

# 红土创新稳进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：招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。

基金托管人招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

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 9         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 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             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 10        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 11        |
| 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       | 11        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>11</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 11        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 11        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 11        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 12        |
| 6.2 利润表                                 | 13        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 14        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>43</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 43        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 43        |
| 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       | 44        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 45        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 46        |
| 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      | 46        |

|                                            |           |
|--------------------------------------------|-----------|
| 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        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>                  | <b>48</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 48        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 48        |
| 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.....      | 48        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>                  | <b>49</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示.....</b>                    | <b>49</b> |
| 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.....           | 49        |
| 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        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>            | <b>52</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.....    | 52        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                   | 53        |
| <b>§ 12 备查文件目录.....</b>                    | <b>53</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                           | 53        |
| 12.2 存放地点.....                             | 53        |
| 12.3 查阅方式.....                             | 53        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金名称            | 红土创新稳进混合型证券投资基金  |                 |
| 基金简称            | 红土创新稳进混合         |                 |
| 基金主代码           | 009077           |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                 |
| 基金合同生效日         | 2020 年 3 月 6 日   |                 |
| 基金管理人           | 红土创新基金管理有限公司     |                 |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司       |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 119,063,590.69 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 红土创新稳进混合 A       | 红土创新稳进混合 C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 009077           | 009078          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 34,404,441.83 份  | 84,659,148.86 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                            |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金采用多种投资策略，在严格管理风险和保障必要流动性的前提下，实现长期稳健增值。                                                                                  |
| 投资策略   | 本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行各大类资产中的个股、个券精选。在严格控制投资组合风险的前提下，动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例，力图规避市场风险，提高配置效率。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*20%+中证全债指数收益率*80%。                                                                                |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。                                                             |

### 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                    | 招商银行股份有限公司             |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 殷喆                              | 张燕                     |
|             | 联系电话 | 0755-33011858                   | 0755-83199084          |
|             | 电子邮箱 | yinz@htcxfund.com               | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话      |      | 0755-33011866                   | 95555                  |
| 传真          |      | 0755-33011855                   | 0755-83195201          |
| 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 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦   |
| 办公地址        |      | 深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 楼      | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦   |
| 邮政编码        |      | 518048                          | 518040                 |

|       |    |     |
|-------|----|-----|
| 法定代表人 | 阮菲 | 缪建民 |
|-------|----|-----|

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                             |
|---------------------|-------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 上海证券报                                                       |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.htxfund.com">http://www.htxfund.com</a> |
| 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<br>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 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日) |                |
|---------------|----------------------------------------|----------------|
|               | 红土创新稳进混合 A                             | 红土创新稳进混合 C     |
| 本期已实现收益       | 2,005,070.25                           | 13,113,378.93  |
| 本期利润          | -1,256,623.66                          | -14,178,293.90 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0313                                | -0.0776        |
| 本期加权平均净值利润率   | -2.72%                                 | -6.72%         |
| 本期基金份额净值增长率   | -2.00%                                 | -2.05%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日)                  |                |
|               | 红土创新稳进混合 A                             | 红土创新稳进混合 C     |
| 期末可供分配利润      | 5,045,785.18                           | 12,187,221.40  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1467                                 | 0.1440         |
| 期末基金资产净值      | 40,108,160.38                          | 98,465,538.93  |
| 期末基金份额净值      | 1.1658                                 | 1.1631         |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2022 年 6 月 30 日)                  |                |
|               | 红土创新稳进混合 A                             | 红土创新稳进混合 C     |
| 基金份额累计净值增长率   | 21.53%                                 | 21.25%         |

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

红土创新稳进混合 A

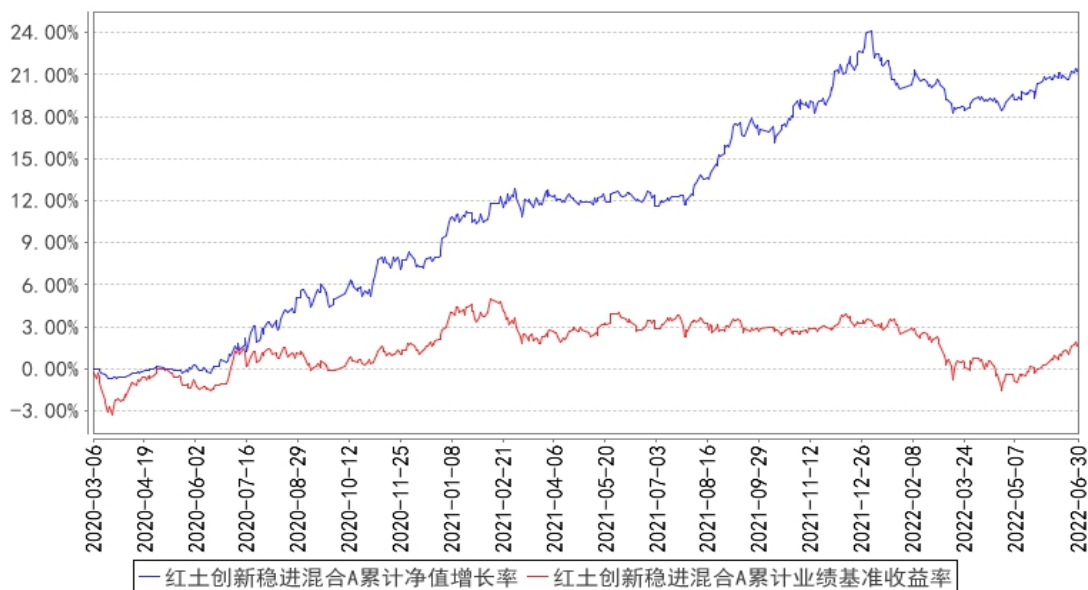
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③    | ②－④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 0.80%    | 0.19%       | 1.62%      | 0.21%         | -0.82% | -0.02% |
| 过去三个月      | 2.15%    | 0.21%       | 1.52%      | 0.28%         | 0.63%  | -0.07% |
| 过去六个月      | -2.00%   | 0.24%       | -1.58%     | 0.29%         | -0.42% | -0.05% |
| 过去一年       | 8.20%    | 0.28%       | -1.43%     | 0.25%         | 9.63%  | 0.03%  |
| 自基金合同生效起至今 | 21.53%   | 0.28%       | 1.93%      | 0.26%         | 19.60% | 0.02%  |

红土创新稳进混合 C

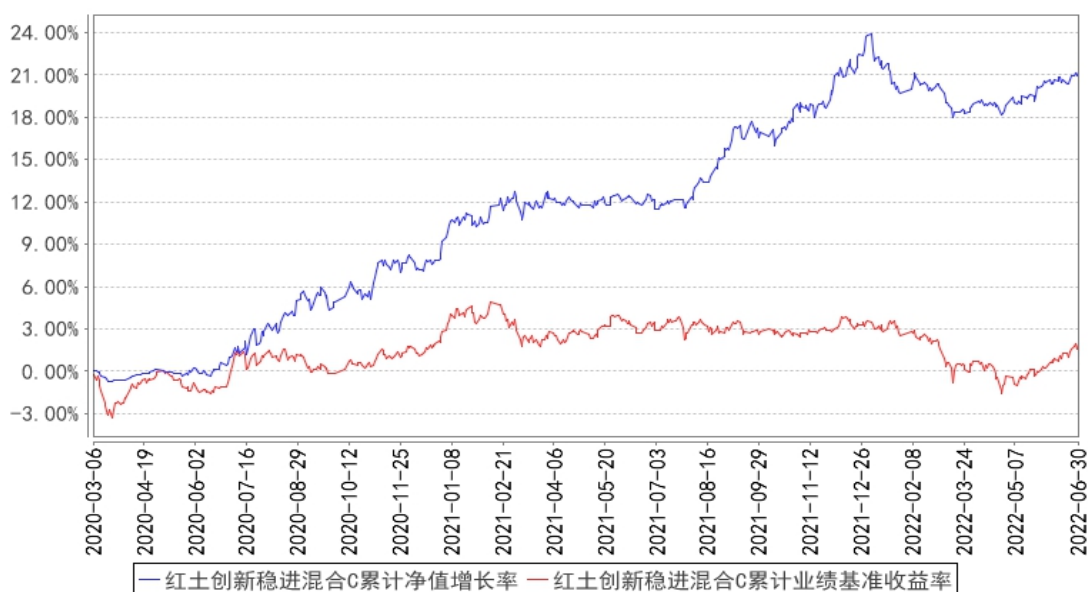
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③    | ②－④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 0.80%    | 0.18%       | 1.62%      | 0.21%         | -0.82% | -0.03% |
| 过去三个月      | 2.12%    | 0.21%       | 1.52%      | 0.28%         | 0.60%  | -0.07% |
| 过去六个月      | -2.05%   | 0.24%       | -1.58%     | 0.29%         | -0.47% | -0.05% |
| 过去一年       | 8.09%    | 0.28%       | -1.43%     | 0.25%         | 9.52%  | 0.03%  |
| 自基金合同生效起至今 | 21.25%   | 0.28%       | 1.93%      | 0.26%         | 19.32% | 0.02%  |

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

红土创新稳进混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



红土创新稳进混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，截止建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

## § 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 |        |                                                                                                                                                                                            |
| 陈若劲 | 本基金的基金经理 | 2020 年 3 月 6 日  | -    | 20 年   | 香港中文大学金融 MBA。曾在宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员、固定收益部总监，宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈货币市场证券投资基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈祥泰混合型证券投资基金的基金经理。现任红土创新基金管理有限公司副总经理、固定收益部总监、红土创新稳健混合型证券投资基金、红土创新稳进混合型证券投资基金、红土创新增强收益债券型证券投资基金的基金经理。 |

#### 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、《红土创新稳健混合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

报告期内，国内经济延续去年以来的弱势，国内外宏观经济要素中均出现预期外的较大变化。俄乌冲突导致以原油为代表的大宗商品价格快速走高，全球面临较大的通胀压力。奥密克戎病毒在部分大城市传播，导致国内制造业供应链呈现一定程度的不稳定，消费压力再次加大，部分行业的景气度短暂快速下滑，经济面临较大下行压力。美联储一季度开启加息，并暗示随后将开启缩表，全球流动性环境面临较大的不确定性。国内政策着眼于温和刺激需求端，将保就业保民生放在更重要的位置。随着上海疫情的结束，国内经济进入缓慢复苏的阶段，国内货币政策和财政政策均具备一定的空间，政策环境相对友好。

报告期内，在较大的经济下行压力背景下，央行保持较为宽松的货币政策，短端资金面十分充裕，债券收益率曲线呈现出陡峭化特征。10 年期国债收益率小幅上行 4bp 左右，而 1 年期国债收益率从年初的 2.24% 下行至季末 1.95%。

报告期内，债券市场方面，我们以持有 3 年以内的中短久期高等级信用债为主，力争获取稳健的票息收益。股票市场方面，同年初相比，我们减持了部分景气度受到冲击的成长股，较多的配置了估值合理、对宏观经济敏感性弱、国家政策支持的事业行业，适当配置了部分需求稳定、成长性良好、估值合理的军工标的以及部分疫情复苏受益、长期需求稳定的泛消费类标的。转债市场方面，我们持有部分估值合理正股确定性高的转债。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末红土创新稳进混合 A 的基金份额净值为 1.1658 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.00%，同期业绩比较基准收益率为-1.58%；截至本报告期末红土创新稳进混合 C 的基金份额净值为 1.1631 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.05%，同期业绩比较基准收益率为-1.58%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们认为国内经济将从底部开始逐渐复苏，疫情管控政策的渐进调整有利于消费和服务业的回暖，目前国内的货币和财政政策仍然存在较大的空间，稳增长保民生是下半年最重要的政策主题。债券市场方面，我们认为社融短期有望企稳回升，对长短端利率均构成一定的制约，我们仍然将持有获取票息收益作为债券投资的主要策略。权益市场方面，在社融增速企稳回升，宏观经济向下有底的背景下，整体估值压力将有所减轻，不同行业的盈利情况将有较大分

化。因此，权益市场方面，我们将审视更多的行业，着重于考虑标的的盈利稳定性和估值的安全边际，择机参与一级市场的新股投资。

#### 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：红土创新稳进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<br>2022 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>   |            |                                |                                  |
| 银行存款          | 6.4.7.1    | 1,340,893.35                   | 1,148,032.59                     |
| 结算备付金         |            | 739,522.39                     | 3,915,663.58                     |
| 存出保证金         |            | 56,390.46                      | 33,944.25                        |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 174,395,655.30                 | 550,090,239.61                   |
| 其中：股票投资       |            | 33,123,847.82                  | 143,828,913.21                   |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | 141,271,807.48                 | 406,261,326.40                   |
| 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         |            | -                              | 90,167.05                        |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 60,336.36                      | 5,789,184.81                     |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                              | 4,630,628.64                     |
| 资产总计          |            | 176,592,797.86                 | 565,697,860.53                   |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>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     |            | 37,304,684.93                  | 96,299,772.60                    |
| 应付清算款         |            | 23,911.31                      | -                                |
| 应付赎回款         |            | 223,972.08                     | 54,826.31                        |

|             |          |                |                |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 应付管理人报酬     |          | 68,148.77      | 225,437.68     |
| 应付托管费       |          | 11,358.13      | 37,572.94      |
| 应付销售服务费     |          | 8,068.33       | 33,863.14      |
| 应付投资顾问费     |          | -              | -              |
| 应交税费        |          | 10,820.59      | 21,288.50      |
| 应付利润        |          | -              | -              |
| 递延所得税负债     |          | -              | -              |
| 其他负债        | 6.4.7.9  | 368,134.41     | 286,843.70     |
| 负债合计        |          | 38,019,098.55  | 96,959,604.87  |
| <b>净资产：</b> |          |                |                |
| 实收基金        | 6.4.7.10 | 119,063,590.69 | 394,690,082.73 |
| 其他综合收益      | 6.4.7.11 | -              | -              |
| 未分配利润       | 6.4.7.12 | 19,510,108.62  | 74,048,172.93  |
| 净资产合计       |          | 138,573,699.31 | 468,738,255.66 |
| 负债和净资产总计    |          | 176,592,797.86 | 565,697,860.53 |

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 119,063,590.69 份，其中红土创新稳进混合 A 基金份额总额 34,404,441.83 份，基金份额净值 1.1658 元；红土创新稳进混合 C 基金份额总额 84,659,148.86 份，基金份额净值 1.1631 元。

## 6.2 利润表

会计主体：红土创新稳进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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>    |          | -13,951,349.51                        | 12,796,886.92                              |
| 1. 利息收入           |          | 123,535.64                            | 4,122,234.16                               |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.13 | 32,481.59                             | 46,783.74                                  |
| 债券利息收入            |          | -                                     | 4,070,737.39                               |
| 资产支持证券利息收入        |          | -                                     | -                                          |
| 买入返售金融资产收入        |          | 91,054.05                             | 5,492.59                                   |
| 证券出借利息收入          |          | -                                     | -                                          |
| 其他利息收入            |          | -                                     | -779.56                                    |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 16,443,961.26                         | 18,260,213.14                              |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.14 | 9,571,124.39                          | 17,142,335.12                              |
| 基金投资收益            |          | -                                     | -                                          |
| 债券投资收益            | 6.4.7.15 | 6,674,911.23                          | 190,898.23                                 |
| 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   | 197,925.64     | 926,979.79    |
| 以摊余成本计量的<br>金融资产终止确认产生的<br>收益       |            | -              | -             |
| 其他投资收益                              |            | -              | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损<br>失以“-”号填列）          | 6.4.7.20   | -30,553,366.74 | -9,628,254.59 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）              |            | -              | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”<br>号填列）              | 6.4.7.21   | 34,520.33      | 42,694.21     |
| <b>减：二、营业总支出</b>                    |            | 1,483,568.05   | 2,541,289.20  |
| 1. 管理人报酬                            | 6.4.10.2.1 | 778,458.77     | 1,159,920.19  |
| 2. 托管费                              | 6.4.10.2.2 | 129,743.09     | 193,320.06    |
| 3. 销售服务费                            | 6.4.10.2.3 | 106,767.57     | 174,479.09    |
| 4. 投资顾问费                            |            | -              | -             |
| 5. 利息支出                             |            | 343,436.50     | 608,280.11    |
| 其中：卖出回购金融资产支<br>出                   |            | 343,436.50     | 608,280.11    |
| 6. 信用减值损失                           | 6.4.7.22   | -              | -             |
| 7. 税金及附加                            |            | 9,513.70       | 10,478.01     |
| 8. 其他费用                             | 6.4.7.23   | 115,648.42     | 394,811.74    |
| <b>三、利润总额（亏损总额<br/>    以“-”号填列）</b> |            | -15,434,917.56 | 10,255,597.72 |
| 减：所得税费用                             |            | -              | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”<br/>    号填列）</b>   |            | -15,434,917.56 | 10,255,597.72 |
| <b>五、其他综合收益的税后<br/>    净额</b>       |            | -              | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>                     |            | -15,434,917.56 | 10,255,597.72 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：红土创新稳进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<br>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<br>末 净 资 产 | 394,690,082.73                        | -      | 74,048,172.93 | 468,738,255.66 |

|                                          |                 |   |                |                 |
|------------------------------------------|-----------------|---|----------------|-----------------|
| （基金净值）                                   |                 |   |                |                 |
| 加：会计政策变更                                 | -               | - | -              | -               |
| 前期差错更正                                   | -               | - | -              | -               |
| 其他                                       | -               | - | -              | -               |
| 二、本期期初净资产<br>（基金净值）                      | 394,690,082.73  | - | 74,048,172.93  | 468,738,255.66  |
| 三、本期增减变动额<br>（减少以“-”号填列）                 | -275,626,492.04 | - | -54,538,064.31 | -330,164,556.35 |
| （一）、综合收益总额                               | -               | - | -15,434,917.56 | -15,434,917.56  |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>（净值减少以“-”号填列）  | -275,626,492.04 | - | -39,103,146.75 | -314,729,638.79 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 70,369,165.58   | - | 10,975,405.66  | 81,344,571.24   |
| 2. 基金赎回款                                 | -345,995,657.62 | - | -50,078,552.41 | -396,074,210.03 |
| （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<br>（基金净值）                      | 119,063,590.69  | - | 19,510,108.62  | 138,573,699.31  |

| 值)                                           |                                            |        |                |                |
|----------------------------------------------|--------------------------------------------|--------|----------------|----------------|
| 项目                                           | 上年度可比期间<br>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<br>(基金净值)                          | 368,112,200.10                             | -      | 28,322,774.33  | 396,434,974.43 |
| 加: 会计政策变更                                    | -                                          | -      | -              | -              |
| 前期差错更正                                       | -                                          | -      | -              | -              |
| 其他                                           | -                                          | -      | -              | -              |
| 二、本期期初净资产<br>(基金净值)                          | 368,112,200.10                             | -      | 28,322,774.33  | 396,434,974.43 |
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填列)                     | 3,459,021.29                               | -      | -50,873.23     | 3,408,148.06   |
| (一)、综合收益总额                                   | -                                          | -      | 10,255,597.72  | 10,255,597.72  |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)      | 3,459,021.29                               | -      | 357,807.19     | 3,816,828.48   |
| 其中: 1. 基金申购款                                 | 48,764,398.88                              | -      | 4,265,527.33   | 53,029,926.21  |
| 2. 基金赎回款                                     | -45,305,377.59                             | -      | -3,907,720.14  | -49,213,097.73 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动<br>(净值减少以“-”号填列) | -                                          | -      | -10,664,278.14 | -10,664,278.14 |

|                     |                |   |               |                |
|---------------------|----------------|---|---------------|----------------|
| (四)、其他综合收益结转留存收益    | -              | - | -             | -              |
| 四、本期期末净资产<br>(基金净值) | 371,571,221.39 | - | 28,271,901.10 | 399,843,122.49 |

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

红土创新稳进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[2019]2216号《关于准予红土创新稳进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《红土创新稳进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395,238,626.45元,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0163号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《红土创新稳进混合型证券投资基金基金合同》于2020年3月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为395,247,848.08份基金份额,其中认购资金利息折合9,221.63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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《红土创新稳进混合型证券投资基金基金合同》和《红土创新稳进混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取前端认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,不计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资者认购、申购时不收取前端认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,且从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。A类基金份额、C类基金份额分别设置代码,分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新稳进混合型证券投资基金基金合同》

的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款、同业存单、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%—40%；其中本基金投资同业存单的比例不得超过基金资产的 20%；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，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*20%+中证全债指数收益率\*80%。

#### 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》、《红土创新稳健混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

#### 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。本基金将对其没有控制、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。

(i) 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 1,148,032.59 元、3,915,663.58 元、33,944.25 元、4,630,628.64 元、90,167.05 元和 5,789,184.81 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 1,148,535.17 元、3,917,601.78 元、33,960.97 元、0.00 元、90,167.05 元和 5,789,184.81 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 550,090,239.61 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 554,718,410.75 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 96,299,772.60 元、54,826.31 元、225,437.68 元、37,572.94 元、33,863.14 元、37,696.69 元、10,146.43 元和 0.58 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 96,309,919.03 元、54,826.31 元、225,437.68 元、37,572.94 元、33,863.14 元、37,696.69 元、0.00 元和 0.58 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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

## 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 1,340,893.35           |
| 等于：本金          | 1,340,761.65           |
| 加：应计利息         | 131.70                 |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 定期存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 合计             | 1,340,893.35           |

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |                 |                   |                 |
|---------------|-------|------------------------|-----------------|-------------------|-----------------|
|               |       | 成本                     | 应计利息            | 公允价值              | 公允价值变动          |
| 股票            |       | 30, 936, 679. 98       | -               | 33, 123, 847. 82  | 2, 187, 167. 84 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                      | -               | -                 | -               |
| 债券            | 交易所市场 | 31, 365, 854. 31       | 290, 307. 36    | 32, 872, 688. 56  | 1, 216, 526. 89 |
|               | 银行间市场 | 106, 669, 464. 79      | 1, 809, 118. 92 | 108, 399, 118. 92 | -79, 464. 79    |
|               | 合计    | 138, 035, 319. 10      | 2, 099, 426. 28 | 141, 271, 807. 48 | 1, 137, 062. 10 |
| 资产支持证券        |       | -                      | -               | -                 | -               |
| 基金            |       | -                      | -               | -                 | -               |
| 其他            |       | -                      | -               | -                 | -               |
| 合计            |       | 168, 971, 999. 08      | 2, 099, 426. 28 | 174, 395, 655. 30 | 3, 324, 229. 94 |

## 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。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 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

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                      |
| 应付赎回费       | 11.30                  |
| 应付证券出借违约金   | —                      |
| 应付交易费用      | 39,862.96              |
| 其中：交易所市场    | 26,866.10              |

|       |            |
|-------|------------|
| 银行间市场 | 12,996.86  |
| 应付利息  | —          |
| 预提费用  | 328,260.15 |
| 合计    | 368,134.41 |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

红土创新稳进混合 A

| 项目            | 本期<br>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          | 40,741,161.28                         | 40,741,161.28  |
| 本期申购          | 9,022,596.42                          | 9,022,596.42   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -15,359,315.87                        | -15,359,315.87 |
| 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           | 34,404,441.83                         | 34,404,441.83  |

红土创新稳进混合 C

| 项目            | 本期<br>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          | 353,948,921.45                        | 353,948,921.45  |
| 本期申购          | 61,346,569.16                         | 61,346,569.16   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -330,636,341.75                       | -330,636,341.75 |
| 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           | 84,659,148.86                         | 84,659,148.86   |

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

红土创新稳进混合 A

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期期初           | 4,125,366.43  | 3,597,642.93  | 7,723,009.36  |
| 本期利润           | 2,005,070.25  | -3,261,693.91 | -1,256,623.66 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,084,651.50 | 321,984.35    | -762,667.15   |

|          |               |             |               |
|----------|---------------|-------------|---------------|
| 其中：基金申购款 | 1,040,711.51  | 446,689.44  | 1,487,400.95  |
| 基金赎回款    | -2,125,363.01 | -124,705.09 | -2,250,068.10 |
| 本期已分配利润  | -             | -           | -             |
| 本期末      | 5,045,785.18  | 657,933.37  | 5,703,718.55  |

## 红土创新稳进混合 C

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期期初           | 35,112,944.81  | 31,212,218.76  | 66,325,163.57  |
| 本期利润           | 13,113,378.93  | -27,291,672.83 | -14,178,293.90 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -36,039,102.34 | -2,301,377.26  | -38,340,479.60 |
| 其中：基金申购款       | 6,913,979.50   | 2,574,025.21   | 9,488,004.71   |
| 基金赎回款          | -42,953,081.84 | -4,875,402.47  | -47,828,484.31 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 12,187,221.40  | 1,619,168.67   | 13,806,390.07  |

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 12,303.88                             |
| 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 | 19,749.42                             |
| 其他        | 428.29                                |
| 合计        | 32,481.59                             |

## 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<br>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 | 9,571,124.39               |
| 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               | 9,571,124.39               |

## 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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 138,066,376.88                        |
| 减：卖出股票成本总额 | 128,257,884.64                        |

|          |              |
|----------|--------------|
| 减：交易费用   | 237,367.85   |
| 买卖股票差价收入 | 9,571,124.39 |

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 3,145,317.25               |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 3,529,593.98               |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | —                          |
| 债券投资收益——申购差价收入               | —                          |
| 合计                           | 6,674,911.23               |

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 535,940,511.09             |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 524,637,706.92             |
| 减：应计利息总额               | 7,765,548.69               |
| 减：交易费用                 | 7,661.50                   |
| 买卖债券差价收入               | 3,529,593.98               |

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 197,925.64                            |
| 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            | 197,925.64                            |

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -30,553,366.74                        |
| 股票投资                   | -25,971,838.27                        |
| 债券投资                   | -4,581,528.47                         |
| 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                     | -30,553,366.74                        |

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 34,514.35                             |
| 基金转换费收入 | 5.98                                  |
| 合计      | 34,520.33                             |

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<br>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      | 7,788.27   |
| 上清所证书使用费     | 600.00     |
| 上清所债券托管帐户维护费 | 9,000.00   |
| 中债登债券托管帐户维护费 | 9,000.00   |
| 合计           | 115,648.42 |

#### 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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”）           | 基金托管人               |
| 深创投红土资产管理（深圳）有限公司（“深创投红土资管”） | 基金管理人的全资子公司         |
| 深圳市创新投资集团有限公司（“深创投”）         | 基金管理人的控股股东          |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>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  | 778,458.77                            | 1,159,920.19                               |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 68,482.81                             | 64,596.17                                  |

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 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>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 | 129,743.09                            | 193,320.06                                 |

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日      |            |            |
|----------------|--------------------------------------------|------------|------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |            |            |
|                | 红土创新稳进混合 A                                 | 红土创新稳进混合 C | 合计         |
| 红土创新           | —                                          | 85,379.22  | 85,379.22  |
| 合计             | —                                          | 85,379.22  | 85,379.22  |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |            |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |            |            |
|                | 红土创新稳进混合 A                                 | 红土创新稳进混合 C | 合计         |
| 红土创新           | —                                          | 141,478.72 | 141,478.72 |

|    |   |            |            |
|----|---|------------|------------|
| 合计 | - | 141,478.72 | 141,478.72 |
|----|---|------------|------------|

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给红土创新，再由红土创新计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值  $\times$  0.10% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

| 项目                             | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日      |
|--------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------|
|                                | 红土创新稳进混合 A                                 | 红土创新稳进混合 C                                 |
| 基金合同生效日（2020 年 3 月 6 日）持有的基金份额 | -                                          | -                                          |
| 报告期初持有的基金份额                    | -                                          | -                                          |
| 报告期间申购/买入总份额                   | 2,593,361.00                               | -                                          |
| 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                    | 2,593,361.00                               | -                                          |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例            | 7.5400%                                    | -                                          |
| 项目                             | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|                                | 红土创新稳进混合 A                                 | 红土创新稳进混合 C                                 |

|                                |   |   |
|--------------------------------|---|---|
| 基金合同生效日（2020 年 3 月 6 日）持有的基金份额 | — | — |
| 报告期初持有的基金份额                    | — | — |
| 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                    | — | — |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例            | — | — |

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

无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>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   |
| 招商银行  | 1,340,893.35                          | 12,303.88 | 905,608.26                                 | 8,969.43 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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  | 381      | 21,172.17 | 11,441.43 | —  |

|        |      |                 |      |         |       |       |       |           |           |   |
|--------|------|-----------------|------|---------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 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 | - |
| 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 | - |
| 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 | 203   | 13,008.24 | 7,616.56  | - |
| 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 | 348   | 25,296.12 | 24,895.92 | - |
| 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 | 314   | 17,860.32 | 17,715.88 | - |
| 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 | 1,782 | 30,775.14 | 26,427.06 | - |

#### 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

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称           | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|-----------|----------------|----------------|--------|---------|---------------|
| 101561024 | 15 中电投 MTN004  | 2022 年 7 月 1 日 | 104.01 | 100,000 | 10,400,770.96 |
| 101900754 | 19 船重 MTN001   | 2022 年 7 月 1 日 | 103.16 | 100,000 | 10,315,947.95 |
| 102001129 | 20 中国中药 MTN001 | 2022 年 7 月 1 日 | 100.99 | 100,000 | 10,098,691.51 |
| 合计        |                |                |        | 300,000 | 30,815,410.42 |

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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，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招商银行，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

## 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 10,191,339.73          | 9,996,000.00             |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | -                      | 63,031,200.00            |
| 合计     | 10,191,339.73          | 73,027,200.00            |

## 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

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 100,355,188.29         | 241,993,126.40           |
| AAA 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 30,725,279.46          | 91,241,000.00            |
| 合计     | 131,080,467.75         | 333,234,126.40           |

注：资产支持证券信用评级取自第三方评级机构的评级。

## 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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金和存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>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                     | 1,340,893.35   | -              | -             | -              | 1,340,893.35   |
| 结算备付金                    | 739,522.39     | -              | -             | -              | 739,522.39     |
| 存出保证金                    | 56,390.46      | -              | -             | -              | 56,390.46      |
| 交易性金融资产                  | 75,894,061.99  | 65,377,745.49  | -             | 33,123,847.82  | 174,395,655.30 |
| 应收申购款                    | -              | -              | -             | 60,336.36      | 60,336.36      |
| 资产总计                     | 78,030,868.19  | 65,377,745.49  | -             | 33,184,184.18  | 176,592,797.86 |
| 负债                       |                |                |               |                |                |
| 应付赎回款                    | -              | -              | -             | 223,972.08     | 223,972.08     |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -             | 68,148.77      | 68,148.77      |
| 应付托管费                    | -              | -              | -             | 11,358.13      | 11,358.13      |
| 应付清算款                    | -              | -              | -             | 23,911.31      | 23,911.31      |
| 卖出回购金融资产款                | 37,304,684.93  | -              | -             | -              | 37,304,684.93  |
| 应付销售服务费                  | -              | -              | -             | 8,068.33       | 8,068.33       |
| 应交税费                     | -              | -              | -             | 10,820.59      | 10,820.59      |
| 其他负债                     | -              | -              | -             | 368,134.41     | 368,134.41     |
| 负债总计                     | 37,304,684.93  | -              | -             | 714,413.62     | 38,019,098.55  |
| 利率敏感度缺口                  | 40,726,183.26  | 65,377,745.49  | -             | 32,469,770.56  | 138,573,699.31 |
| 上年度末<br>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                     | 1,148,032.59   | -              | -             | -              | 1,148,032.59   |
| 结算备付金                    | 3,915,663.58   | -              | -             | -              | 3,915,663.58   |
| 存出保证金                    | 33,944.25      | -              | -             | -              | 33,944.25      |
| 交易性金融资产                  | 113,122,200.00 | 272,015,267.20 | 21,123,859.20 | 143,828,913.21 | 550,090,239.61 |
| 应收申购款                    | -              | -              | -             | 5,789,184.81   | 5,789,184.81   |
| 应收证券清算款                  | -              | -              | -             | 90,167.05      | 90,167.05      |
| 其他资产                     | -              | -              | -             | 4,630,628.64   | 4,630,628.64   |

|           |                |                |               |                |                |
|-----------|----------------|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 资产总计      | 118,219,840.42 | 272,015,267.20 | 21,123,859.20 | 154,338,893.71 | 565,697,860.53 |
| 负债        |                |                |               |                |                |
| 应付赎回款     | -              | -              | -             | 54,826.31      | 54,826.31      |
| 应付管理人报酬   | -              | -              | -             | 225,437.68     | 225,437.68     |
| 应付托管费     | -              | -              | -             | 37,572.94      | 37,572.94      |
| 卖出回购金融资产款 | 96,299,772.60  | -              | -             | -              | 96,299,772.60  |
| 应付销售服务费   | -              | -              | -             | 33,863.14      | 33,863.14      |
| 应交税费      | -              | -              | -             | 21,288.50      | 21,288.50      |
| 其他负债      | -              | -              | -             | 286,843.70     | 286,843.70     |
| 负债总计      | 96,299,772.60  | -              | -             | 659,832.27     | 96,959,604.87  |
| 利率敏感度缺口   | 21,920,067.82  | 272,015,267.20 | 21,123,859.20 | 153,679,061.44 | 468,738,255.66 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率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. 市场利率下降 25 个基点   | 387,473.01                  | 2,495,528.55           |
|    | 2. 市场利率上升 25 个基点   | -384,814.90                 | -2,443,921.04          |

#### 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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金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。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例 0%-40%；其中本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。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<br>2022 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>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  | 33,123,847.82          | 23.90         | 143,828,913.21           | 30.68         |
| 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            | 33,123,847.82          | 23.90         | 143,828,913.21           | 30.68         |

#### 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%       | 1,183,216.37                | 3,548,387.91           |
|    | 2. 沪深 300 指数下降 5%       | -1,183,216.37               | -3,548,387.91          |

## 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<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 33,683,207.09          | 172,816,200.24           |
| 第二层次          | 140,577,101.29         | 376,474,589.01           |
| 第三层次          | 135,346.92             | 799,450.36               |
| 合计            | 174,395,655.30         | 550,090,239.61           |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 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              | 33,123,847.82  | 18.76         |
|    | 其中：股票             | 33,123,847.82  | 18.76         |
| 2  | 基金投资              | —              | —             |
| 3  | 固定收益投资            | 141,271,807.48 | 80.00         |
|    | 其中：债券             | 141,271,807.48 | 80.00         |
|    | 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      | 2,080,415.74   | 1.18          |
| 8  | 其他各项资产            | 116,726.82     | 0.07          |
| 9  | 合计                | 176,592,797.86 | 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         | 127,740.00    | 0.09          |
| B  | 采矿业              | 408,000.00    | 0.29          |
| C  | 制造业              | 9,068,480.09  | 6.54          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 10,000,032.00 | 7.22          |
| E  | 建筑业              | 184,200.00    | 0.13          |
| F  | 批发和零售业           | 3,911,042.18  | 2.82          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 7,807,881.22  | 5.63          |
| H  | 住宿和餐饮业           | —             | —             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 14,263.28     | 0.01          |
| J  | 金融业              | 1,531,460.00  | 1.11          |
| K  | 房地产业             | —             | —             |
| L  | 租赁和商务服务业         | —             | —             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 51,995.00     | 0.04          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 18,754.05     | 0.01          |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| 0 | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -             | -     |
| S | 综合            | -             | -     |
|   | 合计            | 33,123,847.82 | 23.90 |

### 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  | 600900 | 长江电力 | 425,000 | 9,826,000.00 | 7.09         |
| 2  | 600012 | 皖通高速 | 897,754 | 6,706,222.38 | 4.84         |
| 3  | 002013 | 中航机电 | 430,000 | 5,310,500.00 | 3.83         |
| 4  | 605266 | 健之佳  | 73,319  | 3,535,442.18 | 2.55         |
| 5  | 603712 | 七一二  | 60,000  | 1,890,000.00 | 1.36         |
| 6  | 600765 | 中航重机 | 25,000  | 804,500.00   | 0.58         |
| 7  | 002839 | 张家港行 | 150,000 | 793,500.00   | 0.57         |
| 8  | 601111 | 中国国航 | 50,000  | 580,500.00   | 0.42         |
| 9  | 601658 | 邮储银行 | 100,000 | 539,000.00   | 0.39         |
| 10 | 600377 | 宁沪高速 | 60,812  | 521,158.84   | 0.38         |
| 11 | 600028 | 中国石化 | 100,000 | 408,000.00   | 0.29         |
| 12 | 600372 | 中航电子 | 20,000  | 387,800.00   | 0.28         |
| 13 | 603233 | 大参林  | 12,000  | 375,600.00   | 0.27         |
| 14 | 600399 | 抚顺特钢 | 15,000  | 268,500.00   | 0.19         |
| 15 | 601838 | 成都银行 | 12,000  | 198,960.00   | 0.14         |
| 16 | 000672 | 上峰水泥 | 12,000  | 189,360.00   | 0.14         |
| 17 | 601390 | 中国中铁 | 30,000  | 184,200.00   | 0.13         |
| 18 | 600674 | 川投能源 | 14,600  | 174,032.00   | 0.13         |
| 19 | 300498 | 温氏股份 | 6,000   | 127,740.00   | 0.09         |
| 20 | 000792 | 盐湖股份 | 2,000   | 59,920.00    | 0.04         |
| 21 | 603259 | 药明康德 | 500     | 51,995.00    | 0.04         |
| 22 | 601089 | 福元医药 | 1,749   | 36,816.45    | 0.03         |
| 23 | 301217 | 铜冠铜箔 | 1,782   | 26,427.06    | 0.02         |
| 24 | 301201 | 诚达药业 | 348     | 24,895.92    | 0.02         |
| 25 | 301122 | 采纳股份 | 301     | 21,181.37    | 0.02         |
| 26 | 301127 | 天源环保 | 1,685   | 18,754.05    | 0.01         |
| 27 | 301207 | 华兰疫苗 | 314     | 17,715.88    | 0.01         |
| 28 | 301117 | 佳缘科技 | 262     | 14,263.28    | 0.01         |
| 29 | 301116 | 益客食品 | 577     | 11,805.42    | 0.01         |

|    |        |      |     |           |      |
|----|--------|------|-----|-----------|------|
| 30 | 300834 | 星辉环材 | 381 | 11,441.43 | 0.01 |
| 31 | 301196 | 唯科科技 | 203 | 7,616.56  | 0.01 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 600900 | 长江电力 | 9,726,030.00 | 2.07           |
| 2  | 002013 | 中航机电 | 8,154,101.00 | 1.74           |
| 3  | 600012 | 皖通高速 | 6,812,831.14 | 1.45           |
| 4  | 605266 | 健之佳  | 3,246,895.00 | 0.69           |
| 5  | 002839 | 张家港行 | 1,777,501.00 | 0.38           |
| 6  | 000672 | 上峰水泥 | 1,708,335.00 | 0.36           |
| 7  | 603712 | 七一二  | 1,654,090.00 | 0.35           |
| 8  | 601390 | 中国中铁 | 1,588,600.00 | 0.34           |
| 9  | 600028 | 中国石化 | 922,700.00   | 0.20           |
| 10 | 688586 | 江航装备 | 836,159.51   | 0.18           |
| 11 | 600377 | 宁沪高速 | 787,624.00   | 0.17           |
| 12 | 601658 | 邮储银行 | 781,400.00   | 0.17           |
| 13 | 600893 | 航发动力 | 565,500.00   | 0.12           |
| 14 | 601111 | 中国国航 | 491,960.00   | 0.10           |
| 15 | 688220 | 翱捷科技 | 438,499.10   | 0.09           |
| 16 | 301217 | 铜冠铜箔 | 307,716.86   | 0.07           |
| 17 | 600372 | 中航电子 | 304,881.00   | 0.07           |
| 18 | 600765 | 中航重机 | 277,126.00   | 0.06           |
| 19 | 688234 | 天岳先进 | 267,825.65   | 0.06           |
| 20 | 603233 | 大参林  | 264,526.00   | 0.06           |

### 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  | 600900 | 长江电力 | 34,261,093.00 | 7.31           |
| 2  | 002013 | 中航机电 | 33,183,562.00 | 7.08           |
| 3  | 002508 | 老板电器 | 10,980,225.00 | 2.34           |
| 4  | 600377 | 宁沪高速 | 8,111,100.00  | 1.73           |
| 5  | 000672 | 上峰水泥 | 5,431,493.00  | 1.16           |
| 6  | 600029 | 南方航空 | 4,362,506.00  | 0.93           |
| 7  | 601658 | 邮储银行 | 4,081,000.00  | 0.87           |
| 8  | 600461 | 洪城环境 | 3,948,141.00  | 0.84           |
| 9  | 600038 | 中直股份 | 3,777,488.00  | 0.81           |
| 10 | 601390 | 中国中铁 | 2,752,400.00  | 0.59           |
| 11 | 600926 | 杭州银行 | 2,664,594.00  | 0.57           |
| 12 | 600323 | 瀚蓝环境 | 2,042,868.94  | 0.44           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 13 | 002179 | 中航光电 | 1,742,519.00 | 0.37 |
| 14 | 002035 | 华帝股份 | 1,182,429.00 | 0.25 |
| 15 | 002859 | 洁美科技 | 1,144,317.15 | 0.24 |
| 16 | 688330 | 宏力达  | 1,101,485.09 | 0.23 |
| 17 | 002643 | 万润股份 | 1,077,960.00 | 0.23 |
| 18 | 002597 | 金禾实业 | 1,010,702.00 | 0.22 |
| 19 | 002839 | 张家港行 | 1,009,700.00 | 0.22 |
| 20 | 688586 | 江航装备 | 839,784.22   | 0.18 |

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 | 43,524,657.52  |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 138,066,376.88 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 15,026,515.07  | 10.84        |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,029,295.89  | 7.24         |
| 4  | 企业债券      | 41,298,574.26  | 29.80        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 72,387,909.05  | 52.24        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 12,558,809.10  | 9.06         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 141,271,807.48 | 101.95       |

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称           | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 101800751 | 18 中铝集 MTN002B | 100,000 | 10,749,812.60 | 7.76         |
| 2  | 182701    | 18 汇金 01       | 100,000 | 10,529,776.99 | 7.60         |
| 3  | 1880287   | 18 浙国资债 01     | 100,000 | 10,454,917.81 | 7.54         |
| 4  | 101561024 | 15 中电投 MTN004  | 100,000 | 10,400,770.96 | 7.51         |

|   |           |              |         |               |      |
|---|-----------|--------------|---------|---------------|------|
| 5 | 101900051 | 19 华润 MTN001 | 100,000 | 10,362,076.71 | 7.48 |
|---|-----------|--------------|---------|---------------|------|

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细  
无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  
无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细  
无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策  
无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
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 | 56,390.46  |
| 2  | 应收清算款 | —          |
| 3  | 应收股利  | —          |
| 4  | 应收利息  | —          |
| 5  | 应收申购款 | 60,336.36  |
| 6  | 其他应收款 | —          |
| 7  | 待摊费用  | —          |
| 8  | 其他    | —          |
| 9  | 合计    | 116,726.82 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|--------------|--------------|
| 1  | 132018 | G 三峡 EB1 | 8,117,735.62 | 5.86         |
| 2  | 132009 | 17 中油 EB | 2,646,069.41 | 1.91         |

|   |        |          |                 |       |
|---|--------|----------|-----------------|-------|
| 3 | 132015 | 18 中油 EB | 1, 100, 297. 88 | 0. 79 |
| 4 | 113044 | 大秦转债     | 314, 087. 28    | 0. 23 |
| 5 | 110079 | 杭银转债     | 310, 700. 38    | 0. 22 |
| 6 | 110075 | 南航转债     | 69, 918. 53     | 0. 05 |

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 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

| 份额级别       | 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（%） |
| 红土创新稳进混合 A | 1, 004   | 34, 267. 37 | 20, 591, 392. 78 | 59. 85    | 13, 813, 049. 05 | 40. 15    |
| 红土创新稳进混合 C | 1, 536   | 55, 116. 63 | 62, 532, 269. 11 | 73. 86    | 22, 126, 879. 75 | 26. 14    |
| 合计         | 2, 480   | 48, 009. 51 | 83, 123, 661. 89 | 69. 81    | 35, 939, 928. 80 | 30. 19    |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别       | 持有份额总数（份）       | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|------------|-----------------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 红土创新稳进混合 A | 2, 702, 308. 50 | 7. 85       |
|                  | 红土创新稳进混合 C | 514, 712. 19    | 0. 61       |
|                  | 合计         | 3, 217, 020. 69 | 2. 70       |

### 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

无。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                            | 红土创新稳进混合 A     | 红土创新稳进混合 C     |
|-------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2020 年 3 月 6 日）基金份额总额 | 127,745,020.35 | 267,502,827.73 |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 40,741,161.28  | 353,948,921.45 |
| 本报告期基金总申购份额                   | 9,022,596.42   | 61,346,569.16  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | 15,359,315.87  | 330,636,341.75 |
| 本报告期基金拆分变动份额                  | —              | —              |
| 本报告期期末基金份额总额                  | 34,404,441.83  | 84,659,148.86  |

## § 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

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称         | 交易单元数量 | 股票交易           |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|--------------|--------|----------------|------------------|-----------|----------------|----|
|              |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 平安证券         | 2      | 124,459,414.43 | 77.47            | 38,362.19 | 59.69          | —  |
| 兴业证券         | 1      | 36,192,874.58  | 22.53            | 25,904.04 | 40.31          | —  |
| 长江证券         | 1      | —              | —                | —         | —              | —  |
| 东方财富         | 2      | —              | —                | —         | —              | —  |
| 东方证券         | 2      | —              | —                | —         | —              | —  |
| 东兴证券         | 1      | —              | —                | —         | —              | —  |
| 方正证券         | 2      | —              | —                | —         | —              | —  |
| 华创证券         | 2      | —              | —                | —         | —              | —  |
| 华金证券有限责任公司   | 1      | —              | —                | —         | —              | —  |
| 华泰证券         | 2      | —              | —                | —         | —              | —  |
| 信达证券         | 2      | —              | —                | —         | —              | —  |
| 银河证券         | 2      | —              | —                | —         | —              | —  |
| 粤开证券         | 2      | —              | —                | —         | —              | —  |
| 中国国际金融股份有限公司 | 1      | —              | —                | —         | —              | —  |
| 中信建投证券       | 2      | —              | —                | —         | —              | —  |
| 中银国际         | 3      | —              | —                | —         | —              | —  |

|    |  |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|--|
| 证券 |  |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|--|

## 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 (%) |
| 平安证券                 | 84,701,649.20  | 42.93            | 1,266,800,000.00 | 74.54              | -    | -                |
| 兴业证券                 | 112,582,738.81 | 57.07            | 432,700,000.00   | 25.46              | -    | -                |
| 长江证券                 | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 东方财富                 | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 东方证券                 | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 东兴证券                 | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 方正证券                 | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 华创证券                 | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 华金证券<br>有限责任公司       | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 华泰证券                 | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 信达证券                 | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 银河证券                 | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 粤开证券                 | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 中国国际<br>金融股份<br>有限公司 | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 中信建投<br>证券           | -              | -                | -                | -                  | -    | -                |
| 中银国际<br>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自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

| 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              | 20220310-20220630       | 68550213.99 | 0.00 | 8550213.99 | 60000000.00 | 50.39    |

#### 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稳进混合证券投资基金设立的文件
- (2) 红土创新稳进混合证券投资基金基金合同
- (3) 红土创新稳进混合证券投资基金托管协议
- (4) 红土创新稳进混合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) 报告期内红土创新稳进混合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

2022 年 8 月 31 日