.83	3.89
28	600166	福田汽车	19,176,027.00	3.79
29	605111	新洁能	18,404,504.20	3.64
30	688518	联赢激光	18,284,434.13	3.61
31	000822	山东海化	18,255,619.00	3.61
32	688208	道通科技	18,104,974.79	3.58
33	300568	星源材质	17,463,489.86	3.45
34	300726	宏达电子	16,986,923.60	3.36
35	688099	晶晨股份	16,871,511.31	3.33
36	300203	聚光科技	16,837,373.50	3.33
37	000661	长春高新	16,222,111.00	3.21

38	605376	博迁新材	16,004,132.09	3.16
39	002056	横店东磁	15,801,584.00	3.12
40	600519	贵州茅台	15,789,442.00	3.12
41	300613	富瀚微	15,402,414.76	3.04
42	301071	力量钻石	15,271,890.00	3.02
43	603198	迎驾贡酒	15,079,722.47	2.98
44	000887	中鼎股份	14,855,120.00	2.94
45	603363	傲农生物	14,535,891.00	2.87
46	605168	三人行	14,371,022.80	2.84
47	002487	大金重工	13,548,712.00	2.68
48	300775	三角防务	13,501,198.00	2.67
49	603786	科博达	13,492,142.00	2.67
50	300457	赢合科技	13,208,933.00	2.61
51	000519	中兵红箭	12,948,805.12	2.56
52	603477	巨星农牧	12,850,688.00	2.54
53	600557	康缘药业	12,839,610.22	2.54
54	002176	江特电机	12,794,037.00	2.53
55	300879	大叶股份	12,375,208.00	2.45
56	688166	博瑞医药	12,361,910.46	2.44
57	000739	普洛药业	12,212,215.02	2.41
58	000799	酒鬼酒	12,176,051.92	2.41
59	600399	抚顺特钢	12,073,904.00	2.39
60	300767	震安科技	12,038,037.26	2.38
61	603596	伯特利	11,844,901.19	2.34
62	601689	拓普集团	11,725,586.55	2.32
63	002434	万里扬	11,704,022.00	2.31
64	300058	蓝色光标	11,348,333.97	2.24
65	688677	海泰新光	11,202,035.20	2.21
66	002483	润邦股份	11,036,505.00	2.18
67	600986	浙文互联	11,004,965.00	2.18
68	002897	意华股份	10,988,123.74	2.17
69	300373	扬杰科技	10,985,593.00	2.17
70	000707	双环科技	10,915,770.00	2.16
71	603338	浙江鼎力	10,708,452.24	2.12
72	688595	芯海科技	10,625,740.51	2.10
73	000683	远兴能源	10,510,743.50	2.08
74	300696	爱乐达	10,417,761.50	2.06
75	600702	舍得酒业	10,219,665.70	2.02

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	002291	星期六	39,260,835.30	7.76
2	002101	广东鸿图	34,028,108.50	6.73
3	002603	以岭药业	32,434,293.71	6.41
4	002056	横店东磁	31,086,058.03	6.14
5	300395	菲利华	29,835,566.26	5.90
6	002176	江特电机	28,326,399.43	5.60
7	600141	兴发集团	28,261,258.59	5.59
8	688556	高测股份	25,824,779.04	5.10
9	300438	鹏辉能源	25,700,117.00	5.08
10	688533	上声电子	24,895,876.59	4.92
11	300529	健帆生物	22,119,300.21	4.37
12	300820	英杰电气	21,904,152.00	4.33
13	600389	江山股份	21,752,909.00	4.30
14	002317	众生药业	21,306,636.28	4.21
15	600499	科达制造	21,251,154.30	4.20
16	000822	山东海化	20,526,721.00	4.06
17	002810	山东赫达	20,413,519.00	4.03
18	002594	比亚迪	19,918,709.00	3.94
19	000408	藏格矿业	19,616,606.00	3.88
20	301117	佳缘科技	19,603,142.77	3.87
21	601058	赛轮轮胎	19,133,112.87	3.78
22	000661	长春高新	18,828,074.01	3.72
23	600522	中天科技	18,723,737.57	3.70
24	002245	蔚蓝锂芯	18,693,766.00	3.69
25	300568	星源材质	18,536,270.38	3.66
26	688499	利元亨	18,454,582.76	3.65
27	300373	扬杰科技	18,364,986.33	3.63
28	300034	钢研高纳	17,964,980.00	3.55
29	600456	宝钛股份	17,223,533.00	3.40
30	002624	完美世界	17,037,071.00	3.37
31	300841	康华生物	16,326,710.00	3.23
32	002906	华阳集团	16,168,295.56	3.20
33	600596	新安股份	15,676,242.48	3.10
34	600460	士兰微	15,518,612.19	3.07
35	688166	博瑞医药	15,203,633.68	3.00
36	688099	晶晨股份	15,196,591.93	3.00
37	688518	联赢激光	15,154,793.45	3.00
38	002531	天顺风能	14,807,320.00	2.93
39	002555	三七互娱	14,671,673.00	2.90
40	002192	融捷股份	14,558,486.00	2.88
41	002011	盾安环境	14,453,366.00	2.86
42	688408	中信博	13,869,477.57	2.74

43	603363	傲农生物	13,860,453.00	2.74
44	603198	迎驾贡酒	13,708,221.75	2.71
45	300775	三角防务	13,664,770.00	2.70
46	000519	中兵红箭	13,587,445.00	2.69
47	603477	巨星农牧	13,385,403.00	2.65
48	301071	力量钻石	13,239,473.00	2.62
49	300879	大叶股份	13,031,769.93	2.58
50	688208	道通科技	13,022,879.13	2.57
51	300203	聚光科技	12,730,497.00	2.52
52	300432	富临精工	12,678,345.25	2.51
53	300413	芒果超媒	12,675,594.96	2.51
54	300054	鼎龙股份	12,610,705.00	2.49
55	300595	欧普康视	12,411,227.00	2.45
56	600223	鲁商发展	12,181,300.00	2.41
57	000739	普洛药业	11,969,983.00	2.37
58	601238	广汽集团	11,950,934.00	2.36
59	600557	康缘药业	11,907,617.88	2.35
60	605117	德业股份	11,835,142.00	2.34
61	603596	伯特利	11,806,460.00	2.33
62	300457	赢合科技	11,749,889.90	2.32
63	601689	拓普集团	11,628,811.53	2.30
64	605168	三人行	11,623,291.31	2.30
65	600986	浙文互联	11,615,199.00	2.30
66	300447	全信股份	11,570,491.00	2.29
67	002453	华软科技	11,560,185.00	2.28
68	688677	海泰新光	11,512,582.88	2.28
69	002241	歌尔股份	11,373,495.00	2.25
70	002824	和胜股份	11,337,552.50	2.24
71	300767	震安科技	11,337,289.33	2.24
72	002434	万里扬	11,270,233.71	2.23
73	300058	蓝色光标	11,240,504.00	2.22
74	000799	酒鬼酒	11,165,037.64	2.21
75	002140	东华科技	11,036,016.10	2.18
76	002487	大金重工	10,989,648.00	2.17
77	000887	中鼎股份	10,670,340.00	2.11
78	000683	远兴能源	10,662,531.00	2.11
79	605218	伟时电子	10,626,861.00	2.10
80	000707	双环科技	10,623,315.00	2.10
81	688187	时代电气	10,608,436.94	2.10
82	603662	柯力传感	10,531,552.84	2.08
83	002139	拓邦股份	10,488,870.00	2.07
84	002483	润邦股份	10,406,450.00	2.06

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	2,168,614,952.82
卖出股票收入（成交）总额	2,198,598,904.83

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 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	360,213.04
2	应收清算款	-
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	360,213.04

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

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 (%)
5,361	43,918.20	20,019,600.00	8.50	215,425,868.54	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	20,004,500.00	8.50
2	熊海涛	7,154,647.58	3.04
3	吴宇婷	3,467,854.37	1.47
4	张恩光	2,989,802.81	1.27
5	王喜艳	2,989,529.63	1.27
6	余诗慧	2,986,523.24	1.27
7	余卫华	1,992,571.87	0.85
8	邝立群	1,992,481.87	0.85
9	叶树明	1,992,481.87	0.85

10	郭东荣	1,992,481.87	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	-
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

经本公司股东决定，任命阮菲女士、刘习军先生为本公司第三届董事会董事，任命田军先生、杨光裕先生、钱世政先生为本公司第三届董事会独立董事。本公司于 2022 年 5 月 18 日召开第三届董事会第一次会议，宣布自 2022 年 5 月 18 日起，本公司董事由乔旭东先生变更为刘习军先生，独立董事由曹泉伟先生、王晓东先生、刘杰生先生变更为田军先生、杨光裕先生、钱世政先生。阮菲女士、冀洪涛先生继续担任本公司董事。2022 年 5 月 20 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董事变更的公告》。

2022 年 5 月 25 日，经公司第二届董事会第二十次会议审议通过，同意聘任殷喆先生为公司督察长；同意原督察长张洗尘先生退休离任，同意免去张洗尘先生督察长职务且不再担任公司其他任何职务或岗位。2022 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高级管理人员变更的公告》。

本报告期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，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	1,886,886,561.70	43.34	1,351,216.38	43.35	-
长江证券	1	1,214,303,919.27	27.89	871,990.32	27.97	-
广发证券	1	502,557,029.38	11.54	357,467.96	11.47	-
中泰证券	1	452,225,213.91	10.39	324,866.43	10.42	-
中国国际金融股份有限公司	1	297,433,147.84	6.83	211,566.19	6.79	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际 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

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使用固有资金购买本公司旗下公募基金的公告	证券时报、公司官网	2022 年 1 月 29 日
2	红土创新基金管理有限公司关于终止前海凯恩斯基金办理本公司旗下基金销售业务的提示	公司官网	2022 年 4 月 22 日
3	红土创新基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	证券时报、公司官网	2022 年 4 月 26 日
4	红土创新基金管理有限公司关于终止唐鼎耀华基金销售机构办理本公司旗下基金销售业务的提示	证券时报、公司官网	2022 年 4 月 28 日
5	红土创新基金管理有限公司关于董事变更的公告	证券时报、公司官网	2022 年 5 月 20 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、公司官网	2022 年 5 月 26 日
7	红土创新基金管理有限公司关于旗下基金新增度小满为销售机构的公告	公司官网	2022 年 5 月 27 日
8	红土创新基金管理有限公司关于旗下基金新增泰信财富基金为销售机构的公告	公司官网	2022 年 6 月 10 日
9	红土创新基金管理有限公司关于旗下基金新增华泰期货为销售机构的公告	公司官网	2022 年 6 月 21 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

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

2022 年 8 月 31 日