

# 红土创新新兴产业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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>10</b>
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>10</b>
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
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53

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.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	57
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>58</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## § 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	174,945,783.20 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	李申
	联系电话	0755-33011858	021-60637102
	电子邮箱	yinz@htcfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		0755-33011866	021-60637111
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		深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 楼	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	田国立

## 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.htxfund.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	-24,642,567.11
本期利润	-8,631,497.37
加权平均基金份额本期利润	-0.0472
本期加权平均净值利润率	-2.83%
本期基金份额净值增长率	-1.58%
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	116,420,818.17
期末可供分配基金份额利润	0.6655
期末基金资产净值	337,685,317.65
期末基金份额净值	1.930
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	93.00%

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

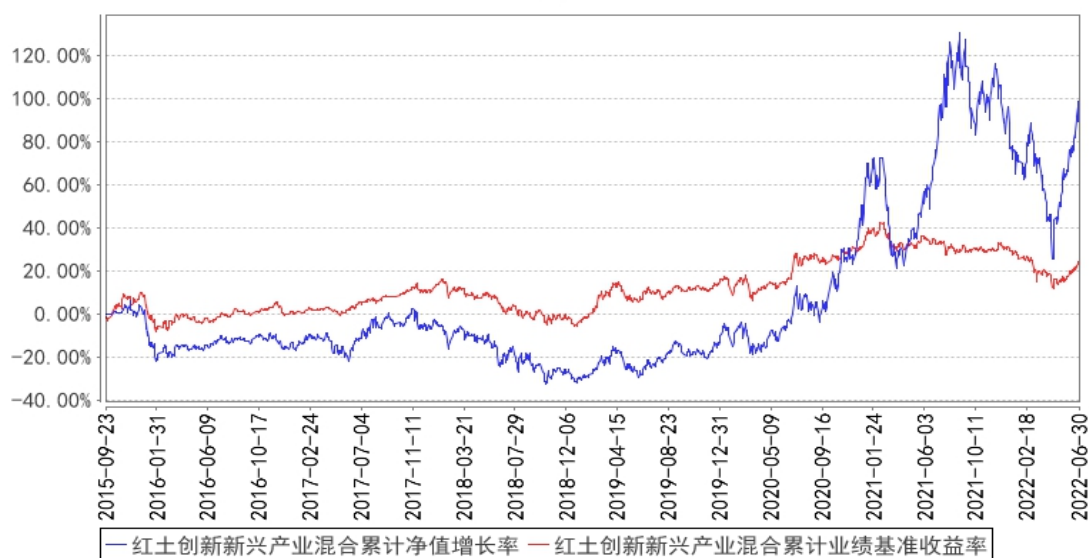
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	15.71%	1.96%	5.57%	0.64%	10.14%	1.32%
过去三个月	22.85%	2.43%	3.94%	0.86%	18.91%	1.57%
过去六个月	-1.58%	2.40%	-5.29%	0.87%	3.71%	1.53%
过去一年	9.66%	2.52%	-7.73%	0.75%	17.39%	1.77%
过去三年	153.61%	2.17%	12.58%	0.76%	141.03%	1.41%
自基金合同生效起至今	93.00%	1.78%	24.06%	0.76%	68.94%	1.02%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

红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 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		
石炯	本基金的基金经理	2020 年 7 月 8 日	-	8 年	暨南大学金融学硕士。曾任中国中投证券机械行业研究员，东吴证券机械军工行业研究员，红土创新基金智能制造行业研究员，现任红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、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 个月定期开放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《证券业从业人员资格管理办法》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

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

2022 年上半年，上证综指下跌 6.63%，创业板指数下跌 15.41%，沪深 300 指数下跌 9.22%。板块方面，煤炭、消费者服务、交运、地产等稳增长/疫情复苏链条涨幅靠前，TMT、军工等成长性行业跌幅较多；新兴产业产品主要配置为电动车、光伏等成长性行业，上半年下跌 1.58%。

一季度，市场短期博弈稳增长/疫情复苏等方向，资金有限的存量博弈市场下，成长类行业较为承压。二季度，随着美联储加息逐步落地，市场开始逐步交易海外衰退加息放缓，全球流动性预期较此前放松。4 月底成长股上修的基本面与资金博弈下较低估值，相比中长期成长潜力弱而短期估值透支的稳增长/疫情复苏性价比加快提升，基本面较好的成长板块如新能源等二季度如期反弹修复。

#### 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 1.930 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.58%，业绩比较基准收益率为-5.29%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中长期，我们仍较看好新能源汽车、光伏等行业的持续成长性。市场此前对于新能源车涨价影响需求的质疑也逐步被订单销量打消，新能源车作为一种 ToC 消费品，具强品牌力的车企在终端涨价后依然展现出较强的消费者认可度及需求韧性。而光伏行业，在国内风光大基地加持、户用爆发，海外俄乌战争促进欧洲新能源需求提升的背景下，行业短中长期高成长的确性较强。虽然二季度新能源车、光伏已有一定的估值修复，但展望下半年，新能源汽车、光伏、风电等景气行业将逐步进入销量/装机旺季，相关细分行业下半年、明年业绩仍有上修的空间。我们仍能从业绩上修、估值切换上看到未来的空间。我们也会努力在新兴产业的其他方向如智能车、AR/VR、军工等寻找更多性价比高的投资机会。

#### 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，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：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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	20,363,869.45	29,401,059.49
结算备付金		2,905,595.63	2,147,434.58
存出保证金		249,946.72	298,447.07
交易性金融资产	6.4.7.2	317,541,116.26	341,479,056.86
其中：股票投资		317,541,116.26	341,479,056.86
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		1,674,611.47	610,350.31
应收股利		-	-
应收申购款		1,560,695.88	196,793.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	3,662.48
资产总计		344,295,835.41	374,136,804.63
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		277,464.04	5,460,163.43
应付赎回款		4,470,184.42	7,250,040.50
应付管理人报酬		396,975.09	459,668.73
应付托管费		66,162.52	76,611.46
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	1,399,731.69	1,286,902.42
负债合计		6,610,517.76	14,533,386.54
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	174,945,783.20	183,340,745.05
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	162,739,534.45	176,262,673.04
净资产合计		337,685,317.65	359,603,418.09
负债和净资产总计		344,295,835.41	374,136,804.63

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 2022 年 06 月 30 日止。报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.930 元，基金份额总额 174,945,783.20 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：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
<b>一、营业总收入</b>		-5,897,647.95	55,388,893.13
1. 利息收入		45,887.37	94,370.85
其中：存款利息收入	6.4.7.13	45,887.37	94,370.85
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-22,343,829.50	5,912,183.96
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-23,387,790.24	5,155,031.69
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	-	-
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	1,043,960.74	757,152.27
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	16,011,069.74	46,495,232.18
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	389,224.44	2,887,106.14
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2,733,849.42</b>	<b>13,535,758.26</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,266,597.96	2,785,940.33
2. 托管费	6.4.10.2.2	377,766.31	464,323.46
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	89,485.15	10,285,494.47
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-8,631,497.37</b>	<b>41,853,134.87</b>
减：所得税费用			-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-8,631,497.37</b>	<b>41,853,134.87</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>			-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-8,631,497.37</b>	<b>41,853,134.87</b>

### 6.3 净资产（基金净值）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：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）	183,340,745.05	-	176,262,673.04	359,603,418.09
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）	183,340,745.05	-	176,262,673.04	359,603,418.09
三、本 期 增 减 变 动 额（减 少 以“-” 号 填 列）	-8,394,961.85	-	-13,523,138.59	-21,918,100.44
（一）、 综 合 收 益 总 额	-	-	-8,631,497.37	-8,631,497.37
（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）	-8,394,961.85	-	-4,891,641.22	-13,286,603.07
其中：1. 基 金 申 购 款	55,377,003.02	-	38,105,248.86	93,482,251.88
2. 基 金 赎 回 款	-63,771,964.87	-	-42,996,890.08	-106,768,854.95
（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	174,945,783.20	-	162,739,534.45	337,685,317.65

产（基金净值）				
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）	184,267,510.92	-	92,870,948.42	277,138,459.34
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）	184,267,510.92	-	92,870,948.42	277,138,459.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	22,514,393.06	-	64,195,503.90	86,709,896.96
（一）、综合收益总额	-	-	41,853,134.87	41,853,134.87
（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）	22,514,393.06	-	22,342,369.03	44,856,762.09
其中：1. 基金申购款	344,903,892.38	-	205,438,639.23	550,342,531.61
2. 基金赎回款	-322,389,499.32	-	-183,096,270.20	-505,485,769.52
（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、本期末净资产（基金净值）	206,781,903.98	-	157,066,452.32	363,848,356.30

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



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 $\times$ 60%+中证全债指数收益率 $\times$ 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止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业务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业务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。

## (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。

### 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。

#### 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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

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。

#### 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。

## 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、应收证券清算款和应收申购款,金额分别为 29,401,059.49 元、2,147,434.58 元、298,447.07 元、3,662.48 元、610,350.31 元和 196,793.84 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、应收清算款和应收申购款,金额

分别为 29,403,512.63 元、2,148,496.19 元、298,594.80 元、0.00 元、610,350.31 元和 196,793.84 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 341,479,056.86 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 341,479,056.86 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、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 5,460,163.43 元、7,250,040.50 元、459,668.73 元、76,611.46 元、1,094,822.44 元和 12,079.98 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、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 5,460,163.43 元、7,250,040.50 元、459,668.73 元、76,611.46 元、1,094,822.44 元和 12,079.98 元。

i) 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”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。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”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”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

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 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	20,363,869.45
等于：本金	20,361,961.06
加：应计利息	1,908.39

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	20,363,869.45

#### 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	274,588,312.84	-	317,541,116.26	42,952,803.42
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	274,588,312.84	-	317,541,116.26	42,952,803.42

#### 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

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

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 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10,129.38
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,240,342.16
其中：交易所市场	1,240,342.16
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	149,260.15
合计	1,399,731.69

6.4.7.10 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	183,340,745.05	183,340,745.05
本期申购	55,377,003.02	55,377,003.02
本期赎回（以“-”号填列）	-63,771,964.87	-63,771,964.87
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	174,945,783.20	174,945,783.20



注：申购含红利再投、级别调整入份额。赎回含级别调整出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

#### 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
本期期初	145,324,926.51	30,937,746.53	176,262,673.04
本期利润	-24,642,567.11	16,011,069.74	-8,631,497.37
本期基金份额交易产生的变动数	-4,261,541.23	-630,099.99	-4,891,641.22
其中：基金申购款	35,449,226.13	2,656,022.73	38,105,248.86
基金赎回款	-39,710,767.36	-3,286,122.72	-42,996,890.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	116,420,818.17	46,318,716.28	162,739,534.45

#### 6.4.7.13 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	29,731.71
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	14,044.81
其他	2,110.85
合计	45,887.37

#### 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 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	-23,387,790.24
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	-23,387,790.24

##### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	1,331,558,648.67
减：卖出股票成本总额	1,351,470,747.68

减：交易费用	3,475,691.23
买卖股票差价收入	-23,387,790.24

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

6.4.7.19 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	1,043,960.74
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	1,043,960.74

## 6.4.7.20 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	16,011,069.74
股票投资	16,011,069.74
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	16,011,069.74

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	388,751.51
基金转换费收入	472.93
合计	389,224.44

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

## 6.4.7.23 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	225.00
合计	89,485.15

## 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

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”）	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、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：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 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	2,266,597.96	2,785,940.33
其中：支付销售机构的客户维护费	662,840.77	939,331.93

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 1.50% 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	377,766.31	464,323.46

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 0.25% 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 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

##### 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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

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（2015 年 9 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	3,032,490.97	12,032,490.97
报告期间申购/买入总份额	3,460,616.85	-
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	6,493,107.82	12,032,490.97

报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	3.7100%	5.8200%
-------------------------	---------	---------

注：无。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	28.6200	50,060,750.00	27.3000

#### 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 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
建设银行	20,363,869.45	29,731.71	23,483,539.65	38,295.01

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(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	233	12,947.81	6,996.99	-
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	362	14,436.56	11,254.58	-

301103	何氏眼科	2022年 3月14日	6个月	创业板 新股锁 定	32.64	32.02	362	11,815.00	11,591.24	-
301109	军信股份	2022年 4月6日	6个月	创业板 新股锁 定	23.19	16.14	755	17,509.43	12,185.70	-
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	180	11,358.00	7,173.00	-
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	251	12,627.81	17,662.87	-
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	3,786	145,609.56	145,609.56	-
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	400	15,356.00	9,560.00	-
301150	中一科技	2022年 4月14日	6个月	创业板 新股锁 定	109.04	82.76	120	13,084.80	9,931.20	-
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	323	10,878.64	14,205.54	-
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	-

		日		定							
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	748	15,954.84	16,859.92	-	
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	130	8,330.40	4,877.60	-	
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	212	16,230.72	11,007.04	-	
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	212	15,410.28	15,166.48	-	
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	184	10,465.92	10,381.28	-	
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	3,947	14,998.60	25,221.33	-	
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	364	12,987.52	10,861.76	-	
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	1,120	19,342.40	16,609.60	-	
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	324	11,009.52	9,383.04	-	
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	222	12,585.18	9,292.92	-	
301238	瑞泰	2022年	6个月	创业板	19.18	32.07	895	17,166.10	28,702.65	-	



	新材	6月10日		新股锁定							
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	401	15,667.07	11,977.87		-
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	1,538	12,380.90	15,503.04		-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	创业板新股锁定	48.30	41.68	225	10,867.50	9,378.00		-
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	307	15,973.21	17,320.94		-
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		-
688262	国芯科技	-	个月	非公开发行流通受限	41.98	47.75	3,404	142,899.92	162,541.00		-
688282	理工导航	2022年3月10日	6个月	非公开发行流通受限	65.21	45.37	2,401	156,569.21	108,933.37		-
688349	三一重能	2022年6月15日	6个月	非公开发行流通受限	29.80	36.94	6,007	179,008.60	221,898.58		-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	5,877	128,882.61	128,882.61		-

#### 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

## 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。

本报告期，本基金未持有交易性债券投资。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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 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	20,363,869.45	-	-	-	20,363,869.45
结算备付金	2,905,595.63	-	-	-	2,905,595.63
存出保证金	249,946.72	-	-	-	249,946.72
交易性金融资产	-	-	-	-317,541,116.26	317,541,116.26
应收申购款	-	-	-	1,560,695.88	1,560,695.88
应收清算款	-	-	-	1,674,611.47	1,674,611.47
资产总计	23,519,411.80	-	-	-320,776,423.61	344,295,835.41
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,470,184.42	4,470,184.42
应付管理人报酬	-	-	-	396,975.09	396,975.09
应付托管费	-	-	-	66,162.52	66,162.52
应付清算款	-	-	-	277,464.04	277,464.04
其他负债	-	-	-	1,399,731.69	1,399,731.69
负债总计	-	-	-	6,610,517.76	6,610,517.76
利率敏感度缺口	23,519,411.80	-	-	-314,165,905.85	337,685,317.65
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	29,401,059.49	-	-	-	29,401,059.49
结算备付金	2,147,434.58	-	-	-	2,147,434.58
存出保证金	298,447.07	-	-	-	298,447.07
交易性金融资产	-	-	-	-341,479,056.86	341,479,056.86
应收利息	-	-	-	3,662.48	3,662.48
应收申购款	-	-	-	196,793.84	196,793.84
应收证券清算款	-	-	-	610,350.31	610,350.31
资产总计	31,846,941.14	-	-	-342,289,863.49	374,136,804.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,250,040.50	7,250,040.50
应付管理人报酬	-	-	-	459,668.73	459,668.73
应付托管费	-	-	-	76,611.46	76,611.46
应付证券清算款	-	-	-	5,460,163.43	5,460,163.43
应付交易费用	-	-	-	1,094,822.44	1,094,822.44
其他负债	-	-	-	192,079.98	192,079.98
负债总计	-	-	-	14,533,386.54	14,533,386.54
利率敏感度缺口	31,846,941.14	-	-	-327,756,476.95	359,603,418.09

注：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

#### 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。本基金股票、存托凭证资产占基金资产的0%–95%。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	317,541,116.26	94.03	341,479,056.86	94.96
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	317,541,116.26	94.03	341,479,056.86	94.96

#### 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		
	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. 沪深 300 指数上升 5%	19,122,404.49	16,092,853.93
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-19,122,404.49	-16,092,853.93

#### 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	314,886,413.55	332,375,901.56
第二层次	2,654,702.71	9,103,155.30
第三层次	-	-

合计	317,541,116.26	341,479,056.86
----	----------------	----------------

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	317,541,116.26	92.23
	其中：股票	317,541,116.26	92.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	23,269,465.08	6.76
8	其他各项资产	3,485,254.07	1.01
9	合计	344,295,835.41	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	175,879.90	0.05
B	采矿业	16,753,503.83	4.96
C	制造业	279,503,998.73	82.77



D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	172,260.27	0.05
E	建筑业	429,851.38	0.13
F	批发和零售业	402,756.92	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	64,049.49	0.02
H	住宿和餐饮业	148,942.32	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,197,351.96	0.65
J	金融业	173,266.19	0.05
K	房地产业	15,851.52	0.00
L	租赁和商务服务业	153,699.93	0.05
M	科学研究和技术服务业	834,531.75	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	16,374,223.59	4.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	19,651.90	0.01
Q	卫生和社会工作	32,147.98	0.01
R	文化、体育和娱乐业	89,148.60	0.03
S	综合	-	-
	合计	317,541,116.26	94.03

### 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	601012	隆基绿能	462,960	30,847,024.80	9.13
2	002466	天齐锂业	238,500	29,764,800.00	8.81
3	605117	德业股份	98,720	27,630,740.80	8.18
4	002459	晶澳科技	285,048	22,490,287.20	6.66
5	002594	比亚迪	58,400	19,475,816.00	5.77
6	002176	江特电机	750,945	18,803,662.80	5.57
7	002756	永兴材料	110,644	16,841,123.24	4.99
8	002192	融捷股份	99,200	15,247,040.00	4.52
9	000625	长安汽车	797,382	13,810,656.24	4.09
10	000408	藏格矿业	402,340	13,253,079.60	3.92
11	688156	路德环境	505,184	10,775,574.72	3.19
12	600884	杉杉股份	306,400	9,106,208.00	2.70
13	002129	TCL 中环	146,300	8,615,607.00	2.55
14	688320	禾川科技	154,606	7,977,669.60	2.36
15	300457	赢合科技	257,300	7,309,893.00	2.16
16	688348	昱能科技	14,017	6,840,296.00	2.03

17	300450	先导智能	91,600	5,787,288.00	1.71
18	600323	瀚蓝环境	253,350	5,193,675.00	1.54
19	002709	天赐材料	79,150	4,912,049.00	1.45
20	300763	锦浪科技	17,200	3,663,600.00	1.08
21	688599	天合光能	55,910	3,648,127.50	1.08
22	300274	阳光电源	36,000	3,537,000.00	1.05
23	300390	天华超净	40,300	3,522,220.00	1.04
24	002240	盛新锂能	56,000	3,380,160.00	1.00
25	301266	宇邦新材	35,861	1,969,315.51	0.58
26	300699	光威复材	28,600	1,683,682.00	0.50
27	600938	中国海油	84,805	1,346,280.89	0.40
28	300750	宁德时代	1,400	747,600.00	0.22
29	688235	百济神州	3,843	381,725.19	0.11
30	688297	中无人机	6,704	356,518.72	0.11
31	688170	德龙激光	6,175	317,889.00	0.09
32	300712	永福股份	5,250	301,035.00	0.09
33	688083	中望软件	1,341	280,832.22	0.08
34	688248	南网科技	11,763	271,960.56	0.08
35	601238	广汽集团	17,804	271,332.96	0.08
36	688120	华海清科	1,085	269,514.00	0.08
37	600418	江淮汽车	15,000	257,400.00	0.08
38	300415	伊之密	14,100	257,043.00	0.08
39	688046	药康生物	8,378	245,475.40	0.07
40	300443	金雷股份	5,300	241,574.00	0.07
41	000400	许继电气	12,500	240,000.00	0.07
42	688408	中信博	2,528	233,789.44	0.07
43	002531	天顺风能	13,800	227,562.00	0.07
44	688279	峰岬科技	3,028	223,829.76	0.07
45	300850	新强联	2,500	222,575.00	0.07
46	688349	三一重能	6,007	221,898.58	0.07
47	301162	国能日新	3,331	201,609.02	0.06
48	300745	欣锐科技	3,800	189,544.00	0.06
49	301302	华如科技	3,065	186,496.66	0.06
50	301120	新特电气	10,311	182,450.94	0.05
51	601633	长城汽车	4,800	177,792.00	0.05
52	301286	侨源股份	7,839	176,722.11	0.05
53	688001	华兴源创	6,474	176,222.28	0.05
54	002074	国轩高科	3,800	173,280.00	0.05
55	300498	温氏股份	8,000	170,320.00	0.05
56	688209	英集芯	5,549	169,799.40	0.05
57	301160	翔楼新材	3,918	166,768.58	0.05
58	000792	盐湖股份	5,500	164,780.00	0.05

59	688262	国芯科技	3,404	162,541.00	0.05
60	300724	捷佳伟创	1,800	160,830.00	0.05
61	688290	景业智能	3,040	154,736.00	0.05
62	300681	英搏尔	2,660	153,668.20	0.05
63	301073	君亭酒店	2,148	148,942.32	0.04
64	301139	元道通信	3,786	145,609.56	0.04
65	300432	富临精工	6,609	145,398.00	0.04
66	688325	赛微微电	2,326	142,351.20	0.04
67	688059	华锐精密	1,023	141,153.54	0.04
68	688125	安达智能	2,893	137,533.22	0.04
69	600988	赤峰黄金	8,400	133,980.00	0.04
70	688234	天岳先进	1,980	132,660.00	0.04
71	301248	杰创智能	4,009	130,103.79	0.04
72	688400	凌云光	5,877	128,882.61	0.04
73	301109	军信股份	7,533	128,292.84	0.04
74	603338	浙江鼎力	2,500	126,750.00	0.04
75	688153	唯捷创芯	2,420	123,420.00	0.04
76	301199	迈赫股份	3,831	122,745.24	0.04
77	600483	福能股份	8,700	122,409.00	0.04
78	300558	贝达药业	2,000	121,600.00	0.04
79	301102	兆讯传媒	3,619	119,517.26	0.04
80	300911	亿田智能	1,541	118,425.85	0.04
81	601877	正泰电器	3,300	118,074.00	0.03
82	300115	长盈精密	11,400	117,534.00	0.03
83	688007	光峰科技	4,766	115,813.80	0.03
84	603583	捷昌驱动	3,464	115,662.96	0.03
85	600297	广汇汽车	44,000	114,840.00	0.03
86	301200	大族数控	2,113	113,661.04	0.03
87	688663	新风光	3,279	111,387.63	0.03
88	688230	芯导科技	1,597	111,294.93	0.03
89	688282	理工导航	2,401	108,933.37	0.03
90	301150	中一科技	1,198	108,880.82	0.03
91	301207	华兰疫苗	1,839	108,704.83	0.03
92	688259	创耀科技	1,329	107,077.53	0.03
93	688151	华强科技	4,405	105,147.35	0.03
94	688265	南模生物	1,622	103,856.66	0.03
95	301111	粤万年青	3,783	103,729.86	0.03
96	002738	中矿资源	1,120	103,723.20	0.03
97	301148	嘉戎技术	3,993	103,337.30	0.03
98	301125	腾亚精工	3,270	101,023.38	0.03
99	301096	百诚医药	1,255	99,145.00	0.03
100	301190	善水科技	4,154	98,574.42	0.03

101	688553	汇宇制药	4,017	97,572.93	0.03
102	601825	沪农商行	15,480	97,059.60	0.03
103	301048	金鹰重工	8,424	92,748.24	0.03
104	002487	大金重工	2,200	91,806.00	0.03
105	300207	欣旺达	2,900	91,640.00	0.03
106	688121	卓然股份	3,681	89,485.11	0.03
107	300774	倍杰特	4,435	89,409.60	0.03
108	688227	品高股份	4,164	89,192.88	0.03
109	688225	亚信安全	3,947	88,491.74	0.03
110	688697	纽威数控	5,837	88,372.18	0.03
111	688163	赛伦生物	3,366	83,813.40	0.02
112	301092	争光股份	2,643	83,148.78	0.02
113	301181	标榜股份	2,564	81,939.40	0.02
114	688103	国力股份	1,595	81,536.40	0.02
115	688613	奥精医疗	2,617	80,969.98	0.02
116	301166	优宁维	1,348	79,343.28	0.02
117	600389	江山股份	1,300	78,949.00	0.02
118	301179	泽宇智能	1,901	77,579.81	0.02
119	688737	中自科技	1,874	77,452.42	0.02
120	002241	歌尔股份	2,300	77,280.00	0.02
121	301110	青木股份	1,793	77,015.90	0.02
122	301198	喜悦智行	3,397	76,602.35	0.02
123	688036	传音控股	851	75,934.73	0.02
124	301238	瑞泰新材	2,143	75,664.89	0.02
125	688236	春立医疗	3,767	74,586.60	0.02
126	301098	金埔园林	3,069	74,423.25	0.02
127	688678	福立旺	2,928	74,283.36	0.02
128	301040	中环海陆	2,401	73,302.53	0.02
129	301038	深水规院	3,458	71,891.82	0.02
130	688115	思林杰	1,766	71,063.84	0.02
131	300834	星辉环材	2,327	70,361.43	0.02
132	301182	凯旺科技	2,932	69,664.32	0.02
133	301093	华兰股份	2,044	69,271.16	0.02
134	301189	奥尼电子	2,075	69,118.25	0.02
135	688786	悦安新材	1,513	68,992.80	0.02
136	300251	光线传媒	7,200	68,184.00	0.02
137	600276	恒瑞医药	1,800	66,762.00	0.02
138	603997	继峰股份	6,100	66,368.00	0.02
139	688171	纬德信息	2,821	66,152.45	0.02
140	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
141	301108	洁雅股份	1,568	62,045.76	0.02
142	301062	上海艾录	5,225	60,975.75	0.02

143	300814	中富电路	3,280	60,024.00	0.02
144	300957	贝泰妮	272	59,168.16	0.02
145	301088	戎美股份	3,127	58,349.82	0.02
146	301083	百胜智能	4,160	58,073.60	0.02
147	301072	中捷精工	1,802	57,718.06	0.02
148	001270	铖昌科技	568	57,481.60	0.02
149	688296	和达科技	2,173	57,041.25	0.02
150	601127	赛力斯	700	56,763.00	0.02
151	688787	海天瑞声	817	56,658.95	0.02
152	688187	时代电气	863	56,086.37	0.02
153	688511	天微电子	1,490	55,785.60	0.02
154	688718	唯赛勃	3,145	55,414.90	0.02
155	301057	汇隆新材	2,173	52,912.55	0.02
156	688255	凯尔达	1,648	50,923.20	0.02
157	301056	森赫股份	5,716	49,500.56	0.01
158	301196	唯科科技	1,298	49,098.08	0.01
159	600955	维远股份	1,694	48,854.96	0.01
160	600522	中天科技	2,100	48,510.00	0.01
161	688618	三旺通信	1,117	47,293.78	0.01
162	301036	双乐股份	2,047	46,016.56	0.01
163	002460	赣锋锂业	300	44,610.00	0.01
164	301059	金三江	2,581	43,360.80	0.01
165	605589	圣泉集团	1,750	43,172.50	0.01
166	301063	海锅股份	1,524	42,458.64	0.01
167	301041	金百泽	2,150	42,376.50	0.01
168	688622	禾信仪器	1,204	41,200.88	0.01
169	001227	兰州银行	7,868	38,710.56	0.01
170	600927	永安期货	1,859	37,496.03	0.01
171	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
172	301050	雷电微力	347	35,241.32	0.01
173	301068	大地海洋	1,436	34,679.40	0.01
174	301079	邵阳液压	1,396	34,620.80	0.01
175	300953	震裕科技	240	32,877.60	0.01
176	301155	海力风电	340	30,940.00	0.01
177	603197	保隆科技	600	29,514.00	0.01
178	603071	物产环能	1,627	29,513.78	0.01
179	605507	国邦医药	1,202	29,028.30	0.01
180	001213	中铁特货	5,818	28,566.38	0.01
181	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.01
182	688701	卓锦股份	2,340	27,658.80	0.01
183	301089	拓新药业	220	27,636.40	0.01
184	603122	合富中国	2,198	27,365.10	0.01

185	001318	阳光乳业	1,142	25,249.62	0.01
186	301215	中汽股份	3,947	25,221.33	0.01
187	600935	华塑股份	4,811	25,209.64	0.01
188	300973	立高食品	240	24,948.00	0.01
189	301069	凯盛新材	539	24,853.29	0.01
190	605286	同力日升	597	24,148.65	0.01
191	605080	浙江自然	374	23,894.86	0.01
192	605555	德昌股份	917	23,355.99	0.01
193	603206	嘉环科技	1,210	23,353.00	0.01
194	003038	鑫铂股份	460	23,184.00	0.01
195	001208	华菱线缆	1,754	21,784.68	0.01
196	603051	鹿山新材	272	21,488.00	0.01
197	605020	永和股份	850	20,927.00	0.01
198	001228	永泰运	383	20,739.45	0.01
199	301060	兰卫医学	587	20,556.74	0.01
200	301018	申菱环境	782	20,183.42	0.01
201	301153	中科江南	428	19,475.49	0.01
202	001308	康冠科技	667	19,456.39	0.01
203	301101	明月镜片	371	19,043.43	0.01
204	605016	百龙创园	445	18,698.90	0.01
205	301149	隆华新材	1,214	18,586.34	0.01
206	603176	汇通集团	1,924	18,393.44	0.01
207	301122	采纳股份	251	17,662.87	0.01
208	603132	金徽股份	1,342	17,325.22	0.01
209	605208	永茂泰	1,081	17,112.23	0.01
210	301187	欧圣电气	748	16,859.92	0.00
211	001212	中旗新材	400	16,852.00	0.00
212	001217	华尔泰	1,239	16,776.06	0.00
213	301217	铜冠铜箔	1,120	16,609.60	0.00
214	001215	千味央厨	295	16,605.55	0.00
215	603070	万控智造	775	16,197.50	0.00
216	301039	中集车辆	1,480	16,028.40	0.00
217	605060	联德股份	883	16,026.45	0.00
218	300917	特发服务	512	15,851.52	0.00
219	301090	华润材料	1,427	15,568.57	0.00
220	301256	华融化学	1,538	15,503.04	0.00
221	001319	铭科精技	536	15,474.32	0.00
222	301127	天源环保	1,386	15,426.18	0.00
223	001317	三羊马	300	15,222.00	0.00
224	301177	迪阿股份	205	15,211.00	0.00
225	301201	诚达药业	212	15,166.48	0.00
226	001216	华瓷股份	1,178	15,137.30	0.00

227	001313	粤海饲料	1,232	15,104.32	0.00
228	003029	吉大正元	716	14,534.80	0.00
229	605277	新亚电子	705	14,431.35	0.00
230	300930	屹通新材	400	14,368.00	0.00
231	605183	确成股份	741	14,301.30	0.00
232	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
233	603230	内蒙新华	1,140	14,261.40	0.00
234	605133	嵘泰股份	618	14,139.84	0.00
235	300925	法本信息	1,168	13,957.60	0.00
236	300994	久祺股份	420	13,780.20	0.00
237	301087	可孚医疗	322	13,730.08	0.00
238	601279	英利汽车	2,004	13,687.32	0.00
239	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.00
240	603209	兴通股份	595	13,518.40	0.00
241	603836	海程邦达	733	13,443.22	0.00
242	003030	祖名股份	480	13,324.80	0.00
243	605179	一鸣食品	939	13,277.46	0.00
244	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
245	605151	西上海	722	12,822.72	0.00
246	003025	思进智能	616	12,745.04	0.00
247	300941	创识科技	598	12,587.90	0.00
248	603216	梦天家居	772	12,498.68	0.00
249	605162	新中港	1,377	12,461.85	0.00
250	605500	森林包装	762	12,428.22	0.00
251	001266	宏英智能	247	12,298.13	0.00
252	605028	世茂能源	615	12,256.95	0.00
253	603215	比依股份	575	12,115.25	0.00
254	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
255	603213	镇洋发展	799	11,961.03	0.00
256	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
257	001218	丽臣实业	490	11,701.20	0.00
258	001207	联科科技	682	11,600.82	0.00
259	301103	何氏眼科	362	11,591.24	0.00
260	300940	南极光	491	11,553.23	0.00
261	301126	达嘉维康	662	11,340.06	0.00
262	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
263	605098	行动教育	405	11,242.80	0.00
264	605319	无锡振华	764	11,108.56	0.00
265	301078	孩子王	756	11,082.96	0.00
266	605005	合兴股份	634	10,993.56	0.00
267	688345	博力威	177	10,880.19	0.00
268	301216	万凯新材	364	10,861.76	0.00

269	300937	药易购	334	10,694.68	0.00
270	605365	立达信	645	10,687.65	0.00
271	605599	菜百股份	980	10,662.40	0.00
272	301100	风光股份	494	10,660.52	0.00
273	001206	依依股份	321	10,641.15	0.00
274	605378	野马电池	473	10,311.40	0.00
275	300932	三友联众	560	10,298.40	0.00
276	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
277	301017	漱玉平民	555	10,289.70	0.00
278	301046	能辉科技	290	10,036.90	0.00
279	605598	上海港湾	553	9,987.18	0.00
280	301015	百洋医药	462	9,969.96	0.00
281	605566	福莱蒾特	435	9,926.70	0.00
282	300962	中金辐照	657	9,920.70	0.00
283	001296	长江材料	403	9,905.74	0.00
284	605567	春雪食品	629	9,850.14	0.00
285	605033	美邦股份	423	9,809.37	0.00
286	003042	中农联合	546	9,789.78	0.00
287	603272	联翔股份	443	9,723.85	0.00
288	603511	爱慕股份	553	9,660.91	0.00
289	605300	佳禾食品	576	9,578.88	0.00
290	605488	福莱新材	603	9,491.22	0.00
291	301020	密封科技	421	9,472.50	0.00
292	605228	神通科技	1,217	9,407.41	0.00
293	301222	浙江恒威	324	9,383.04	0.00
294	301258	富士莱	225	9,378.00	0.00
295	605289	罗曼股份	474	9,375.72	0.00
296	688330	宏力达	109	9,372.91	0.00
297	300927	江天化学	540	9,342.00	0.00
298	605069	正和生态	608	9,326.72	0.00
299	301237	和顺科技	222	9,292.92	0.00
300	605196	华通线缆	1,172	9,235.36	0.00
301	603048	浙江黎明	464	9,224.32	0.00
302	003027	同兴环保	523	9,126.35	0.00
303	300922	天秦装备	508	9,123.68	0.00
304	300933	中辰股份	1,117	9,103.55	0.00
305	300918	南山智尚	1,063	9,088.65	0.00
306	605138	盛泰集团	723	9,023.04	0.00
307	001234	泰慕士	333	9,017.64	0.00
308	300926	博俊科技	384	8,966.40	0.00
309	605086	龙高股份	443	8,877.72	0.00
310	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00



311	605580	恒盛能源	654	8,815.92	0.00
312	605287	德才股份	349	8,798.29	0.00
313	301138	华研精机	285	8,763.75	0.00
314	605180	华生科技	499	8,677.61	0.00
315	605011	杭州热电	525	8,526.00	0.00
316	605189	富春染织	422	8,473.76	0.00
317	605259	绿田机械	295	8,425.20	0.00
318	003032	传智教育	586	8,409.10	0.00
319	001288	运机集团	537	8,382.57	0.00
320	003036	泰坦股份	776	8,310.96	0.00
321	001219	青岛食品	354	8,088.90	0.00
322	003033	征和工业	301	8,066.80	0.00
323	605299	舒华体育	738	8,058.96	0.00
324	301028	东亚机械	733	7,931.06	0.00
325	605303	园林股份	610	7,838.50	0.00
326	001210	金房节能	311	7,790.55	0.00
327	605055	迎丰股份	1,146	7,666.74	0.00
328	300945	曼卡龙	474	7,621.92	0.00
329	603150	万朗磁塑	250	7,442.50	0.00
330	605155	西大门	490	7,217.70	0.00
331	301012	扬电科技	170	6,971.70	0.00
332	301027	华蓝集团	286	6,944.08	0.00
333	605298	必得科技	508	6,908.80	0.00
334	002773	康弘药业	460	6,872.40	0.00
335	001209	洪兴股份	450	6,849.00	0.00
336	002361	神剑股份	1,318	6,787.70	0.00
337	001202	炬申股份	459	6,742.71	0.00
338	605577	龙版传媒	588	6,703.20	0.00
339	003023	彩虹集团	385	6,622.00	0.00
340	300987	川网传媒	391	6,596.17	0.00
341	003041	真爱美家	419	6,532.21	0.00
342	301002	崧盛股份	261	6,491.07	0.00
343	300975	商络电子	738	6,472.26	0.00
344	300998	宁波方正	201	6,080.25	0.00
345	301081	严牌股份	403	6,077.24	0.00
346	300943	春晖智控	382	6,001.22	0.00
347	300958	建工修复	300	5,934.00	0.00
348	300991	创益通	406	5,838.28	0.00
349	301011	华立科技	175	5,755.75	0.00
350	301030	仕净科技	242	5,643.44	0.00
351	300972	万辰生物	430	5,559.90	0.00
352	301010	晶雪节能	218	5,526.30	0.00

353	300931	通用电梯	713	5,511.49	0.00
354	300950	德固特	329	5,362.70	0.00
355	301016	雷尔伟	275	5,128.75	0.00
356	301007	德迈仕	303	4,566.21	0.00
357	301033	迈普医学	108	4,547.88	0.00
358	300929	华骐环保	320	4,400.00	0.00
359	300960	通业科技	234	4,380.48	0.00
360	300992	泰福泵业	200	4,262.00	0.00
361	301037	保立佳	193	4,215.12	0.00
362	688019	安集科技	18	3,832.56	0.00
363	002475	立讯精密	100	3,379.00	0.00
364	300618	寒锐钴业	58	3,359.36	0.00
365	601100	恒立液压	50	3,086.00	0.00
366	688119	中钢洛耐	334	2,945.88	0.00
367	000651	格力电器	78	2,630.16	0.00
368	002833	弘亚数控	148	2,468.64	0.00
369	600176	中国巨石	114	1,984.74	0.00
370	000977	浪潮信息	44	1,165.12	0.00
371	002601	龙佰集团	56	1,122.80	0.00
372	000546	金圆股份	1	16.06	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	002594	比亚迪	77,542,774.60	21.56
2	601012	隆基绿能	71,322,586.56	19.83
3	300750	宁德时代	69,739,681.00	19.39
4	002466	天齐锂业	48,884,521.54	13.59
5	000625	长安汽车	44,647,476.78	12.42
6	300274	阳光电源	43,380,617.00	12.06
7	688599	天合光能	40,032,934.90	11.13
8	000792	盐湖股份	39,398,083.20	10.96
9	002176	江特电机	37,867,098.25	10.53
10	000408	藏格矿业	36,048,006.00	10.02
11	002192	融捷股份	29,613,140.83	8.23
12	002459	晶澳科技	29,348,707.35	8.16
13	600522	中天科技	29,268,395.21	8.14
14	601633	长城汽车	26,482,880.72	7.36
15	002756	永兴材料	26,438,115.61	7.35
16	300763	锦浪科技	25,697,067.64	7.15
17	600141	兴发集团	21,919,113.00	6.10

18	002056	横店东磁	20,881,684.58	5.81
19	688390	固德威	20,274,584.28	5.64
20	688408	中信博	20,147,117.58	5.60
21	002240	盛新锂能	18,597,625.00	5.17
22	002738	中矿资源	17,844,268.00	4.96
23	002812	恩捷股份	16,165,321.00	4.50
24	601238	广汽集团	15,504,305.40	4.31
25	300390	天华超净	14,909,181.00	4.15
26	002460	赣锋锂业	14,177,392.50	3.94
27	300014	亿纬锂能	14,037,132.68	3.90
28	002487	大金重工	13,947,326.00	3.88
29	300850	新强联	13,696,399.80	3.81
30	600297	广汇汽车	12,603,519.00	3.50
31	688156	路德环境	12,407,189.34	3.45
32	300568	星源材质	11,954,926.00	3.32
33	002241	歌尔股份	11,194,982.00	3.11
34	600596	新安股份	10,836,763.10	3.01
35	300498	温氏股份	10,169,379.80	2.83
36	002531	天顺风能	9,684,346.00	2.69
37	300450	先导智能	9,381,786.00	2.61
38	600884	杉杉股份	9,225,658.71	2.57
39	300432	富临精工	9,193,661.91	2.56
40	300712	永福股份	9,046,658.00	2.52
41	300745	欣锐科技	9,029,871.00	2.51
42	600418	江淮汽车	9,001,713.43	2.50
43	000400	许继电气	9,001,597.00	2.50
44	300207	欣旺达	8,750,620.18	2.43
45	603583	捷昌驱动	8,605,477.85	2.39
46	603063	禾望电气	8,139,246.00	2.26
47	002129	TCL 中环	8,020,621.00	2.23
48	603338	浙江鼎力	7,817,040.00	2.17
49	601865	福莱特	7,629,047.00	2.12
50	002157	正邦科技	7,473,985.00	2.08
51	600519	贵州茅台	7,298,999.00	2.03
52	600988	赤峰黄金	7,277,491.00	2.02

注：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	300750	宁德时代	78,559,569.00	21.85
2	601012	隆基绿能	67,095,471.27	18.66
3	002594	比亚迪	59,547,456.80	16.56
4	000792	盐湖股份	55,803,649.98	15.52
5	002466	天齐锂业	49,376,615.58	13.73
6	300274	阳光电源	45,999,357.97	12.79
7	000408	藏格矿业	38,102,991.60	10.60
8	002176	江特电机	38,018,939.45	10.57
9	688599	天合光能	36,592,461.81	10.18
10	000625	长安汽车	35,735,884.26	9.94
11	600141	兴发集团	34,236,973.66	9.52
12	688390	固德威	31,705,011.65	8.82
13	600522	中天科技	30,702,050.00	8.54
14	002756	永兴材料	29,238,273.48	8.13
15	002459	晶澳科技	29,029,005.08	8.07
16	601633	长城汽车	28,148,908.01	7.83
17	002056	横店东磁	26,330,028.15	7.32
18	002812	恩捷股份	24,473,142.33	6.81
19	300763	锦浪科技	24,244,911.40	6.74
20	002192	融捷股份	23,395,954.92	6.51
21	688408	中信博	21,723,745.32	6.04
22	002738	中矿资源	16,956,836.00	4.72
23	601238	广汽集团	16,291,837.00	4.53
24	600389	江山股份	14,619,519.84	4.07
25	002487	大金重工	14,447,200.00	4.02
26	600499	科达制造	13,633,193.74	3.79
27	002460	赣锋锂业	13,383,309.90	3.72
28	300014	亿纬锂能	13,336,731.56	3.71
29	002603	以岭药业	12,772,333.80	3.55
30	300850	新强联	12,479,225.64	3.47
31	600297	广汇汽车	11,957,155.20	3.33
32	300390	天华超净	11,830,499.00	3.29
33	300118	东方日升	10,962,107.00	3.05
34	002241	歌尔股份	10,605,330.00	2.95
35	002240	盛新锂能	10,287,520.00	2.86
36	600596	新安股份	10,073,323.30	2.80
37	002531	天顺风能	10,059,735.00	2.80
38	300498	温氏股份	9,814,713.40	2.73
39	300568	星源材质	9,526,685.00	2.65
40	300432	富临精工	9,464,512.95	2.63
41	300207	欣旺达	9,206,532.33	2.56
42	000400	许继电气	8,857,686.00	2.46

43	603063	禾望电气	8,630,035.00	2.40
44	605117	德业股份	8,624,670.00	2.40
45	300745	欣锐科技	8,459,063.00	2.35
46	300712	永福股份	8,281,841.00	2.30
47	600418	江淮汽车	8,276,413.00	2.30
48	603583	捷昌驱动	7,981,423.60	2.22
49	603338	浙江鼎力	7,941,347.00	2.21
50	601865	福莱特	7,752,149.56	2.16
51	300413	芒果超媒	7,736,280.00	2.15
52	688063	派能科技	7,555,415.17	2.10

注：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	1,311,521,737.34
卖出股票收入（成交）总额	1,331,558,648.67

注：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	249,946.72
2	应收清算款	1,674,611.47
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,560,695.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,485,254.07

### 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 (%)
17,087	10,238.53	56,720,009.19	32.42	118,225,774.01	67.58

## 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	418,903.43	0.24

## 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	-

## § 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	183,340,745.05
本报告期基金总申购份额	55,377,003.02
减：本报告期基金总赎回份额	63,771,964.87
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	174,945,783.20

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

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 (%)	
兴业证券	2	582,281,619.92	40.07	419,371.90	24.94	-
金元证券	1	440,402,710.37	30.30	317,501.54	18.88	-
申万宏源	2	358,989,327.25	24.70	262,530.88	15.62	-
中信证券	6	52,993,189.87	3.65	412,845.30	24.56	-
广发证券	2	18,615,153.22	1.28	268,992.71	16.00	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

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 (%)
兴业证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

### 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使用	证券时报、公司官网	2022年1月29日

	固有资金购买本公司旗下公募基金的公告		
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

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	20220101-20220630	50,060,750.00	0.00	0.00	50060750.00	28.62
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

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](http://www.htcxfund.com)

红土创新基金管理有限公司

红土创新基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日