

红土创新智能制造混合型发起式证券投资  
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：华夏银行股份有限公司

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。

基金托管人华夏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.....	5
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.....	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
<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的真实、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.....	15
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40

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	40
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	40
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	40
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	40
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	40
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12	投资组合报告附注	40
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>41</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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	41
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	42
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>42</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>42</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4	基金投资策略的改变	43
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8	其他重大事件	44
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>45</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	45
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	45
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>45</b>
12.1	备查文件目录	45
12.2	存放地点	45
12.3	查阅方式	45

## § 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	152,701,926.53 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
	联系电话	0755-33011858
	电子邮箱	yinz@htcxfund.com
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	深圳市南山区海德三道1066号深创投广场48层	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	-5,249,851.70
本期利润	9,806,179.90
加权平均基金份额本期利润	0.0628
本期加权平均净值利润率	7.48%
本期基金份额净值增长率	8.35%
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	-23,573,096.94
期末可供分配基金份额利润	-0.1544
期末基金资产净值	129,949,538.56
期末基金份额净值	0.8510
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	-14.90%

### 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	2.64%	2.11%	0.99%	1.00%	1.65%	1.11%
过去三个月	1.70%	1.93%	-2.47%	0.99%	4.17%	0.94%
过去六个月	8.35%	1.61%	9.17%	0.92%	-0.82%	0.69%
过去一年	-9.02%	1.85%	0.19%	0.92%	-9.21%	0.93%
自基金合同生效起至今	-14.90%	1.81%	-12.86%	1.03%	-2.04%	0.78%

### 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		
王尚博	本基金的基金经理	2021年9月8日	-	11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，任本公司红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金、红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券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；

3. 报告截止日至批准送出日期间，自 2023 年 8 月 14 日起王尚博离任本基金基金经理；

4. 报告截止日至批准送出日期间，自 2023 年 8 月 14 日起盖俊龙新任本基金基金经理。

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

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

投资策略上依旧延续以基本面为基石的产业景气度趋势投资，寻找高速增长且能够较好兑现业绩的细分行业贝塔作为进攻项，通过选股优选阿尔法提高防御力，降低回撤压力。

#### 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 0.8510 元；本报告期基金份额净值增长率为 8.35%，业绩比较基准收益率为 9.17%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年各类宽基指数偏弱震荡，题材主题行情轮动较快。本基金目前重点配置领域仍然在 TMT、光伏板块，随着今年下半年行业景气度逐步证实，有望带来板块估值修复。同时积极关注和适当配置数字经济、传媒等板块，随着新科技创新硬件成熟度不断完善，数字内容端也将会有较好发展。

##### 1、光伏

2023 年装机有望接近 400GW，同比 40%以上增长，硅料、电池片、组件环节竞争格局加剧，硅片环节受制于石英砂的供给相对保持较高盈利能力。在全年持续产业放量的坚实基本面下，下半年有望迎来排产及装机的景气度驱动行情。长期来看光伏发电占总能源供给的比例还非常低，远期依然具有 10 倍以上的成长空间，相关公司估值已经具有较强吸引力，进入加强配置的区间。重点看好新技术迭代的设备公司以及相关短缺的辅材环节，对于主材链相对谨慎。短期风险警惕海外政策扰动以及交易结构的进一步恶化。

##### 2、储能

一季度储能项目招标量保持快速增长，今年随着新能源发电占比持续提升，远期为了达成 3060 双碳目标的背景下，储能成为了新能源板块中有望爆发的行业，未来三年有望复合增速 80%。结合储能行业特点，电化学储能将成为主流储能方式之一，越来越多上市公司布局发展储能业务。从竞争壁垒来看，首先看公司的资源，其次是稳定性安全性，最后是技术。由于储能行业格局相对分散，首选有资源背景，同时具备一定纵向整合能力的公司，若从 PCS、EMS、电芯、EPC、运维全流程贯通，这类企业的综合盈利能力有较强的保障。行业风险则是格局分散，盈利能力可预测性较弱。

##### 3、TMT 板块

1) 数字经济：围绕着数字产业化、产业数字化以及数字要素展开，对应的是计算机行业的进一步发展和信创领域的加速推进。数字要素作为今年各地政府重点推进的工作，可以预见三大运营商和相关行业上市公司受益明显；

2) 人工智能：由海外 OpenAI 引领的 GPT 映射国内大模型的发展，以及 AIGC 内容生成行业的降本增效，主要利好部分游戏公司以及 IP 丰富的公司，同时 AI 叠加机器人也催化不断，有望在今年有实质性的订单落地；

3) 传媒：同样受益于 AIGC 的发展，游戏、元宇宙、VR/AR 内容等有望生态愈加丰富，整体传媒板块有望迎来估值业绩的双升。

#### 4、电动车

预计今年全年电动车持续承压，汽车行业整体需求不振，燃油车降价促销削弱电车性价比，在电动化渗透率突破 30%的门槛后增速下降。整车厂企业利润向头部集中，行业进入洗牌阶段。锂电中游产能利用率下降后，其公司估值体系从成长切换到周期，行业贝塔不足。全年对电动车持谨慎态度，重点跟踪需求在下半年有无复苏迹象。

#### 5、氢能

氢能作为一种新型的清洁补充能源有望在今年正式进入 GW 级别的放量。2021 年仅 300MW，2022 年 800MW，预计今年将有 2GW 招标体量。行业逻辑也从氢能车切换至绿氢。随着风、光发电成本持续下降，新能源制氢的经济性逐步凸显。氢能下游对应需求空间广阔、冶炼、化工、分布式发电等市场多元。投资端重点跟踪具备低成本核心电解槽装置的公司以及具备上游或下游应用资源的企业。我们认为今年是氢能发展的启动年，挖掘优质标的概率大大提升。

### 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：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	14,759,264.18	13,238,930.56
结算备付金		409,161.55	385,149.64
存出保证金		177,925.46	237,361.46
交易性金融资产	6.4.7.2	115,240,708.62	107,743,111.12
其中：股票投资		115,240,708.62	107,743,111.12
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		15,502.12	8,294.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		130,602,561.93	121,612,847.05
<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		-	1,757,924.06
应付赎回款		75,557.00	17,556.98
应付管理人报酬		163,411.40	157,477.84
应付托管费		21,788.20	20,997.06
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	392,266.77	485,057.31
负债合计		653,023.37	2,439,013.25
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	152,701,926.53	151,728,850.39
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-22,752,387.97	-32,555,016.59
净资产合计		129,949,538.56	119,173,833.80
负债和净资产总计		130,602,561.93	121,612,847.05

注：本基金合同生效日为 2021 年 09 月 08 日，本报告期自基金合同生效日 2021 年 09 月 08 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 0.8510 元，基金份额总额 152,701,926.53 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：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	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年
-----	-----	----------------------------	-----------------------------------

		年 6 月 30 日	6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		10,999,808.92	-16,739,809.24
1. 利息收入		28,914.12	37,989.18
其中：存款利息收入	6.4.7.13	28,914.12	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）		-4,118,386.83	-28,655,151.69
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-4,481,118.58	-29,167,733.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-124,395.64	-
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	487,127.39	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	15,056,031.60	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	33,250.03	27,066.77
<b>减：二、营业总支出</b>		1,193,629.02	1,419,983.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	974,403.11	1,174,051.63
2. 托管费	6.4.10.2.2	129,920.44	156,540.23
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		33.31	-
8. 其他费用	6.4.7.23	89,272.16	89,391.62
<b>三、利润总额（亏损总</b>		9,806,179.90	-18,159,792.72

额以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,806,179.90	-18,159,792.72
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,806,179.90	-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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

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）	151,728,850.39	-	-32,555,016.59	119,173,833.80
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）	151,728,850.39	-	-32,555,016.59	119,173,833.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	973,076.14	-	9,802,628.62	10,775,704.76
（一）、综合收益总额	-	-	9,806,179.90	9,806,179.90
（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）	973,076.14	-	-3,551.28	969,524.86
其中：1. 基金申购款	20,823,810.79	-	-3,116,721.21	17,707,089.58
2. 基金赎回款	-19,850,734.65	-	3,113,169.93	-16,737,564.72
（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）	152,701,926.53	-	-22,752,387.97	129,949,538.56
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	未分配利润	净资产合计

		综合 收益		
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

单位：人民币元

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期会计年度报告一致。

#### 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：

(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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	14,759,264.18
等于：本金	14,757,936.75
加：应计利息	1,327.43
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	14,759,264.18

### 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	112,001,113.74	-	115,240,708.62	3,239,594.88
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	112,001,113.74	-	115,240,708.62	3,239,594.88
----	----------------	---	----------------	--------------

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

### 6.4.7.5 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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.39
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	303,006.23
其中：交易所市场	303,006.23
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
合计	392,266.77

## 6.4.7.10 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	151,728,850.39	151,728,850.39
本期申购	20,823,810.79	20,823,810.79
本期赎回（以“-”号填列）	-19,850,734.65	-19,850,734.65
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	152,701,926.53	152,701,926.53

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
上年度末	-18,576,193.36	-13,978,823.23	-32,555,016.59
本期利润	-5,249,851.70	15,056,031.60	9,806,179.90
本期基金份额交易产生的变动数	252,948.12	-256,499.40	-3,551.28
其中：基金申购款	-2,880,852.41	-235,868.80	-3,116,721.21
基金赎回款	3,133,800.53	-20,630.60	3,113,169.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-23,573,096.94	820,708.97	-22,752,387.97

### 6.4.7.13 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	21,039.76	
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	6,198.95	
其他	1,675.41	
合计	28,914.12	

### 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	
	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	-4,481,118.58	
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	-4,481,118.58	

#### 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	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	406,958,941.33	
减：卖出股票成本总额	410,375,861.37	
减：交易费用	1,064,198.54	
买卖股票差价收入	-4,481,118.58	

#### 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	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
债券投资收益——利息收入	9,246.37	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-133,642.01	
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	-124,395.64

#### 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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	17,327,829.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,439,119.93
减：应计利息总额	20,959.95
减：交易费用	1,392.07
买卖债券差价收入	-133,642.01

#### 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

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 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	487,127.39
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	487,127.39

## 6.4.7.20 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	15,056,031.60
股票投资	15,056,031.60
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	15,056,031.60

## 6.4.7.21 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	15,421.36
基金转换费收入	17,828.67
合计	33,250.03

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 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	-
组合费	12.01
合计	89,272.16

#### 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”）	基金管理人、注册登记机构
华夏银行股份有限公司（“华夏银行”）	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	974,403.11	1,174,051.63
其中：支付销售机构的客户维护费	263,545.65	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 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	129,920.44	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

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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	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	8,001,800.00
报告期初持有的基金份额	16,344,807.53	8,001,800.00
报告期间申购/买入总份额	6,103,515.63	8,343,007.53
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	22,448,323.16	16,344,807.53
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	14.70%	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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		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
华夏银行	14,759,264.18	21,039.76	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（2023 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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

##### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种

所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，对本基金的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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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 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	14,759,264.18	-	-	-	14,759,264.18
结算备付金	409,161.55	-	-	-	409,161.55
存出保证金	177,925.46	-	-	-	177,925.46
交易性金融资产	-	-	-	115,240,708.62	115,240,708.62
应收申购款	-	-	-	15,502.12	15,502.12
资产总计	15,346,351.19	-	-	115,256,210.74	130,602,561.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	75,557.00	75,557.00
应付管理人报酬	-	-	-	163,411.40	163,411.40
应付托管费	-	-	-	21,788.20	21,788.20
其他负债	-	-	-	392,266.77	392,266.77
负债总计	-	-	-	653,023.37	653,023.37
利率敏感度缺口	15,346,351.19	-	-	114,603,187.37	129,949,538.56
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	13,238,930.56	-	-	-	13,238,930.56
结算备付金	385,149.64	-	-	-	385,149.64

存出保证金	237,361.46	-	-	237,361.46
交易性金融资产	-	-	-107,743,111.12	107,743,111.12
应收申购款	-	-	8,294.27	8,294.27
资产总计	13,861,441.66	-	-107,751,405.39	121,612,847.05
负债				
应付赎回款	-	-	17,556.98	17,556.98
应付管理人报酬	-	-	157,477.84	157,477.84
应付托管费	-	-	20,997.06	20,997.06
应付清算款	-	-	1,757,924.06	1,757,924.06
其他负债	-	-	485,057.31	485,057.31
负债总计	-	-	2,439,013.25	2,439,013.25
利率敏感度缺口	13,861,441.66	-	-105,312,392.14	119,173,833.80

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，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 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	115,240,708.62	88.68	107,743,111.12	90.41
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	115,240,708.62	88.68	107,743,111.12	90.41

#### 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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	1. 中证智能制造主题指数上升 5%	5,762,035.43	9,345,644.54
	2. 中证智能制造主题指数下降 5%	-5,762,035.43	-9,345,644.54

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	115,240,708.62	107,595,460.77
第二层次	-	-
第三层次	-	147,650.35
合计	115,240,708.62	107,743,111.12

#### 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 2023 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	115,240,708.62	88.24
	其中：股票	115,240,708.62	88.24
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	15,168,425.73	11.61
8	其他各项资产	193,427.58	0.15
9	合计	130,602,561.93	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	59,908,073.23	46.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,152.56	0.01
E	建筑业	4,606,000.00	3.54
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	39,478,008.28	30.38
J	金融业	5,434,232.63	4.18
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,412,000.00	2.63
M	科学研究和技术服务业	10,358.40	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	2,375,809.92	1.83
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	8,073.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	115,240,708.62	88.68

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000821	京山轻机	420,000	8,593,200.00	6.61
2	002555	三七互娱	200,000	6,976,000.00	5.37
3	002049	紫光国微	62,000	5,781,500.00	4.45
4	688017	绿的谐波	35,000	5,684,000.00	4.37
5	300033	同花顺	31,000	5,433,680.00	4.18
6	688111	金山办公	10,000	4,722,200.00	3.63
7	000032	深桑达 A	140,000	4,606,000.00	3.54
8	601138	工业富联	180,000	4,536,000.00	3.49
9	002292	奥飞娱乐	450,000	4,491,000.00	3.46

10	002558	巨人网络	249,948	4,481,567.64	3.45
11	002425	凯撒文化	700,000	3,941,000.00	3.03
12	688170	德龙激光	85,000	3,805,450.00	2.93
13	002602	世纪华通	500,000	3,795,000.00	2.92
14	002230	科大讯飞	55,000	3,737,800.00	2.88
15	600963	岳阳林纸	500,000	3,685,000.00	2.84
16	300161	华中数控	68,000	3,639,360.00	2.80
17	300418	昆仑万维	90,000	3,625,200.00	2.79
18	688776	国光电气	42,000	3,480,960.00	2.68
19	600415	小商品城	400,000	3,412,000.00	2.63
20	688472	N阿特斯	179,821	3,301,513.56	2.54
21	300548	博创科技	95,000	3,272,750.00	2.52
22	603728	鸣志电器	40,000	3,212,000.00	2.47
23	603636	南威软件	200,000	2,934,000.00	2.26
24	600475	华光环能	199,984	2,375,809.92	1.83
25	603138	海量数据	120,000	2,284,800.00	1.76
26	688576	N西山	15,000	1,995,900.00	1.54
27	600422	昆药集团	91,500	1,895,880.00	1.46
28	002174	游族网络	100,900	1,695,120.00	1.30
29	688246	嘉和美康	30,000	1,256,100.00	0.97
30	001223	欧克科技	13,700	1,246,563.00	0.96
31	002156	通富微电	50,000	1,130,000.00	0.87
32	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.01
33	301330	熵基科技	312	11,163.36	0.01
34	001260	坤泰股份	484	10,401.16	0.01
35	001366	播恩集团	645	9,945.90	0.01
36	301160	翔楼新材	275	9,666.25	0.01
37	001368	通达创智	351	8,922.42	0.01
38	301238	瑞泰新材	431	8,766.54	0.01
39	603065	N宿迁	581	8,656.90	0.01
40	301338	凯格精机	217	8,441.30	0.01
41	301302	华如科技	222	8,169.60	0.01
42	603291	N联合	536	8,152.56	0.01
43	301231	荣信文化	240	8,073.60	0.01
44	301339	通行宝	317	7,966.21	0.01
45	301195	北路智控	165	7,682.40	0.01
46	301327	华宝新能	95	7,515.45	0.01
47	301296	新巨丰	404	6,819.52	0.01
48	301132	满坤科技	226	6,642.14	0.01
49	301152	天力锂能	145	6,475.70	0.00
50	301161	唯万密封	270	6,239.70	0.00
51	301328	维峰电子	109	6,206.46	0.00
52	301306	西测测试	146	5,672.10	0.00

53	301139	元道通信	187	5,402.43	0.00
54	301233	盛帮股份	123	5,322.21	0.00
55	301300	远翔新材	165	5,214.00	0.00
56	301326	捷邦科技	127	4,829.81	0.00
57	301318	维海德	141	4,730.55	0.00
58	301115	建科股份	205	4,686.30	0.00
59	301276	嘉曼服饰	159	4,054.50	0.00
60	301349	信德新材	60	3,008.40	0.00
61	301309	万得凯	99	2,726.46	0.00
62	601136	N 首创	39	552.63	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	300418	昆仑万维	12,797,970.80	10.74
2	000821	京山轻机	11,114,341.48	9.33
3	600050	中国联通	10,313,000.00	8.65
4	600963	岳阳林纸	9,896,606.80	8.30
5	002558	巨人网络	9,730,946.60	8.17
6	002602	世纪华通	8,990,457.99	7.54
7	002555	三七互娱	8,635,592.00	7.25
8	301030	仕净科技	7,974,366.00	6.69
9	002049	紫光国微	7,703,494.00	6.46
10	688256	寒武纪	7,441,960.31	6.24
11	001223	欧克科技	7,194,356.00	6.04
12	300115	长盈精密	7,173,455.00	6.02
13	601138	工业富联	7,112,290.00	5.97
14	300059	东方财富	6,791,790.00	5.70
15	300494	盛天网络	6,671,057.00	5.60
16	002230	科大讯飞	6,249,291.00	5.24
17	300033	同花顺	6,006,604.00	5.04
18	00700	腾讯控股	5,938,329.04	4.98
19	300161	华中数控	5,582,419.00	4.68
20	688053	思科瑞	5,435,945.46	4.56
21	002121	科陆电子	5,308,003.00	4.45
22	002517	恺英网络	4,901,337.82	4.11
23	600481	双良节能	4,817,489.00	4.04
24	000032	深桑达 A	4,769,962.00	4.00
25	600326	西藏天路	4,748,896.70	3.98
26	002425	凯撒文化	4,724,376.00	3.96
27	300776	帝尔激光	4,712,691.00	3.95
28	603728	鸣志电器	4,551,161.00	3.82

29	688111	金山办公	4,449,890.08	3.73
30	002335	科华数据	4,394,470.00	3.69
31	603359	东珠生态	4,333,338.00	3.64
32	000663	永安林业	4,277,973.00	3.59
33	002292	奥飞娱乐	4,220,558.00	3.54
34	688017	绿的谐波	4,207,785.62	3.53
35	301050	雷电微力	4,155,807.00	3.49
36	600941	中国移动	4,147,271.00	3.48
37	601360	三六零	4,133,463.00	3.47
38	688170	德龙激光	3,985,746.52	3.34
39	300274	阳光电源	3,972,866.00	3.33
40	601728	中国电信	3,930,000.00	3.30
41	601390	中国中铁	3,918,790.00	3.29
42	600895	张江高科	3,909,711.00	3.28
43	300510	金冠股份	3,887,500.00	3.26
44	002291	遥望科技	3,628,828.00	3.04
45	300548	博创科技	3,607,379.00	3.03
46	300608	思特奇	3,598,073.00	3.02
47	601595	上海电影	3,594,944.20	3.02
48	300502	新易盛	3,570,194.00	3.00
49	300474	景嘉微	3,538,382.00	2.97
50	600771	广誉远	3,500,935.00	2.94
51	002605	姚记科技	3,500,000.00	2.94
52	688398	赛特新材	3,499,009.16	2.94
53	300144	宋城演艺	3,486,419.00	2.93
54	600415	小商品城	3,460,083.00	2.90
55	688378	奥来德	3,443,849.14	2.89
56	603636	南威软件	3,429,241.00	2.88
57	002869	金溢科技	3,426,283.00	2.88
58	000977	浪潮信息	3,380,000.00	2.84
59	688472	N阿特斯	3,354,645.12	2.81
60	688630	芯碁微装	3,340,532.85	2.80
61	688776	国光电气	3,289,996.48	2.76
62	000837	秦川机床	3,145,396.00	2.64
63	688589	力合微	3,119,092.35	2.62
64	601800	中国交建	3,079,222.00	2.58
65	002414	高德红外	2,989,147.02	2.51
66	300990	同飞股份	2,984,954.00	2.50
67	300687	赛意信息	2,962,628.00	2.49
68	002873	新天药业	2,840,610.66	2.38
69	603260	合盛硅业	2,718,899.00	2.28
70	002735	王子新材	2,661,901.00	2.23
71	002992	宝明科技	2,619,865.00	2.20

72	603138	海量数据	2,615,429.00	2.19
73	300751	迈为股份	2,602,454.00	2.18
74	605111	新洁能	2,542,656.68	2.13
75	600237	铜峰电子	2,427,623.00	2.04
76	300682	朗新科技	2,388,031.00	2.00

#### 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	000821	京山轻机	13,184,057.00	11.06
2	603728	鸣志电器	12,584,293.00	10.56
3	300418	昆仑万维	10,417,968.68	8.74
4	600050	中国联通	9,718,488.00	8.15
5	603688	石英股份	9,311,934.00	7.81
6	688053	思科瑞	8,823,145.70	7.40
7	002517	恺英网络	8,535,499.00	7.16
8	300274	阳光电源	8,288,501.00	6.95
9	688256	寒武纪	7,837,663.69	6.58
10	688017	绿的谐波	7,564,257.01	6.35
11	301030	仕净科技	7,539,033.00	6.33
12	300494	盛天网络	7,461,783.00	6.26
13	002335	科华数据	7,154,048.30	6.00
14	300724	捷佳伟创	6,860,105.00	5.76
15	002602	世纪华通	6,484,744.00	5.44
16	002897	意华股份	6,329,695.00	5.31
17	300115	长盈精密	6,243,031.80	5.24
18	00700	腾讯控股	6,113,055.78	5.13
19	600963	岳阳林纸	6,067,820.00	5.09
20	002558	巨人网络	5,942,871.00	4.99
21	300059	东方财富	5,771,853.00	4.84
22	688776	国光电气	5,718,855.27	4.80
23	603396	金辰股份	5,514,317.00	4.63
24	600326	西藏天路	5,220,065.80	4.38
25	001223	欧克科技	4,955,967.00	4.16
26	300502	新易盛	4,941,133.96	4.15
27	300776	帝尔激光	4,754,687.00	3.99
28	603185	上机数控	4,673,802.84	3.92
29	600586	金晶科技	4,495,742.00	3.77
30	002121	科陆电子	4,387,437.00	3.68
31	601138	工业富联	4,294,759.00	3.60
32	600941	中国移动	4,276,869.00	3.59
33	603359	东珠生态	4,255,146.00	3.57
34	600481	双良节能	4,196,888.00	3.52

35	000663	永安林业	4,064,465.00	3.41
36	688015	交控科技	4,053,215.89	3.40
37	301050	雷电微力	4,044,534.00	3.39
38	300474	景嘉微	3,966,774.00	3.33
39	601390	中国中铁	3,963,937.00	3.33
40	300855	图南股份	3,915,981.00	3.29
41	002291	遥望科技	3,876,577.00	3.25
42	002459	晶澳科技	3,740,439.00	3.14
43	688630	芯碁微装	3,730,245.75	3.13
44	600895	张江高科	3,691,882.28	3.10
45	300161	华中数控	3,609,696.00	3.03
46	605117	德业股份	3,571,977.00	3.00
47	601728	中国电信	3,564,756.00	2.99
48	688589	力合微	3,559,787.86	2.99
49	600771	广誉远	3,442,259.41	2.89
50	300608	思特奇	3,437,874.20	2.88
51	688398	赛特新材	3,432,325.00	2.88
52	300604	长川科技	3,420,369.00	2.87
53	002230	科大讯飞	3,360,768.00	2.82
54	300144	宋城演艺	3,344,844.00	2.81
55	688636	智明达	3,342,700.54	2.80
56	688187	时代电气	3,320,119.95	2.79
57	601360	三六零	3,290,551.00	2.76
58	002049	紫光国微	3,286,876.00	2.76
59	300510	金冠股份	3,281,102.00	2.75
60	601595	上海电影	3,265,482.00	2.74
61	000977	浪潮信息	3,250,343.00	2.73
62	002605	姚记科技	3,127,442.00	2.62
63	000837	秦川机床	3,066,380.00	2.57
64	688378	奥来德	3,057,554.20	2.57
65	002869	金溢科技	3,017,279.00	2.53
66	601800	中国交建	3,004,943.00	2.52
67	002414	高德红外	2,949,391.00	2.47
68	002873	新天药业	2,896,403.70	2.43
69	002324	普利特	2,893,747.00	2.43
70	300687	赛意信息	2,867,470.00	2.41
71	688381	帝奥微	2,855,323.03	2.40
72	603260	合盛硅业	2,760,174.00	2.32
73	300990	同飞股份	2,692,842.00	2.26
74	301239	普瑞眼科	2,610,837.00	2.19
75	605111	新洁能	2,557,949.00	2.15
76	600237	铜峰电子	2,434,434.00	2.04

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	402,817,427.27
卖出股票收入（成交）总额	406,958,941.33

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

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

#### 7.12 投资组合报告附注

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

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

##### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	177,925.46
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,502.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	193,427.58

### 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 (%)
2,183	69,950.49	22,448,323.16	14.70	130,253,603.37	85.30

### 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	4,977,054.06	3.2600

### 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	>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	22,448,323.16	14.70	8,001,800.00	3.45	36 个月
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	2,001,350.00	1.31	2,001,350.00	0.86	36 个月
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	24,449,673.16	16.01	10,003,150.00	4.32	36 个月

#### § 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	151,728,850.39
本报告期基金总申购份额	20,823,810.79
减：本报告期基金总赎回份额	19,850,734.65
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	152,701,926.53

#### § 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的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人 2023 年 2 月 23 日发布公告，胡捷先生自 2023 年 2 月 23 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内，本基金托管人 2023 年 4 月 7 日发布公告，朱绍刚先生自 2023 年 4 月 4 日起

担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

### 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 (%)	
东北证券	2	650,892,784.59	98.24	469,132.79	98.24	-
长江证券	1	11,654,203.40	1.76	8,406.12	1.76	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
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	债券交易	债券回购交易	权证交易
----	------	--------	------

名称	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	34,808,385.99	100.00	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
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
11	红土创新基金管理有限公司关于旗下	中国证监会基金电子披	2023年6月29日

部分基金新增华泰期货为销售机构的公告	露网站、规定报刊及本公司网站
--------------------	----------------

## § 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

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