

红土创新智能制造混合型发起式证券投资 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：华夏银行股份有限公司

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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 其他指标.....	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	10
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45

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.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45
§ 8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	47
§ 9 开放式基金份额变动.....	47
§ 10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
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.....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
§ 12 备查文件目录.....	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金
基金简称	红土创新智能制造混合型发起式
基金主代码	013250
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 8 日
基金管理人	红土创新基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	184,198,540.03 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资于智能制造相关标的，力求把握中国实施制造强国战略的发展契机，紧追制造升级的高速发展趋势，在严格控制风险的前提下，努力获取超过业绩比较基准的收益，力求实现基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、固定收益类资产投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、股指期货投资策略；6、国债期货投资策略。
业绩比较基准	中证智能制造主题指数收益率×60%+中证全债指数收益率×30%+中证港股通综合指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

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	华夏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	殷喆	郑鹏
	联系电话	0755-33011858	010-85238667
	电子邮箱	yinz@htcfund.com	zhengpeng@hxb.com.cn
客户服务电话		0755-33011866	95577
传真		0755-33011855	010-85238680
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	北京市东城区建国门内大街22号(100005)
办公地址		深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦6楼	北京市东城区建国门内大街22号(100005)
邮政编码		518048	100005
法定代表人		阮菲	李民吉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网	http://www.htcfund.com

址	
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	-30,010,079.22
本期利润	-18,159,792.72
加权平均基金份额本期利润	-0.0965
本期加权平均净值利润率	-11.51%
本期基金份额净值增长率	-9.04%
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	-28,647,776.18
期末可供分配基金份额利润	-0.1555
期末基金资产净值	172,296,917.39
期末基金份额净值	0.9354
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	-6.46%

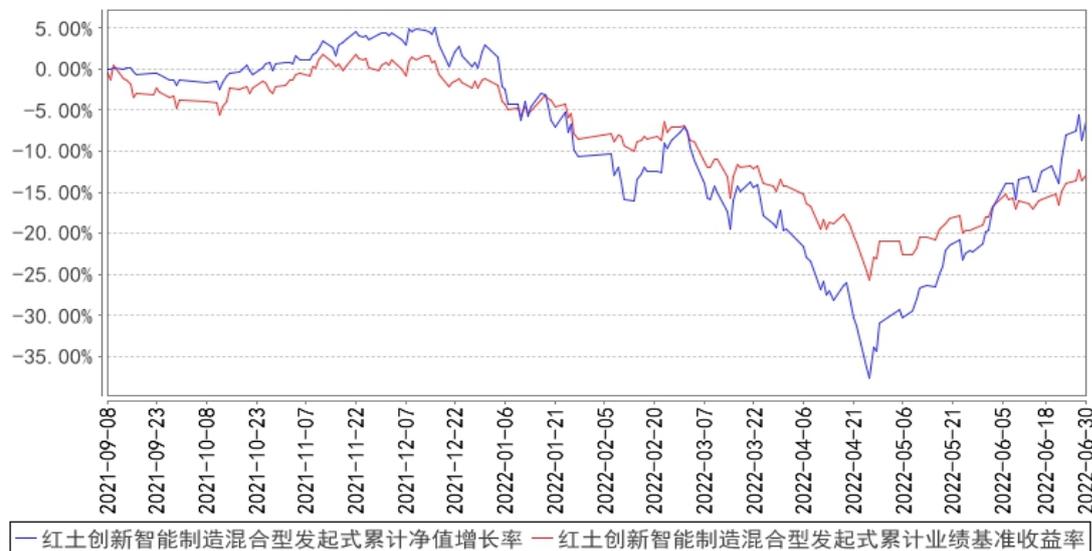
3.2 基金净值表现

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	16.60%	2.01%	6.04%	1.08%	10.56%	0.93%
过去三个月	16.42%	2.38%	1.40%	1.42%	15.02%	0.96%
过去六个月	-9.04%	2.17%	-12.04%	1.31%	3.00%	0.86%
自基金合同生效起至今	-6.46%	1.75%	-13.03%	1.14%	6.57%	0.61%

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

红土创新智能制造混合型发起式累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

红土创新基金管理有限公司（以下简称“红土创新基金”）经中国证监会证监许可【2014】562号文批准设立。红土创新基金总部位于深圳，注册资本为4亿元人民币，是国内首家创投系公募基金管理公司。公司股东为深圳市创新投资集团有限公司，持有股权100%。

红土创新基金在公募基金业务的优良传承基础上，借力股东对创业投资行业的深入理解，外加国内独创的博士后工作站研究支持，充分利用一级市场优势向二级市场延伸，将红土创新基金打造成为以权益类投资为特色的创新型资产管理机构。截至2022年6月30日，红土创新基金共管理16只公募基金，资产管理规模114.01亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王尚博	本基金的基金经理	2021年9月8日	-	10年	香港中文大学全球政治经济专业硕士，历任诺安基金股票交易员、QDII交易员，宝盈基金宏观策略、周期、制造行业研究员，

					基金经理助理。现任本公司红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---------------------------------------

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《红土创新智能制造混合型发起式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

2022 年上半年，国内外环境动荡加剧，俄乌战争、美联储加息、国内疫情反复等因素导致 A 股市场下挫。尤其是以新能源、军工、电子、机械等制造业板块遭到了业绩与估值的双杀，市值跌幅巨大。本基金重点投资的领域亦是受损的重灾区，基金净值出现大幅回撤。面对市场的巨幅调整以及情绪的恐慌，我们在一季度报告中也表明非常坚定的看好中国优势制造业的快速崛起，同时重视短期板块存在的风险特征，加大研究力度合理规避风险，一季报中也对重点投资板块的行业基本面做了梳理。今年 4 月底以来，新兴产业板块反弹强劲：光伏、电动车、机器人等先进制造板块成为市场反弹的先锋，我们的坚守得到了市场的认可。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9354 元；本报告期基金份额净值增长率为-9.04%，业绩比较基准收益率为-12.04%。

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 2022 年下半年，A 股投资环境边际改善明显：国内经济稳增长托底，货币环境相对宽松，美联储紧缩预期充分，国际地缘政治扰动钝化；国内疫情整体可控，防疫政策更加灵活务实，新兴产业发展如火如荼，股票市场交易活跃，资金流动性比较充裕，风险偏好维持高位，主题投资丰富，估值体系回归正轨。我们对于下半年的行情持有乐观态度，坚信以创新为核心驱动力的中国先进制造以及制造业智能化升级的大浪潮在未来 5 年的时间里能够加速发展，从而带来资本市场中成长股的结构性情。

投资方向上我们坚持看好新能源（光伏、风电）、电动车及汽车智能化、国防军工、半导体等产业的巨大投资机会。同时积极捕捉科技创新带来的技术变革，从新科技的研发、推广、商业化等环节深入跟踪研究，把握科技成长股投资的黄金时期。下面分享一下我们对几个重点产业的投资观点：

1、光伏：海外能源成本居高不下，推动欧洲分布式光伏需求快速放量，相关光储行业公司实现戴维斯双击，市值屡创新高。光伏行业正在经历快速的爆发期，是我们目前重点配置的板块之一。下半年关注供给侧成本端的改善，同时高度重视新技术的应用。由于光伏行业技术迭代很快，相关设备公司有望迎来订单爆发增长，重点看好硅料成本改善带来的需求放量以及新技术迭代的设备更新。光伏行业当前也有两个潜在风险：1）、国际油价目前处于相对高位，如果未来有所回调，欧洲的新能源需求是否还能够持续增长；2）2023 年国内电网消纳可能存在一定瓶颈，是否能够在今年的 150GW 的消纳基础上还能大幅增长，将会关系到国内集中式电站的投运总量。

2、电动车及汽车智能化：2021 年新能源渗透率快速提高，今年以来电动车产业受到成本端的压力前所未有（锂、铝、芯片涨价），四月上海疫情扰动相关产业链的生产与交付，但从需求端来看韧性十足。2022 年多家车企发布新款车型，新能源汽车渗透率加速提升，在整体汽车行业不景气的背景下，电动车逆势爆发，中国本土品牌强势崛起。国产品牌凭借着过硬的产品质量与优质的服务，在汽车领域的市占率有显著提升。下半年持续看好新能源车国产化的加速发展，同时向上游的国产化供应链延伸。汽车智能化领域我们也持续关注，在电池成本端得到根本性缓解后，智能化的大浪潮将从智能座舱延展至自动驾驶领域，相关公司技术储备丰富，亦有较好的投资机会。

3、国防军工：国防军工作为国家安全的刚需，在“十四五”、以及“十五五”期间将会得到确定且平稳的渐进式发展。从供给端来看，新一代的武器装备先进程度已经进入世界一流水平，相关上游产业的供应链也逐步成熟，具备快速放量的基础。从需求端来看，随着旧装备型号的到寿，以及新型作战方式的迭代，武器装备以及军工信息化的需求空间广阔。在军民融合的大背景

下，部分优秀的民营企业逐步承接了原有国企科研院所的课题以及批产项目，从而加速军工科技成果快速产业化。总体来看，国防军工在未来 5-10 年具有高景气度，强兑现度，军工板块也是我们长期关注和投资的重要板块之一。

4、 半导体：2021 年半导体由于受限于产能瓶颈，产品价格出现了大幅上涨，今年由于消费电子需求不振，导致整体行业景气度受到一些影响。我们判断消费电子的复苏还需要一定时间，汽车电子相对具有更高的景气度。我们在半导体领域将会重点布局国产化替代加速的设备、材料板块，以及高景气度的汽车半导体板块。

5、 机器人：传统工业机器人领域长期被日本、欧洲制造业强国所垄断，国内企业较难切入。工业机器人要求精度更高，认证周期长，尤其是进入汽车制造流水线则更加困难。今年三季度末，特斯拉预计发布多用途通用机器人，较大可能快速引入中国上游供应链体系，相关的三电系统、减速机、以及上游材料（磁材、铝镁、有机材料）等有望迎来新增长点。中国企业在服务类的机器人中可能发挥巨大规模优势，上游关键零部件的行业天花板被打开，值得持续重视与研究。

在投资策略上，我们坚持将八成以上的仓位布局以上最看好的新型产业，虽然二季度成长股普遍有一定涨幅，相关估值回到合理水平，但三季度新兴产业的基本面边际改善明显，带来明年的行业景气度确定性提升，整体风险收益比依然划算。我们也会不断优化投资组合，基于对下半年市场乐观的判断，我们组合中将会保持较强的进攻性，个股持仓也会更加集中，所布局的企业的业绩增速和估值都会更高。

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

本基金为发起式基金，自本基金合同生效之日起至报告期末本基金合同生效未满三年，根据

《公开募集证券投资基金运作管理办法》规定，基金管理人不对本基金持有人数及基金资产净值进行监控。

§ 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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	11,919,167.12	15,991,156.05
结算备付金		555,509.98	9,847,351.64
存出保证金		232,512.11	520,646.81
交易性金融资产	6.4.7.2	160,674,534.46	167,047,332.05
其中：股票投资		160,674,534.46	167,047,332.05
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		3,600,963.49	-
应收股利		-	-
应收申购款		51,950.86	30,656.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	4,737.35
资产总计		177,034,638.02	193,441,880.02
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,418,984.32	1,353.56
应付赎回款		534,756.85	481,800.38
应付管理人报酬		198,951.65	265,172.79
应付托管费		26,526.86	35,356.37
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	558,500.95	453,253.03
负债合计		4,737,720.63	1,236,936.13
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	184,198,540.03	186,898,042.25
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-11,901,622.64	5,306,901.64
净资产合计		172,296,917.39	192,204,943.89
负债和净资产总计		177,034,638.02	193,441,880.02

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9354 元，基金份额总额 184,198,540.03 份。

6.2 利润表

会计主体：红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-16,739,809.24
1. 利息收入		37,989.18
其中：存款利息收入	6.4.7.13	37,989.18
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）		-28,655,151.69
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-29,167,733.45
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	512,581.76
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	11,850,286.50
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	27,066.77
减：二、营业总支出		1,419,983.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,174,051.63
2. 托管费	6.4.10.2.2	156,540.23
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	89,391.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		-18,159,792.72
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-18,159,792.72
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-18,159,792.72

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金

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）	186,898,042.25	-	5,306,901.64	192,204,943.89
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）	186,898,042.25	-	5,306,901.64	192,204,943.89
三、本期 增减变动 额（减少 以“-”号 填列）	-2,699,502.22	-	-17,208,524.28	-19,908,026.50
（一）、综 合收益总 额	-	-	-18,159,792.72	-18,159,792.72
（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）	-2,699,502.22	-	951,268.44	-1,748,233.78
其中：1. 基金申购 款	13,939,331.65	-	-1,196,816.55	12,742,515.10
2. 基金赎回 款	-16,638,833.87	-	2,148,084.99	-14,490,748.88

(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	184,198,540.03	-	-11,901,622.64	172,296,917.39

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

红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金(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[2021]2250号《关于准予红土创新智能制造混合型发起式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《红土创新智能制造混合型发起式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231,647,026.01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(2021)第0871号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金基金合同》于2021年9月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为231,705,288.48份基金份额,其中认购资金利息折合58,262.47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,基金托管人为华夏银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,003,150.00份基金份额,发起资金认购方承

诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的的股票、存托凭证、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券(包括可分离交易可转债)、可交换债券等)、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：本基金股票资产及存托凭证的投资比例占基金资产的 60%~95%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%)，投资于中国智能制造主题股票及存托凭证的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。基金的业绩比较基准为：中证智能制造主题指数收益率×60%+中证全债指数收益率×30%+中证港股通综合指数收益率×10%。

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》、《红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

除下述会计政策和会计估计外，本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、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、应收利息和应收申购款，金额分别为 15,991,156.05 元、9,847,351.64 元、520,646.81 元、4,737.35 元和 30,656.12 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 15,993,411.26 元、9,849,674.99 元、520,805.60 元、0.00 元和 30,656.12 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 167,047,332.05 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 167,047,332.05 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 1,353.56 元、481,800.38 元、265,172.79 元、35,356.37 元、342,076.21 元和 1,176.82 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 1,353.56 元、481,800.38 元、265,172.79 元、35,356.37 元、342,076.21 元和 1,176.82 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

本基金本报告期末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：

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
活期存款	11,919,167.12
等于：本金	11,917,638.58
加：应计利息	1,528.54
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	11,919,167.12

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	142,632,081.71	-	160,674,534.46	18,042,452.75
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	142,632,081.71	-	160,674,534.46	18,042,452.75

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

无。

6.4.7.5 债权投资

无。

6.4.7.6 其他债权投资

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	13.33
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	409,227.47
其中：交易所市场	409,227.47
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	149,260.15
合计	558,500.95

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	186,898,042.25	186,898,042.25
本期申购	13,939,331.65	13,939,331.65
本期赎回（以“-”号填列）	-16,638,833.87	-16,638,833.87
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	184,198,540.03	184,198,540.03

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

无。

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	352,361.19	4,954,540.45	5,306,901.64
本期利润	-30,010,079.22	11,850,286.50	-18,159,792.72
本期基金份额交易产生的变动数	1,009,941.85	-58,673.41	951,268.44
其中：基金申购款	-761,229.86	-435,586.69	-1,196,816.55
基金赎回款	1,771,171.71	376,913.28	2,148,084.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-28,647,776.18	16,746,153.54	-11,901,622.64

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	21,062.11
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	14,530.19
其他	2,396.88
合计	37,989.18

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	-29,167,733.45
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	-29,167,733.45

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	595,696,743.30
减：卖出股票成本总额	623,275,897.07
减：交易费用	1,588,579.68
买卖股票差价收入	-29,167,733.45

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	512,581.76
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	512,581.76

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	11,850,286.50
股票投资	11,850,286.50
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	11,850,286.50

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	26,502.32
基金转换费收入	564.45
合计	27,066.77

注：1、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。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 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	-
深港通_证券组合费	131.47
合计	89,391.62

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.1.1 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,174,051.63
其中：支付销售机构的客户维护费	322,274.35

注：支付基金管理人红土创新的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	156,540.23

注：支付基金托管人华夏银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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

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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2021 年 9 月 8 日）持有的基金份额	8,001,800.00
报告期初持有的基金份额	8,001,800.00
报告期间申购/买入总份额	8,343,007.53
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	16,344,807.53
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.8700%

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	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
华夏银行	11,919,167.12	21,062.11

注：本基金的银行存款由基金托管人华夏银行保管，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
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	184	7,337.92	5,720.56	-

301103	何氏眼科	2022年 3月14 日	6个月	创业板 新股锁 定	42.50	32.02	181	5,907.50	5,795.62	-
301109	军信股 份	2022年 4月6日	6个月	创业板 新股锁 定	34.81	16.14	378	8,772.12	6,100.92	-
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	92	5,805.20	3,666.20	-
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	743	10,201.39	11,509.07	-
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	311	6,994.39	8,527.62	-
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	203	6,491.94	5,330.78	-
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	438	6,732.06	7,003.62	-
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	1,865	71,727.90	71,727.90	-
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	213	8,177.07	5,090.70	-
301150	中一科 技	2022年 4月14 日	6个月	创业板 新股锁 定	163.56	82.76	60	6,542.40	4,965.60	-
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	164	5,523.52	7,212.72	-
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	275	8,679.00	10,356.50	-
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	173	7,807.49	9,361.03	-
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	154	6,198.50	4,710.86	-
301187	欧圣电 气	2022年 4月13	6个月	创业板 新股锁	21.33	22.54	392	8,361.36	8,835.68	-

		日		定							
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	115	8,804.40	5,970.80		-
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	109	6,199.92	6,149.78		-
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	2,171	8,249.80	13,872.69		-
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	173	6,172.64	5,162.32		-
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	172	5,844.56	4,981.12		-
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	1,098	45,588.96	45,588.96		-
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	123	5,106.96	5,106.96		-
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	114	6,462.66	4,772.04		-
301238	瑞泰新材	2022年 6月10 日	6个月	创业板 新股锁 定	19.18	32.07	431	8,266.58	13,822.17		-
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	213	8,321.91	6,362.31		-
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	806	6,488.30	8,124.48		-
301258	富士莱	2022年 3月21 日	6个月	创业板 新股锁 定	48.30	41.68	111	5,361.30	4,626.48		-
301259	艾布鲁	2022年 4月18 日	6个月	创业板 新股锁 定	18.39	24.94	353	6,491.67	8,803.82		-
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	281	7,547.66	13,226.67		-
301286	侨源股	2022年	6个月	创业板	16.91	19.79	462	7,812.42	9,142.98		-

	份	6月6日		新股锁定						
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	534	6,771.12	11,123.22	-
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	148	7,700.44	8,350.16	-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	3,029	66,425.97	66,425.97	-

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

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工

具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人华夏银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公

司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等。

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	11,919,167.12	-	-	-	11,919,167.12
结算备付金	555,509.98	-	-	-	555,509.98
存出保证金	232,512.11	-	-	-	232,512.11
交易性金融资产	-	-	-	160,674,534.46	160,674,534.46
应收申购款	-	-	-	51,950.86	51,950.86
应收清算款	-	-	-	3,600,963.49	3,600,963.49
资产总计	12,707,189.21	-	-	164,327,448.81	177,034,638.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	534,756.85	534,756.85
应付管理人报酬	-	-	-	198,951.65	198,951.65
应付托管费	-	-	-	26,526.86	26,526.86
应付清算款	-	-	-	3,418,984.32	3,418,984.32
其他负债	-	-	-	558,500.95	558,500.95
负债总计	-	-	-	4,737,720.63	4,737,720.63
利率敏感度缺口	12,707,189.21	-	-	-159,589,728.18	172,296,917.39
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	15,991,156.05	-	-	-	15,991,156.05
结算备付金	9,847,351.64	-	-	-	9,847,351.64
存出保证金	520,646.81	-	-	-	520,646.81
交易性金融资产	-	-	-	167,047,332.05	167,047,332.05
应收利息	-	-	-	4,737.35	4,737.35
应收申购款	-	-	-	30,656.12	30,656.12
资产总计	26,359,154.50	-	-	167,082,725.52	193,441,880.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	481,800.38	481,800.38
应付管理人报酬	-	-	-	265,172.79	265,172.79
应付托管费	-	-	-	35,356.37	35,356.37
应付证券清算款	-	-	-	1,353.56	1,353.56
应付交易费用	-	-	-	342,076.21	342,076.21
其他负债	-	-	-	111,176.82	111,176.82
负债总计	-	-	-	1,236,936.13	1,236,936.13
利率敏感度缺口	26,359,154.50	-	-	-165,845,789.39	192,204,943.89

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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	-	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	12,195,730.40	-	12,195,730.40
资产合计	-	12,195,730.40	-	12,195,730.40
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	12,195,730.40	-	12,195,730.40

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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. 所有外币相对	-	609,786.52

	人民币升值 5%		
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-	-609,786.52

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	160,674,534.46	93.25	167,047,332.05	86.91
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	160,674,534.46	93.25	167,047,332.05	86.91

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证智能制造主题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. 中证智能制造主题指数上升 5%	13,363,631.77	4,773,285.84
	2. 中证智能制造主题指数下降 5%	-13,363,631.77	-4,773,285.84

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	160,257,006.15	161,349,938.55
第二层次	188,849.79	-
第三层次	228,678.52	5,697,393.50
合计	160,674,534.46	167,047,332.05

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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	160,674,534.46	90.76
	其中：股票	160,674,534.46	90.76
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	12,474,677.10	7.05
8	其他各项资产	3,885,426.46	2.19
9	合计	177,034,638.02	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	137,492,469.44	79.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,933,623.86	6.93

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,492,777.41	3.19
M	科学研究和技术服务业	13,872.69	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	19,995.44	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,795.62	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,716,000.00	3.32
S	综合	-	-
	合计	160,674,534.46	93.25

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	002049	紫光国微	70,000	13,280,400.00	7.71
2	601012	隆基绿能	182,000	12,126,660.00	7.04
3	301117	佳缘科技	210,000	11,745,300.00	6.82
4	603185	上机数控	49,000	7,643,510.00	4.44
5	601127	小康股份	90,000	7,298,100.00	4.24
6	688187	时代电气	100,000	6,499,000.00	3.77
7	300751	迈为股份	13,000	6,381,700.00	3.70
8	688776	国光电气	37,000	6,289,630.00	3.65
9	002897	意华股份	140,000	6,174,000.00	3.58
10	603396	金辰股份	65,000	5,916,950.00	3.43
11	603290	斯达半导	15,000	5,788,500.00	3.36
12	000681	视觉中国	400,000	5,716,000.00	3.32
13	605168	三人行	50,745	5,487,056.85	3.18
14	600460	士兰微	100,000	5,200,000.00	3.02
15	300274	阳光电源	52,900	5,197,425.00	3.02
16	600316	洪都航空	170,000	5,140,800.00	2.98
17	002241	歌尔股份	150,000	5,040,000.00	2.93
18	603606	东方电缆	60,000	4,596,000.00	2.67
19	300450	先导智能	70,000	4,422,600.00	2.57
20	600765	中航重机	133,200	4,286,376.00	2.49
21	300373	扬杰科技	60,000	4,275,000.00	2.48
22	600456	宝钛股份	70,000	4,158,000.00	2.41
23	002920	德赛西威	25,800	3,818,400.00	2.22
24	300776	帝尔激光	21,280	3,677,184.00	2.13
25	600111	北方稀土	100,000	3,516,000.00	2.04

26	600416	湘电股份	180,000	3,412,800.00	1.98
27	002129	TCL 中环	50,000	2,944,500.00	1.71
28	301302	华如科技	1,479	89,993.70	0.05
29	301139	元道通信	1,865	71,727.90	0.04
30	688400	凌云光	3,029	66,425.97	0.04
31	001270	铖昌科技	568	57,481.60	0.03
32	301233	盛帮股份	1,221	50,695.92	0.03
33	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.02
34	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.02
35	301215	中汽股份	2,171	13,872.69	0.01
36	301238	瑞泰新材	431	13,822.17	0.01
37	301266	宇邦新材	281	13,226.67	0.01
38	301120	新特电气	743	11,509.07	0.01
39	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
40	301298	东利机械	534	11,123.22	0.01
41	301160	翔楼新材	275	10,356.50	0.01
42	603272	联翔股份	443	9,723.85	0.01
43	301162	国能日新	173	9,361.03	0.01
44	301286	侨源股份	462	9,142.98	0.01
45	301187	欧圣电气	392	8,835.68	0.01
46	301259	艾布鲁	353	8,803.82	0.01
47	301125	腾亚精工	311	8,527.62	0.00
48	301256	华融化学	806	8,124.48	0.00
49	301153	中科江南	164	7,212.72	0.00
50	301137	哈焊华通	438	7,003.62	0.00
51	301248	杰创智能	213	6,362.31	0.00
52	301207	华兰疫苗	109	6,149.78	0.00
53	301109	军信股份	378	6,100.92	0.00
54	301200	大族数控	115	5,970.80	0.00
55	301103	何氏眼科	181	5,795.62	0.00
56	301102	兆讯传媒	184	5,720.56	0.00
57	301135	瑞德智能	203	5,330.78	0.00
58	301216	万凯新材	173	5,162.32	0.00
59	301148	嘉戎技术	213	5,090.70	0.00
60	301222	浙江恒威	172	4,981.12	0.00
61	301150	中一科技	60	4,965.60	0.00
62	301237	和顺科技	114	4,772.04	0.00
63	301181	标榜股份	154	4,710.86	0.00
64	301258	富士莱	111	4,626.48	0.00
65	301110	青木股份	92	3,666.20	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	605168	三人行	18,708,866.00	9.73
2	002897	意华股份	14,213,205.00	7.39
3	601012	隆基绿能	14,137,722.20	7.36
4	000681	视觉中国	13,476,998.45	7.01
5	301117	佳缘科技	13,397,521.62	6.97
6	002291	星期六	12,770,816.94	6.64
7	601127	小康股份	12,361,602.00	6.43
8	002049	紫光国微	12,163,820.00	6.33
9	688599	天合光能	11,885,665.50	6.18
10	603185	上机数控	10,964,708.00	5.70
11	002241	歌尔股份	10,736,935.00	5.59
12	601899	紫金矿业	10,078,629.00	5.24
13	300751	迈为股份	9,777,200.36	5.09
14	300752	隆利科技	9,671,399.60	5.03
15	688776	国光电气	9,599,411.48	4.99
16	688032	禾迈股份	9,254,904.68	4.82
17	300750	宁德时代	9,120,926.00	4.75
18	603290	斯达半导	8,790,129.00	4.57
19	002101	广东鸿图	8,647,656.00	4.50
20	603799	华友钴业	8,483,766.00	4.41
21	600893	航发动力	8,407,250.00	4.37
22	688187	时代电气	8,233,359.63	4.28
23	300274	阳光电源	7,929,716.23	4.13
24	600460	士兰微	7,741,636.00	4.03
25	600111	北方稀土	7,726,636.00	4.02
26	000807	云铝股份	7,672,697.00	3.99
27	002414	高德红外	7,494,595.00	3.90
28	600586	金晶科技	7,314,274.00	3.81
29	002594	比亚迪	7,314,106.00	3.81
30	600765	中航重机	7,039,871.60	3.66
31	002532	天山铝业	6,852,868.00	3.57
32	002920	德赛西威	6,544,416.00	3.40
33	600399	抚顺特钢	6,316,640.00	3.29
34	688516	奥特维	6,201,513.22	3.23
35	000768	中航西飞	6,173,320.76	3.21
36	600732	爱旭股份	5,983,062.00	3.11
37	600316	洪都航空	5,934,559.00	3.09

38	603396	金辰股份	5,928,983.00	3.08
39	688518	联赢激光	5,924,041.09	3.08
40	600760	中航沈飞	5,721,513.00	2.98
41	300724	捷佳伟创	5,692,046.00	2.96
42	600258	首旅酒店	5,541,129.00	2.88
43	600206	有研新材	5,447,596.00	2.83
44	300223	北京君正	5,325,496.00	2.77
45	688311	盟升电子	5,152,175.87	2.68
46	300303	聚飞光电	5,122,012.30	2.66
47	300059	东方财富	4,809,766.67	2.50
48	688126	沪硅产业	4,720,799.38	2.46
49	300450	先导智能	4,597,509.60	2.39
50	02096	先声药业	4,538,493.01	2.36
51	01918	融创中国	4,519,381.38	2.35
52	002268	卫士通	4,509,778.00	2.35
53	300373	扬杰科技	4,434,051.00	2.31
54	00700	腾讯控股	4,373,835.50	2.28
55	600141	兴发集团	4,220,861.25	2.20
56	605117	德业股份	4,192,917.00	2.18
57	002335	科华数据	4,175,812.00	2.17
58	002415	海康威视	4,136,715.00	2.15
59	300438	鹏辉能源	4,112,393.00	2.14
60	688711	宏微科技	3,914,780.07	2.04
61	000707	双环科技	3,887,797.00	2.02
62	600809	山西汾酒	3,862,243.00	2.01

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002291	星期六	17,313,989.00	9.01
2	002897	意华股份	12,735,952.00	6.63
3	688599	天合光能	12,671,603.99	6.59
4	605168	三人行	12,403,971.03	6.45
5	300750	宁德时代	11,696,762.00	6.09
6	688032	禾迈股份	11,401,615.02	5.93
7	601899	紫金矿业	10,103,662.00	5.26
8	300752	隆利科技	9,900,905.00	5.15
9	000768	中航西飞	9,588,480.18	4.99
10	603185	上机数控	9,083,988.75	4.73
11	601127	小康股份	8,755,070.00	4.56
12	002101	广东鸿图	8,700,308.00	4.53
13	601012	隆基绿能	8,597,196.90	4.47

14	603799	华友钴业	8,486,411.70	4.42
15	00700	腾讯控股	8,140,472.55	4.24
16	002414	高德红外	8,130,988.03	4.23
17	600893	航发动力	8,093,955.00	4.21
18	000681	视觉中国	7,619,587.00	3.96
19	002230	科大讯飞	7,612,189.00	3.96
20	300496	中科创达	7,480,500.00	3.89
21	000807	云铝股份	7,107,668.00	3.70
22	002594	比亚迪	6,990,004.80	3.64
23	600586	金晶科技	6,916,938.00	3.60
24	688516	奥特维	6,613,018.02	3.44
25	002532	天山铝业	6,431,054.00	3.35
26	002920	德赛西威	6,421,530.00	3.34
27	688636	智明达	6,195,835.22	3.22
28	300751	迈为股份	6,195,424.00	3.22
29	600206	有研新材	6,123,895.00	3.19
30	300059	东方财富	5,985,879.00	3.11
31	688555	泽达易盛	5,753,365.87	2.99
32	600258	首旅酒店	5,743,175.00	2.99
33	600760	中航沈飞	5,695,211.00	2.96
34	300416	苏试试验	5,613,089.54	2.92
35	600732	爱旭股份	5,446,153.00	2.83
36	600399	抚顺特钢	5,438,108.00	2.83
37	00285	比亚迪电子	5,327,400.77	2.77
38	300223	北京君正	5,244,703.00	2.73
39	688311	盟升电子	5,175,174.24	2.69
40	002268	卫士通	5,122,630.00	2.67
41	601117	中国化学	5,100,593.00	2.65
42	688126	沪硅产业	5,040,672.92	2.62
43	002241	歌尔股份	4,952,809.00	2.58
44	002335	科华数据	4,948,965.00	2.57
45	300438	鹏辉能源	4,764,038.04	2.48
46	002371	北方华创	4,701,937.00	2.45
47	000707	双环科技	4,675,229.00	2.43
48	002049	紫光国微	4,642,837.00	2.42
49	300274	阳光电源	4,573,385.00	2.38
50	02096	先声药业	4,455,335.01	2.32
51	300699	光威复材	4,444,394.00	2.31
52	600141	兴发集团	4,438,964.00	2.31
53	300303	聚飞光电	4,417,070.00	2.30
54	688518	联赢激光	4,382,722.89	2.28
55	01918	融创中国	4,336,766.47	2.26

56	300855	图南股份	4,253,673.00	2.21
57	002361	神剑股份	4,118,252.16	2.14
58	688776	国光电气	4,072,880.77	2.12
59	600809	山西汾酒	4,010,515.00	2.09
60	002459	晶澳科技	4,006,156.00	2.08
61	002415	海康威视	3,973,575.50	2.07

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	605,052,812.98
卖出股票收入（成交）总额	595,696,743.30

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

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	232,512.11
2	应收清算款	3,600,963.49
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	51,950.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,885,426.46

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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
2,288	80,506.35	34,345,687.53	18.65	149,852,852.50	81.35

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	5,846,333.73	3.1700

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	16,344,807.53	8.87	8,001,800.00	4.34	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	2,001,350.00	1.09	2,001,350.00	1.09	三年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	18,346,157.53	9.96	10,003,150.00	5.43	三年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年9月8日）基金份额总额	231,705,288.48
本报告期期初基金份额总额	186,898,042.25
本报告期基金总申购份额	13,939,331.65
减：本报告期基金总赎回份额	16,638,833.87
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	184,198,540.03

§ 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 (%)	
东北证券	2	596,686,996.36	62.71	425,299.40	62.63	-
广发证券	1	305,150,683.72	32.07	218,394.56	32.16	-
长江证券	1	49,691,358.60	5.22	35,345.31	5.21	-
国信证券	2	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
东北证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	红土创新基金管理有限公司关于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

无。

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智能制造混合型发起式证券投资基金设立的文件
- (2) 红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金基金合同
- (3) 红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金托管协议
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (5) 报告期内红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 楼

12.3 查阅方式

公司网站：www.htcxfund.com

红土创新基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日