

红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资  
基金  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：红土创新基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 其他指标.....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
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.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	10
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>10</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	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>11</b>
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.....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	<b>错误！未定义书签。</b>
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.....	<b>错误！未定义书签。</b>

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	错误！未定义书签。
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	错误！未定义书签。
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	错误！未定义书签。
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	43
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	错误！未定义书签。
7.12	投资组合报告附注	44
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>44</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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	45
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>45</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>45</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4	基金投资策略的改变	45
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	46
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8	其他重大事件	48
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>49</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	49
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	49
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>49</b>
12.1	备查文件目录	49
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	红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	红土创新新兴产业混合
基金主代码	001753
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 9 月 23 日
基金管理人	红土创新基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	185,695,060.17 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过灵活的资产配置和对新兴产业的投资管理，拓展大类资产配置空间，在精选处于新兴产业中个股的基础上适度集中投资，在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期增值。
投资策略	本基金的资产配置主要是基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。在股票投资策略方面，本基金将从新兴产业中优选预期成长性较好的公司的股票进行投资。本基金所指的预期成长性较好的公司是指公司所在行业景气度较高且具有可持续性、公司所在行业竞争格局良好以及公司管理层素质较高等标准的公司。在债券投资策略方面，本基金主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。同时，本基金将根据对现货和期货市场的分析，采取多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60% + 中证全债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	红土创新基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	殷喆
	联系电话	0755-33011858
	电子邮箱	yinz@htcfund.com
客户服务电话	0755-33011866	021-60637228
传真	0755-33011855	021-60635778
注册地址	广东省深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市南山区海德三道 1066 号深创投广场 48 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518048	100033

法定代表人	阮菲	田国立
-------	----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.htcxfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	红土创新基金管理有限公司	深圳市南山区海德三道 1066 号 深创投广场 48 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-30,476,577.00
本期利润	-26,420,303.41
加权平均基金份额本期利润	-0.1421
本期加权平均净值利润率	-9.62%
本期基金份额净值增长率	-9.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	55,081,840.37
期末可供分配基金份额利润	0.2966
期末基金资产净值	252,476,405.93
期末基金份额净值	1.360
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	36.00%

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

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

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

4. 本基金合同生效日为 2015 年 09 月 23 日。

### 3.2 基金净值表现

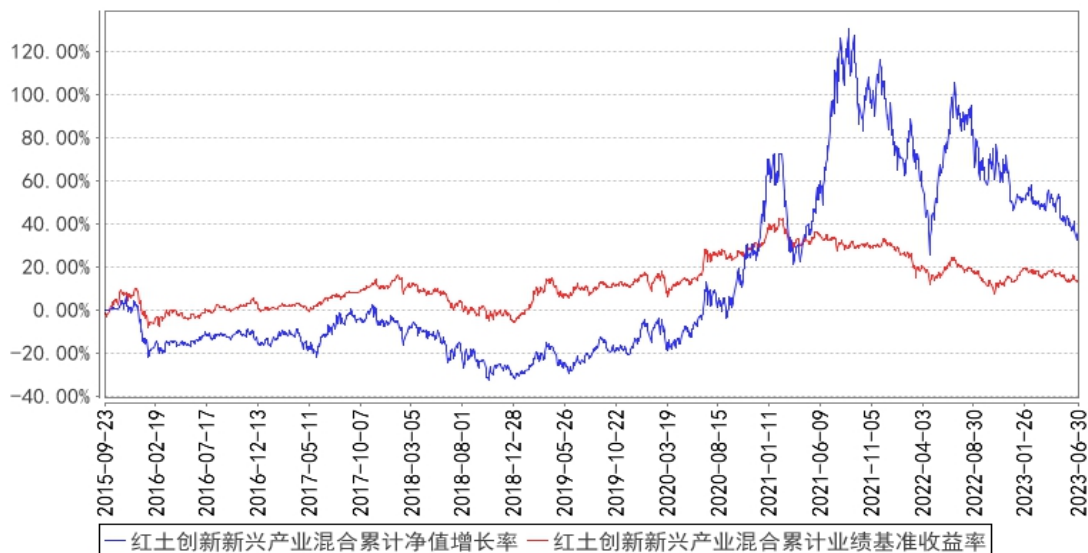
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	-5.09%	1.65%	0.83%	0.52%	-5.92%	1.13%
过去三个月	-10.29%	1.40%	-2.62%	0.49%	-7.67%	0.91%
过去六个月	-9.27%	1.25%	0.18%	0.50%	-9.45%	0.75%
过去一年	-29.53%	1.78%	-8.15%	0.59%	-21.38%	1.19%
过去三年	39.77%	2.24%	-2.72%	0.72%	42.49%	1.52%
自基金合同生效起至今	36.00%	1.78%	13.95%	0.74%	22.05%	1.04%

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

红土创新新兴产业混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金合同生效日至本报告期末已满一年。本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月内，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

红土创新基金管理有限公司（以下简称“红土创新基金”）经中国证监会证监许可【2014】562

号文批准设立。红土创新基金总部位于深圳，注册资本金为 4 亿元人民币，是国内首家创投系公募基金管理公司。公司股东为深圳市创新投资集团有限公司，持有股权 100%。

红土创新基金在公募基金业务的优良传承基础上，借力股东对创业投资行业的深入理解，外加国内独创的博士后工作站研究支持，充分利用一级市场优势向二级市场延伸，将红土创新基金打造成为以权益类投资为特色的创新型资产管理机构。截至 2023 年 6 月 30 日，红土创新基金共管理 22 只公募基金，资产管理规模 225.90 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		
廖星昊	本基金的基金经理	2022 年 12 月 16 日	-	13 年	武汉大学生物学学士，上海财经大学金融数学与金融工程硕士。先后任职于招商证券研究发展中心、太平基金、金信基金、华润元大基金，从事投资研究工作。现任本公司红土创新医疗保健股票基金、红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。



### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在不公平交易及异常交易的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

目前时点来看，随着硅料产能释放，预计硅料价格中枢未来一年将逐步下行，这将持续刺激全球加快装机；国、内外大储在新能源装机消纳需求的倒逼下也将加快启动。近年来国际形势错综复杂，同时新一代国防装备建设进入加速期，军工指数估值已消化至相对低位。伴随着美国对我国科技的制裁加深，国产替代更为重要，未来像信创、半导体的政策扶持力度将进一步提速，再叠加消费电子、汽车的销量数据有望见底回升，产业景气度回升可期。2022 年 4 季度以来，医药领域的集采政策边际趋缓，国内创新药企业已有出海的实力。

本基金将按照基金合同的约定，不断在新兴产业中寻找投资机会，增加配置景气度向上的细分行业中的优质公司。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.360 元；本报告期基金份额净值增长率为-9.27%，业绩比较基准收益率为 0.18%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在目前时点，展望 2023 年下半年：

(1) 对指数，我们始终认为 A 股有其内在的自身运行逻辑，无需过分担忧外围市场的走势影响 A 股。无论从国内宏观经济周期，还是从政策周期来看，相信 2023 年的 A 股表现大概率会好于 2022 年。从库存周期来看，中、美两国均有望在下半年迎来补库存的周期，经济复苏的内在动能增强。短期看，国内出台一系列经济托底政策的可能性在加大。综上，我们认为 2023 年下半年指数的表现会优于上半年；

(2) 对经济，中、美经济在 2023 年将出现错配：中国经济复苏向上，而美国经济相对走弱。与市场观点不同之处在于，我们并不认为美国经济会出现明显的衰退，中国的出口增速可能会好

于预期；

(3) 对汇率，中国经济向好是人民币走强的基础。党的二十大召开后，政策不断优化，经济刺激政策陆续出台，市场信心明显增强；

(4) 对新兴产业，依然重点看好具有全球领先优势的新能源板块，国产替代背景下逐步崛起的信创、半导体等科技产业，新一代国防装备建设进入加速期后的军工行业，逐步具备出海实力的中国创新药企业，以及国家政策大力支持且业绩不断兑现的中药板块等。

总之，我们对 2023 年的市场行情整体保持乐观的态度，影响逐步消退，中国经济回到正常轨道。成长性板块预计今年业绩仍有望维持较高增长，但估值收缩不可避免。

展望全年，预计市场风格将在高估值的成长性板块与低估值的稳增长板块之间反复切换。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值工作组，由投研部门、运营部门及监察稽核部门的相关人员组成。估值工作组负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理，特别是应当保证估值未被歪曲以免对基金份额持有人产生不利影响。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

遵照本基金合同约定，本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人、基金资产净值低于 5000 万的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	13,486,837.44	97,849,795.27
结算备付金		2,204,570.43	978,074.43
存出保证金		318,240.62	218,158.76
交易性金融资产	6.4.7.2	236,249,681.97	175,490,959.43
其中：股票投资		236,249,681.97	175,490,959.43
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		3,765,481.65	-
应收股利		-	-

应收申购款		74,606.08	276,609.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		256,099,418.19	274,813,597.23
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,249,296.03	8,284,381.38
应付赎回款		262,202.38	688,820.14
应付管理人报酬		317,627.73	352,999.69
应付托管费		52,937.97	58,833.29
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,740,948.15	943,297.31
负债合计		3,623,012.26	10,328,331.81
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	185,695,060.17	176,441,648.68
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	66,781,345.76	88,043,616.74
净资产合计		252,476,405.93	264,485,265.42
负债和净资产总计		256,099,418.19	274,813,597.23

注：本基金合同生效日为 2015 年 09 月 23 日，本报告期自基金合同生效日 2015 年 09 月 23 日起至 2023 年 06 月 30 日止。报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.360 元，基金份额总额 185,695,060.17 份。

## 6.2 利润表

会计主体：红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023年 6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
<b>一、营业总收入</b>		-23,949,943.97	-5,897,647.95
1. 利息收入		71,230.51	45,887.37
其中：存款利息收入	6.4.7.13	71,230.51	45,887.37

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）		-28,156,268.33	-22,343,829.50
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-30,833,141.09	-23,387,790.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	2,676,872.76	1,043,960.74
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	4,056,273.59	16,011,069.74
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	78,820.26	389,224.44
<b>减：二、营业总支出</b>		2,470,359.44	2,733,849.42
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,040,710.78	2,266,597.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	340,118.51	377,766.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	89,530.15	89,485.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-26,420,303.41	-8,631,497.37
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-26,420,303.41	-8,631,497.37

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-26,420,303.41	-8,631,497.37

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	176,441,648.68	-	88,043,616.74	264,485,265.42
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）	176,441,648.68	-	88,043,616.74	264,485,265.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	9,253,411.49	-	-21,262,270.98	-12,008,859.49
（一）、综合收益总额	-	-	-26,420,303.41	-26,420,303.41
（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）	9,253,411.49	-	5,158,032.43	14,411,443.92
其中：1. 基金申购	33,702,092.54	-	17,111,752.51	50,813,845.05

款				
2. 基金赎回款	-24,448,681.05	-	-11,953,720.08	-36,402,401.13
(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)	185,695,060.17	-	66,781,345.76	252,476,405.93
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	183,340,745.05	-	176,262,673.04	359,603,418.09
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	183,340,745.05	-	176,262,673.04	359,603,418.09
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-8,394,961.85	-	-13,523,138.59	-21,918,100.44

(一)、综合收益总额	-	-	-8,631,497.37	-8,631,497.37
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-8,394,961.85	-	-4,891,641.22	-13,286,603.07
其中：1. 基金申购款	55,377,003.02	-	38,105,248.86	93,482,251.88
2. 基金赎回款	-63,771,964.87	-	-42,996,890.08	-106,768,854.95
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	174,945,783.20	-	162,739,534.45	337,685,317.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

冀洪涛	周厚桥	焦小川
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人



## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1625号《关于准予红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由红土创新基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币244,770,309.73元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第1099号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年9月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为244,976,374.41份基金份额,其中认购资金利息折合206,064.68份基金份额。本基金的基金管理人为红土创新基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、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、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购等)、货币市场工具、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的0%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率 $\times$ 60%+中证全债指数收益率 $\times$ 40%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018

年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	13,486,837.44
等于：本金	13,484,641.98
加：应计利息	2,195.46
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	13,486,837.44
----	---------------

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	227,499,565.13	-	236,249,681.97	8,750,116.84
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	227,499,565.13	-	236,249,681.97	8,750,116.84

#### 6.4.7.3 其他资产

无。

#### 6.4.7.4 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	502.58
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,651,185.42
其中：交易所市场	1,651,185.42
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
合计	1,740,948.15

#### 6.4.7.5 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	176,441,648.68	176,441,648.68
本期申购	33,702,092.54	33,702,092.54
本期赎回（以“-”号填列）	-24,448,681.05	-24,448,681.05
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	185,695,060.17	185,695,060.17

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。

#### 6.4.7.6 其他综合收益

#### 6.4.7.7 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	81,032,471.70	7,011,145.04	88,043,616.74
本期利润	-30,476,577.00	4,056,273.59	-26,420,303.41
本期基金份额交易产生的变动数	4,525,945.67	632,086.76	5,158,032.43
其中：基金申购款	14,648,786.99	2,462,965.52	17,111,752.51
基金赎回款	-10,122,841.32	-1,830,878.76	-11,953,720.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,081,840.37	11,699,505.39	66,781,345.76

#### 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	44,183.59
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	24,747.75
其他	2,299.17
合计	71,230.51

#### 6.4.7.9 股票投资收益

##### 6.4.7.9.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-30,833,141.09
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	-30,833,141.09

#### 6.4.7.9.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,254,774,192.71
减：卖出股票成本总额	2,279,676,942.84
减：交易费用	5,930,390.96
买卖股票差价收入	-30,833,141.09

#### 6.4.7.10 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,676,872.76
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	2,676,872.76

#### 6.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,056,273.59
股票投资	4,056,273.59
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	4,056,273.59

#### 6.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	77,169.84
基金转换费收入	1,650.42
合计	78,820.26

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。

#### 6.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	270.00
合计	89,530.15

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
红土创新基金管理有限公司（“红土创新”）	基金管理人、注册登记机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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

无。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 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	2,040,710.78	2,266,597.96
其中：支付销售机构的客户维护费	526,208.20	662,840.77

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

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 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	340,118.51	377,766.31

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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



#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
基金合同生效日(2015年9月23日)持有的基金份额	0.00	-
报告期初持有的基金份额	6,493,107.82	3,032,490.97
报告期间申购/买入总份额	3,364,737.55	3,460,616.85
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	9,857,845.37	6,493,107.82
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	5.3100%	3.7100%

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例(%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例(%)
深创投	50,060,750.00	26.9600	50,060,750.00	28.3700

##### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	13,486,837.44	44,183.59	20,363,869.45	29,731.71

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 金融工具风险及管理

##### 6.4.12.1 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。

##### 6.4.12.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行

的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本报告期，本基金未持有交易性债券投资。

#### 6.4.12.3 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。

##### 6.4.12.3.1 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，对本基金的综合持仓集中度指标、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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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

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

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

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

#### 6.4.12.4 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。

##### 6.4.12.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	13,486,837.44	-	-	-	13,486,837.44
结算备付金	2,204,570.43	-	-	-	2,204,570.43
存出保证金	318,240.62	-	-	-	318,240.62
交易性金融资产	-	-	-	-236,249,681.97	236,249,681.97
应收申购款	-	-	-	74,606.08	74,606.08
应收清算款	-	-	-	3,765,481.65	3,765,481.65
资产总计	16,009,648.49	-	-	-240,089,769.70	256,099,418.19

负债					
应付赎回款	-	-	-	262,202.38	262,202.38
应付管理人报酬	-	-	-	317,627.73	317,627.73
应付托管费	-	-	-	52,937.97	52,937.97
应付清算款	-	-	-	1,249,296.03	1,249,296.03
其他负债	-	-	-	1,740,948.15	1,740,948.15
负债总计	-	-	-	3,623,012.26	3,623,012.26
利率敏感度缺口	16,009,648.49	-	-	-236,466,757.44	252,476,405.93
上年度末 2022 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	97,849,795.27	-	-	-	97,849,795.27
结算备付金	978,074.43	-	-	-	978,074.43
存出保证金	218,158.76	-	-	-	218,158.76
交易性金融资产	-	-	-	-175,490,959.43	175,490,959.43
应收申购款	-	-	-	276,609.34	276,609.34
资产总计	99,046,028.46	-	-	-175,767,568.77	274,813,597.23
负债					
应付赎回款	-	-	-	688,820.14	688,820.14
应付管理人报酬	-	-	-	352,999.69	352,999.69
应付托管费	-	-	-	58,833.29	58,833.29
应付清算款	-	-	-	8,284,381.38	8,284,381.38
其他负债	-	-	-	943,297.31	943,297.31
负债总计	-	-	-	10,328,331.81	10,328,331.81
利率敏感度缺口	99,046,028.46	-	-	-165,439,236.96	264,485,265.42

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

#### 6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

#### 6.4.12.4.2 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。

#### 6.4.12.4.3 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。

#### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	236,249,681.97	93.57	175,490,959.43	66.35
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	236,249,681.97	93.57	175,490,959.43	66.35

#### 6.4.12.4.3.2 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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）	
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	11,812,484.10	6,127,712.06
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-11,812,484.10	-6,127,712.06

### 6.4.13 公允价值

#### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.13.2.1 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	236,249,681.97	174,687,735.55
第二层次	-	-
第三层次	-	803,223.88
合计	236,249,681.97	175,490,959.43

##### 6.4.13.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

##### 6.4.13.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

##### 6.4.13.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

无。

#### 6.4.14 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	236,249,681.97	92.25

	其中：股票	236,249,681.97	92.25
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	15,691,407.87	6.13
8	其他各项资产	4,158,328.35	1.62
9	合计	256,099,418.19	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	162,403,886.37	64.32
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	8,974,140.00	3.55
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	42,053,238.60	16.66
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,369,348.00	2.13
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	17,449,069.00	6.91
S	综合	-	-
	合计	236,249,681.97	93.57



## 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	600150	中国船舶	408,000	13,427,280.00	5.32
2	600685	中船防务	441,700	13,228,915.00	5.24
3	600329	达仁堂	230,080	10,328,291.20	4.09
4	002230	科大讯飞	134,900	9,167,804.00	3.63
5	002068	黑猫股份	767,500	9,110,225.00	3.61
6	603108	润达医疗	483,000	8,974,140.00	3.55
7	300413	芒果超媒	262,300	8,973,283.00	3.55
8	600557	康缘药业	322,300	8,850,358.00	3.51
9	300049	福瑞股份	383,400	8,818,200.00	3.49
10	600572	康恩贝	1,285,200	8,803,620.00	3.49
11	002739	万达电影	675,900	8,475,786.00	3.36
12	300002	神州泰岳	591,874	8,286,236.00	3.28
13	601989	中国重工	1,699,400	8,191,108.00	3.24
14	000989	九芝堂	563,233	7,795,144.72	3.09
15	603998	方盛制药	616,700	7,776,587.00	3.08
16	300181	佐力药业	633,400	7,733,814.00	3.06
17	002275	桂林三金	427,300	7,695,673.00	3.05
18	002555	三七互娱	194,800	6,794,624.00	2.69
19	300494	盛天网络	270,540	6,706,686.60	2.66
20	002605	姚记科技	141,600	6,574,488.00	2.60
21	000768	中航西飞	225,900	6,042,825.00	2.39
22	300280	紫天科技	112,400	5,369,348.00	2.13
23	002917	金奥博	412,000	5,092,320.00	2.02
24	002025	航天电器	78,700	5,021,060.00	1.99
25	688016	心脉医疗	27,900	5,018,652.00	1.99
26	600422	昆药集团	241,400	5,001,808.00	1.98
27	000999	华润三九	80,300	4,870,998.00	1.93
28	301117	佳缘科技	70,000	4,523,400.00	1.79
29	300719	安达维尔	297,800	4,204,936.00	1.67
30	300395	菲利华	79,100	3,891,720.00	1.54
31	600760	中航沈飞	83,200	3,744,000.00	1.48
32	000663	永安林业	221,500	2,697,870.00	1.07
33	002389	航天彩虹	113,900	2,529,719.00	1.00
34	688239	航宇科技	36,151	2,528,762.45	1.00

## 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	600963	岳阳林纸	32,749,320.39	12.38
2	603688	石英股份	31,945,184.00	12.08
3	600685	中船防务	28,435,761.45	10.75
4	603108	润达医疗	28,007,803.00	10.59
5	600197	伊力特	26,867,411.00	10.16
6	600150	中国船舶	26,770,961.00	10.12
7	603567	珍宝岛	25,398,526.64	9.60
8	001223	欧克科技	25,116,227.00	9.50
9	601138	工业富联	24,655,690.75	9.32
10	300274	阳光电源	24,394,494.08	9.22
11	600326	西藏天路	24,138,244.70	9.13
12	002230	科大讯飞	24,048,560.71	9.09
13	002555	三七互娱	23,722,665.00	8.97
14	600586	金晶科技	23,404,262.53	8.85
15	600600	青岛啤酒	23,402,452.00	8.85
16	002068	黑猫股份	22,928,802.00	8.67
17	002603	以岭药业	22,795,637.00	8.62
18	000651	格力电器	22,424,081.00	8.48
19	600895	张江高科	22,369,297.40	8.46
20	300750	宁德时代	21,924,658.00	8.29
21	002873	新天药业	21,072,042.40	7.97
22	300981	中红医疗	20,965,843.56	7.93
23	600557	康缘药业	20,933,107.00	7.91
24	600329	达仁堂	19,623,971.80	7.42
25	000521	长虹美菱	18,848,873.11	7.13
26	600415	小商品城	18,797,799.50	7.11
27	002864	盘龙药业	18,634,596.07	7.05
28	002517	恺英网络	17,793,870.50	6.73
29	000663	永安林业	17,558,585.00	6.64
30	000821	京山轻机	15,999,198.59	6.05
31	000860	顺鑫农业	15,731,929.99	5.95
32	300494	盛天网络	15,594,208.00	5.90
33	000928	中钢国际	15,522,942.56	5.87
34	300406	九强生物	15,518,464.40	5.87
35	002558	巨人网络	15,499,783.09	5.86
36	301322	绿通科技	15,334,689.96	5.80
37	000989	九芝堂	14,764,124.70	5.58
38	300271	华宇软件	14,552,043.04	5.50

39	603255	鼎际得	14,292,478.00	5.40
40	002624	完美世界	14,266,486.68	5.39
41	300314	戴维医疗	14,087,880.00	5.33
42	601607	上海医药	13,789,514.00	5.21
43	002602	世纪华通	13,638,567.46	5.16
44	603281	N 江瀚	13,522,075.93	5.11
45	002242	九阳股份	13,378,337.00	5.06
46	603222	济民医疗	13,224,734.54	5.00
47	688599	天合光能	13,214,966.48	5.00
48	002275	桂林三金	12,940,249.00	4.89
49	300413	芒果超媒	12,918,655.00	4.88
50	601390	中国中铁	12,784,436.00	4.83
51	603059	倍加洁	12,634,411.25	4.78
52	603039	ST 泛微	12,600,831.60	4.76
53	600819	耀皮玻璃	12,433,488.00	4.70
54	688378	奥来德	12,358,802.23	4.67
55	603508	思维列控	12,099,810.58	4.57
56	603867	新化股份	11,618,871.60	4.39
57	688398	赛特新材	11,586,579.22	4.38
58	002044	美年健康	11,510,962.00	4.35
59	600535	天士力	11,348,194.00	4.29
60	688036	传音控股	11,286,306.34	4.27
61	600572	康恩贝	11,282,204.50	4.27
62	002941	新疆交建	11,233,034.00	4.25
63	002219	新里程	11,231,814.00	4.25
64	601728	中国电信	11,171,945.15	4.22
65	300677	英科医疗	11,007,482.83	4.16
66	301030	仕净科技	10,923,830.00	4.13
67	600750	江中药业	10,702,865.00	4.05
68	688576	N 西山	10,682,111.66	4.04
69	002384	东山精密	10,620,697.00	4.02
70	300113	顺网科技	10,616,290.00	4.01
71	300585	奥联电子	10,238,008.06	3.87
72	300612	宣亚国际	10,212,432.00	3.86
73	600031	三一重工	10,195,473.00	3.85
74	000032	深桑达 A	10,129,659.40	3.83
75	300763	锦浪科技	10,124,862.00	3.83
76	300779	惠城环保	10,106,504.00	3.82
77	002065	东华软件	9,923,078.00	3.75
78	601989	中国重工	9,917,217.00	3.75
79	001301	尚太科技	9,893,304.00	3.74
80	300161	华中数控	9,875,627.00	3.73
81	000938	紫光股份	9,873,355.20	3.73

82	300068	南都电源	9,838,641.60	3.72
83	600976	健民集团	9,762,137.00	3.69
84	600062	华润双鹤	9,688,407.24	3.66
85	600612	老凤祥	9,573,366.00	3.62
86	002409	雅克科技	9,435,211.49	3.57
87	603367	辰欣药业	9,424,257.66	3.56
88	300433	蓝思科技	9,329,576.44	3.53
89	603227	雪峰科技	9,317,329.00	3.52
90	600993	马应龙	9,303,412.98	3.52
91	002458	益生股份	9,301,097.40	3.52
92	600633	浙数文化	9,274,090.00	3.51
93	600477	杭萧钢构	9,263,449.00	3.50
94	300724	捷佳伟创	9,235,528.00	3.49
95	002880	卫光生物	9,085,755.00	3.44
96	002123	梦网科技	9,041,341.64	3.42
97	601668	中国建筑	8,881,063.60	3.36
98	600248	陕建股份	8,825,360.00	3.34
99	600085	同仁堂	8,821,693.00	3.34
100	002121	科陆电子	8,813,452.00	3.33
101	601137	博威合金	8,803,795.00	3.33
102	000425	徐工机械	8,782,499.00	3.32
103	603520	司太立	8,726,184.44	3.30
104	002739	万达电影	8,635,138.00	3.26
105	603200	上海洗霸	8,628,674.29	3.26
106	688053	思科瑞	8,613,761.30	3.26
107	600425	青松建化	8,596,461.00	3.25
108	301117	佳缘科技	8,590,631.00	3.25
109	300002	神州泰岳	8,567,192.52	3.24
110	300396	迪瑞医疗	8,560,443.00	3.24
111	300244	迪安诊断	8,534,111.00	3.23
112	688677	海泰新光	8,518,094.49	3.22
113	600096	云天化	8,506,621.21	3.22
114	002709	天赐材料	8,497,495.89	3.21
115	002756	永兴材料	8,478,123.00	3.21
116	600861	北京人力	8,436,578.00	3.19
117	603896	寿仙谷	8,434,258.00	3.19
118	603439	贵州三力	8,430,239.60	3.19
119	600809	山西汾酒	8,389,659.00	3.17
120	688253	英诺特	8,348,730.70	3.16
121	688111	金山办公	8,338,888.99	3.15
122	601360	三六零	8,293,812.00	3.14
123	300911	亿田智能	8,223,500.25	3.11
124	600422	昆药集团	8,220,261.00	3.11

125	300049	福瑞股份	8,164,086.00	3.09
126	002116	中国海诚	8,103,101.24	3.06
127	600521	华海药业	8,063,892.00	3.05
128	002773	康弘药业	8,051,418.00	3.04
129	300604	长川科技	8,050,614.00	3.04
130	600587	新华医疗	8,036,790.00	3.04
131	002252	上海莱士	8,025,357.00	3.03
132	300725	药石科技	7,992,958.00	3.02
133	300122	智飞生物	7,976,274.00	3.02
134	002155	湖南黄金	7,915,452.98	2.99
135	300026	红日药业	7,875,844.00	2.98
136	002706	良信股份	7,875,323.00	2.98
137	300982	苏文电能	7,870,342.00	2.98
138	600141	兴发集团	7,857,127.92	2.97
139	000999	华润三九	7,838,370.00	2.96
140	300181	佐力药业	7,821,031.00	2.96
141	603998	方盛制药	7,639,772.00	2.89
142	002035	华帝股份	7,390,882.96	2.79
143	688268	华特气体	7,346,608.63	2.78
144	002268	电科网安	7,334,186.00	2.77
145	688017	绿的谐波	7,329,142.38	2.77
146	300678	中科信息	7,285,180.00	2.75
147	300571	平治信息	7,279,501.00	2.75
148	600420	国药现代	7,265,382.00	2.75
149	600839	四川长虹	7,193,590.67	2.72
150	688066	航天宏图	7,164,196.65	2.71
151	601800	中国交建	7,159,406.95	2.71
152	600373	中文传媒	7,122,197.50	2.69
153	688668	鼎通科技	7,120,869.06	2.69
154	600975	新五丰	7,106,054.00	2.69
155	002466	天齐锂业	7,079,118.00	2.68
156	603063	禾望电气	7,060,362.00	2.67
157	600026	中远海能	7,044,987.89	2.66
158	600771	广誉远	7,041,529.00	2.66
159	600989	宝丰能源	7,010,648.00	2.65
160	300608	思特奇	7,007,256.49	2.65
161	600853	龙建股份	7,006,600.14	2.65
162	600702	舍得酒业	6,995,341.00	2.64
163	300776	帝尔激光	6,762,594.20	2.56
164	688636	智明达	6,735,016.98	2.55
165	300855	图南股份	6,733,583.00	2.55
166	688072	拓荆科技	6,718,942.55	2.54
167	688037	芯源微	6,685,494.20	2.53

168	000739	普洛药业	6,663,134.00	2.52
169	002605	姚记科技	6,606,678.00	2.50
170	688029	南微医学	6,575,992.29	2.49
171	002735	王子新材	6,504,360.00	2.46
172	002236	大华股份	6,502,398.00	2.46
173	300033	同花顺	6,478,814.55	2.45
174	603258	电魂网络	6,385,118.00	2.41
175	688658	悦康药业	6,369,106.22	2.41
176	600271	航天信息	5,953,671.00	2.25
177	603466	风语筑	5,868,301.00	2.22
178	300203	聚光科技	5,865,084.00	2.22
179	300510	金冠股份	5,793,399.00	2.19
180	688589	力合微	5,791,423.57	2.19
181	603283	赛腾股份	5,769,493.00	2.18
182	000617	中油资本	5,729,141.00	2.17
183	000768	中航西飞	5,722,698.00	2.16
184	300003	乐普医疗	5,697,755.00	2.15
185	002049	紫光国微	5,653,799.00	2.14
186	300533	冰川网络	5,636,825.00	2.13
187	601186	中国铁建	5,625,221.00	2.13
188	300182	捷成股份	5,625,132.03	2.13
189	300662	科锐国际	5,605,565.00	2.12
190	300654	世纪天鸿	5,594,523.00	2.12
191	603589	口子窖	5,594,329.89	2.12
192	002011	盾安环境	5,586,255.00	2.11
193	688600	皖仪科技	5,444,643.85	2.06
194	688015	交控科技	5,416,097.12	2.05
195	688139	海尔生物	5,411,603.39	2.05
196	603233	大参林	5,386,227.40	2.04
197	600732	爱旭股份	5,371,182.00	2.03
198	600436	片仔癀	5,362,877.00	2.03
199	600285	羚锐制药	5,352,741.00	2.02
200	688390	固德威	5,346,119.96	2.02
201	600276	恒瑞医药	5,333,097.17	2.02
202	002518	科士达	5,293,544.00	2.00

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600963	岳阳林纸	33,400,001.56	12.63

2	603688	石英股份	30,713,933.00	11.61
3	603567	珍宝岛	29,727,928.68	11.24
4	002873	新天药业	26,530,209.19	10.03
5	603255	鼎际得	26,052,603.00	9.85
6	600197	伊力特	26,049,795.64	9.85
7	601138	工业富联	24,789,141.20	9.37
8	600895	张江高科	24,572,357.00	9.29
9	600685	中船防务	23,735,191.00	8.97
10	600600	青岛啤酒	23,512,467.56	8.89
11	300274	阳光电源	23,370,828.24	8.84
12	600557	康缘药业	23,026,295.57	8.71
13	001223	欧克科技	21,907,910.00	8.28
14	002603	以岭药业	21,851,457.20	8.26
15	600326	西藏天路	21,808,795.93	8.25
16	000651	格力电器	21,649,525.00	8.19
17	600586	金晶科技	21,327,264.00	8.06
18	300750	宁德时代	20,916,461.00	7.91
19	000521	长虹美菱	20,792,147.10	7.86
20	300981	中红医疗	19,980,812.78	7.55
21	600415	小商品城	19,801,775.00	7.49
22	002864	盘龙药业	19,473,820.36	7.36
23	603108	润达医疗	18,574,340.00	7.02
24	002517	恺英网络	18,553,068.00	7.01
25	002555	三七互娱	16,588,750.00	6.27
26	002602	世纪华通	16,441,327.77	6.22
27	600329	达仁堂	16,405,499.00	6.20
28	600150	中国船舶	16,129,384.00	6.10
29	000821	京山轻机	15,791,155.75	5.97
30	300406	九强生物	15,751,109.20	5.96
31	300662	科锐国际	15,574,798.00	5.89
32	000663	永安林业	15,457,191.00	5.84
33	600976	健民集团	15,027,587.90	5.68
34	002558	巨人网络	14,869,410.00	5.62
35	002230	科大讯飞	14,615,933.97	5.53
36	300314	戴维医疗	14,345,392.00	5.42
37	000860	顺鑫农业	14,326,151.86	5.42
38	688053	思科瑞	14,212,581.71	5.37
39	000928	中钢国际	14,145,048.56	5.35
40	002624	完美世界	14,112,608.00	5.34
41	002068	黑猫股份	13,874,870.00	5.25
42	601607	上海医药	13,542,119.40	5.12
43	002044	美年健康	13,235,629.00	5.00
44	002242	九阳股份	13,201,763.00	4.99

45	603222	济民医疗	13,061,673.20	4.94
46	300271	华宇软件	13,043,831.88	4.93
47	301322	绿通科技	12,658,806.56	4.79
48	603039	ST 泛微	12,623,380.40	4.77
49	603281	N 江瀚	12,592,293.40	4.76
50	688599	天合光能	12,302,493.87	4.65
51	601728	中国电信	12,178,594.99	4.60
52	688658	悦康药业	12,065,342.07	4.56
53	600535	天士力	12,033,474.00	4.55
54	301117	佳缘科技	11,824,821.16	4.47
55	600750	江中药业	11,721,450.00	4.43
56	688398	赛特新材	11,671,210.56	4.41
57	603059	倍加洁	11,624,712.25	4.40
58	688378	奥来德	11,578,039.10	4.38
59	002219	新里程	11,540,155.00	4.36
60	603508	思维列控	11,499,648.88	4.35
61	600819	耀皮玻璃	11,474,968.00	4.34
62	600522	中天科技	11,237,876.50	4.25
63	601390	中国中铁	11,185,224.00	4.23
64	300203	聚光科技	10,938,123.00	4.14
65	300049	福瑞股份	10,900,317.34	4.12
66	600633	浙数文化	10,844,101.00	4.10
67	300779	惠城环保	10,822,872.00	4.09
68	300113	顺网科技	10,772,964.00	4.07
69	300585	奥联电子	10,733,714.42	4.06
70	603867	新化股份	10,672,930.00	4.04
71	301030	仕净科技	10,593,750.00	4.01
72	002384	东山精密	10,552,149.00	3.99
73	002941	新疆交建	10,546,145.00	3.99
74	600031	三一重工	10,520,389.00	3.98
75	300677	英科医疗	10,221,152.80	3.86
76	300068	南都电源	10,199,334.00	3.86
77	002880	卫光生物	10,182,137.00	3.85
78	600062	华润双鹤	10,153,351.00	3.84
79	000032	深桑达 A	10,143,158.00	3.84
80	000425	徐工机械	9,996,450.00	3.78
81	603439	贵州三力	9,942,888.00	3.76
82	688036	传音控股	9,845,120.18	3.72
83	600993	马应龙	9,654,690.16	3.65
84	300724	捷佳伟创	9,619,584.00	3.64
85	300433	蓝思科技	9,612,448.00	3.63
86	002123	梦网科技	9,574,976.00	3.62
87	000999	华润三九	9,555,976.00	3.61



88	300763	锦浪科技	9,531,904.00	3.60
89	002065	东华软件	9,417,601.00	3.56
90	002409	雅克科技	9,409,734.90	3.56
91	603200	上海洗霸	9,324,815.34	3.53
92	300244	迪安诊断	9,301,521.00	3.52
93	600477	杭萧钢构	9,293,544.00	3.51
94	000938	紫光股份	9,263,932.76	3.50
95	601137	博威合金	9,217,937.00	3.49
96	001301	尚太科技	9,158,078.00	3.46
97	603367	辰欣药业	9,072,514.00	3.43
98	002458	益生股份	8,968,670.73	3.39
99	002121	科陆电子	8,966,793.00	3.39
100	600612	老凤祥	8,919,288.00	3.37
101	300161	华中数控	8,661,139.40	3.27
102	300612	宣亚国际	8,616,482.00	3.26
103	002252	上海莱士	8,492,443.00	3.21
104	300494	盛天网络	8,445,162.00	3.19
105	300026	红日药业	8,431,576.00	3.19
106	600096	云天化	8,403,083.00	3.18
107	603520	司太立	8,386,780.00	3.17
108	688576	N 西山	8,376,237.16	3.17
109	603896	寿仙谷	8,288,530.60	3.13
110	002706	良信股份	8,285,576.00	3.13
111	688677	海泰新光	8,277,677.23	3.13
112	600809	山西汾酒	8,260,444.00	3.12
113	600085	同仁堂	8,253,494.52	3.12
114	688253	英诺特	8,248,036.28	3.12
115	603883	老百姓	8,210,140.00	3.10
116	603227	雪峰科技	8,201,486.64	3.10
117	601668	中国建筑	8,159,376.00	3.09
118	600587	新华医疗	8,134,224.00	3.08
119	688111	金山办公	8,123,581.20	3.07
120	300396	迪瑞医疗	8,075,113.00	3.05
121	300678	中科信息	8,070,256.00	3.05
122	300122	智飞生物	8,047,883.00	3.04
123	600425	青松建化	8,042,023.00	3.04
124	002709	天赐材料	7,921,201.00	2.99
125	600248	陕建股份	7,919,216.00	2.99
126	600521	华海药业	7,893,412.65	2.98
127	600861	北京人力	7,880,003.00	2.98
128	000989	九芝堂	7,834,513.00	2.96
129	300725	药石科技	7,832,401.00	2.96
130	600399	抚顺特钢	7,776,181.00	2.94

131	600853	龙建股份	7,707,753.24	2.91
132	600975	新五丰	7,696,866.00	2.91
133	002035	华帝股份	7,694,199.00	2.91
134	603939	益丰药房	7,669,619.00	2.90
135	300982	苏文电能	7,623,647.00	2.88
136	688017	绿的谐波	7,521,093.25	2.84
137	600141	兴发集团	7,479,032.15	2.83
138	002155	湖南黄金	7,456,662.00	2.82
139	300604	长川科技	7,421,937.00	2.81
140	300911	亿田智能	7,419,779.10	2.81
141	002756	永兴材料	7,408,148.70	2.80
142	002268	电科网安	7,353,212.00	2.78
143	301239	普瑞眼科	7,310,088.14	2.76
144	600839	四川长虹	7,295,683.00	2.76
145	601360	三六零	7,274,439.16	2.75
146	688439	振华风光	7,216,126.34	2.73
147	002773	康弘药业	7,053,225.00	2.67
148	600373	中文传媒	7,039,269.00	2.66
149	688072	拓荆科技	7,032,943.63	2.66
150	688668	鼎通科技	6,978,127.29	2.64
151	688029	南微医学	6,942,788.05	2.63
152	688268	华特气体	6,940,099.04	2.62
153	002116	中国海诚	6,917,454.00	2.62
154	688066	航天宏图	6,914,367.55	2.61
155	600702	舍得酒业	6,912,063.00	2.61
156	600420	国药现代	6,881,805.00	2.60
157	000739	普洛药业	6,853,345.00	2.59
158	600771	广誉远	6,834,259.80	2.58
159	601800	中国交建	6,830,514.00	2.58
160	600026	中远海能	6,790,210.00	2.57
161	603063	禾望电气	6,774,753.00	2.56
162	600989	宝丰能源	6,751,560.00	2.55
163	002466	天齐锂业	6,726,958.00	2.54
164	300608	思特奇	6,586,634.00	2.49
165	300776	帝尔激光	6,574,320.00	2.49
166	688636	智明达	6,494,813.38	2.46
167	300855	图南股份	6,476,011.00	2.45
168	300571	平治信息	6,295,432.00	2.38
169	002735	王子新材	6,258,439.00	2.37
170	300533	冰川网络	6,240,205.00	2.36
171	688408	中信博	6,225,760.72	2.35
172	688037	芯源微	6,212,695.12	2.35
173	002737	葵花药业	6,167,523.00	2.33

174	688589	力合微	6,120,941.46	2.31
175	002275	桂林三金	5,937,599.00	2.24
176	300654	世纪天鸿	5,898,141.00	2.23
177	002011	盾安环境	5,873,204.00	2.22
178	603589	口子窖	5,832,902.20	2.21
179	002292	奥飞娱乐	5,798,425.00	2.19
180	603283	赛腾股份	5,727,289.00	2.17
181	603466	风语筑	5,720,983.00	2.16
182	603258	电魂网络	5,701,560.00	2.16
183	600271	航天信息	5,698,329.00	2.15
184	300182	捷成股份	5,690,990.00	2.15
185	300181	佐力药业	5,628,419.00	2.13
186	300033	同花顺	5,622,274.00	2.13
187	300003	乐普医疗	5,534,143.00	2.09
188	600566	济川药业	5,527,326.00	2.09
189	002236	大华股份	5,514,166.00	2.08
190	600276	恒瑞医药	5,456,471.40	2.06
191	688139	海尔生物	5,450,418.28	2.06
192	000617	中油资本	5,438,088.00	2.06
193	300510	金冠股份	5,432,958.00	2.05
194	688600	皖仪科技	5,390,680.92	2.04
195	002049	紫光国微	5,385,228.00	2.04
196	300841	康华生物	5,347,086.50	2.02

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,336,379,391.79
卖出股票收入（成交）总额	2,254,774,192.71

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险，如预期大额申购赎回、大量分红等。

## 7.6 投资组合报告附注

### 7.6.1 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。

### 7.6.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.6.3 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	318,240.62
2	应收清算款	3,765,481.65
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	74,606.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,158,328.35

### 7.6.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 7.6.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
13,862	13,395.98	60,287,959.47	32.47	125,407,100.70	67.53

### 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	775,077.83	0.4200
------------------	------------	--------

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年9月23日）基金份额总额	244,976,374.41
本报告期期初基金份额总额	176,441,648.68
本报告期基金总申购份额	33,702,092.54
减：本报告期基金总赎回份额	24,448,681.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	185,695,060.17

## § 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

本报告期基金管理人、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

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	1	1,069,246,648.68	23.29	771,254.26	23.27	-
兴业证券	2	669,300,089.64	14.58	482,768.27	14.57	-
广发证券	2	657,498,189.43	14.32	474,255.93	14.31	-
海通证券	1	579,163,496.30	12.61	417,753.98	12.60	-
东吴证券	2	467,411,821.55	10.18	337,143.43	10.17	-
国泰君安证券	2	316,700,823.48	6.90	228,439.51	6.89	-
中邮证券	2	287,212,135.57	6.26	207,165.13	6.25	-
申万宏源	2	264,258,540.19	5.76	193,252.93	5.83	-
中信证券	6	223,728,349.66	4.87	161,374.97	4.87	-
天风证券	1	56,633,490.00	1.23	40,848.76	1.23	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

注：1、为节约交易单元资源，我公司在交易所交易系统升级的基础上，对同一银行托管基金进行了席位整合。

2、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- a、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- b、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- c、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- d、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择交易单元：

- a、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- b、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- c、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
安信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	红土创新基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在北京雪球基金销售有限公司申购起点金额的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 21 日
2	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 21 日
3	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海通证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 27 日
4	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆享基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 5 月 10 日
5	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金在国信证券暂停办理相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 5 月 25 日
6	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中金财富为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 2 日
7	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增新兰德为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 14 日
8	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国泰君安为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 19 日
9	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增长江证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 26 日
10	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增蚂蚁基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 27 日



	公告	公司网站	
11	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华泰期货为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 29 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	20230101-20230630	50,060,750.00	0.00	0.00	50,060,750.00	26.9600

#### 产品特有风险

#### 1. 巨额赎回风险

(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；

(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(3) 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

#### 2. 转换运作方式或终止基金合同的风险；

单一投资者巨额赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；

#### 3. 流动性风险

单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- (2) 《红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

- (3) 《红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
- (4) 《红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;
- (6) 报告期内红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 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

2023 年 8 月 31 日