

红土创新科技创新股票型  
证券投资基金（LOF）  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：红土创新基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 28 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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.9 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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>12</b>
6.1 审计报告基本信息	12
6.2 审计报告的基本内容	13
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>14</b>
7.1 资产负债表	14
7.2 利润表	16
7.3 净资产变动表	17
7.4 报表附注	19
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金资产组合情况	43

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	43
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	50
8.6 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 .....	50
8.7 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 .....	50
8.8 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 .....	50
8.9 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 .....	50
8.10 投资组合报告附注 .....	51
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	52
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
9.4 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 .....	52
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
11.2 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 .....	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
11.4 基金投资策略的改变 .....	53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
11.8 其他重大事件 .....	56
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	58
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
13.1 备查文件目录 .....	59
13.2 存放地点 .....	59
13.3 查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）
基金简称	红土创新科技创新股票（LOF）
场内简称	科创红土 LOF
基金主代码	501201
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 7 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	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	91,847,570.26 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 3 月 5 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含科创板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。
业绩比较基准	本基金的投资策略将依据基金管理人 的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行各大类资产中的个股、个券精选，具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类投资策略等部分组成。
风险收益特征	本基金为股票基金，其预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于中高风险品种。

### 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	中国工商银行股份有限公司
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	95588
传真	0755-33011855	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址	深圳市南山区海德三道 1066 号深创投广场 48 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	阮菲	陈四清

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.htcxfund.com">http://www.htcxfund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-81,174,664.69	-112,931,753.21	200,471,031.47
本期利润	-89,618,167.83	-124,070,951.70	158,366,613.19
加权平均基金份额本期利润	-0.5030	-0.5270	0.6726
本期加权平均净值利润率	-34.30%	-29.74%	38.27%
本期基金份额净值增长率	-52.87%	-24.52%	45.56%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	6,138,902.56	144,202,704.12	257,134,457.33
期末可供分配基金	0.0668	0.6125	1.0921

份额利润			
期末基金资产净值	97,986,472.82	381,896,672.41	505,967,624.11
期末基金份额净值	1.0668	1.6220	2.1490
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-23.56%	62.20%	114.90%

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

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

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

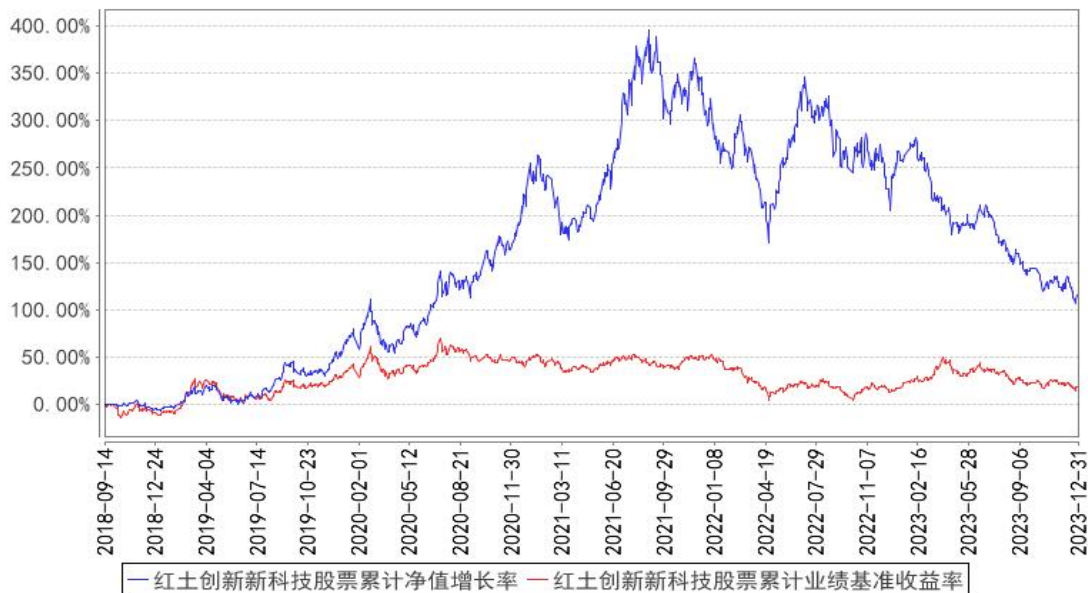
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-14.35%	1.44%	-4.21%	0.61%	-10.14%	0.83%
过去六个月	-32.45%	1.34%	-9.73%	0.58%	-22.72%	0.76%
过去一年	-34.23%	1.31%	-13.08%	0.58%	-21.15%	0.73%
过去三年	-27.74%	1.89%	-25.72%	0.77%	-2.02%	1.12%
自基金合同生效起至今	6.68%	1.91%	-21.33%	0.77%	28.01%	1.14%

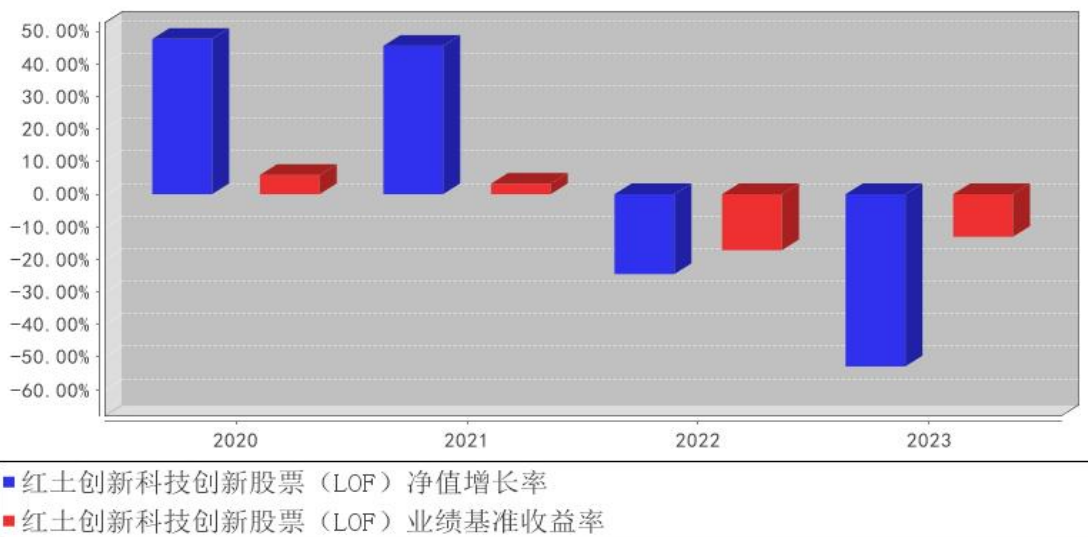
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

红土创新新科技股票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



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

红土创新科技创新股票（LOF）基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

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12月31日，红土创新基金共管理21只公募基金，资产管理规模200.46亿元。

#### 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		
盖俊龙	本基金的基金经理	2021年8月3日	-	17年	历任长城基金管理有限公司行业研究员；宝盈基金管理有限公司研究员、专户投资经理、基金经理。现任本公司投资部总监，红土创新转型精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）、红土创新新科技股票型发起式证券投资基金、红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金、红土创新医疗保健股票型发起式证券投资基金、红土创新科技创新3个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券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。

### 4.2 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、本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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，公司制定了《红土创新管理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。针对上述各个环节，建立了股票库管理制度，投资管理制度，集中交易管理制度，异常交易监控制度等公平交易相关的公司制度。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司旗下投资组合在报告期内交易过程中未发现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

本基金在 2023 年初，基于对光伏、储能等行业的长期成长性以及当下业绩确定性的判断，在上半年配置主要分布在新能源（光伏和储能）、高端制造和 TMT 等板块。2 月份随着新能源行业负贝塔，基金净值调整的较多。在 5、6 月份基金净值虽有所反弹，但下半年北向（外资）资金持续流出，因为外资持仓与机构持仓的相似度较高，主要是一些当下有业绩兑现的公司，所以外资流出对机构持仓股的冲击是比较大的。直到 8 月 28 日政府和监管机构持续对“刺激经济”和“活跃资本市场”的政策加码后，市场有所企稳，但仍属弱市震荡阶段。本基金在下半年的行业配置主要分布在计算机（三方支付）、高端制造（汽车零部件、光伏设备等）、卫星互联网等板块，以及

一些其它自下而上精选的个股。在此期间市场的投资机会主要以博弈为主的交易性机会，基金持仓表现较差。

#### 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 1.0668 元；本报告期基金份额净值增长率为-52.87%，业绩比较基准收益率为-13.08%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，随着中国经济环境转入新阶段，中国经济增长的内生动力将不断积聚增强，深化改革开放的红利将持续释放。此外，美联储加息周期结束对成长股估值的影响可能逐步由负面转向正面。对于 A 股市场，目前投资者对国内经济预期过于悲观，导致市场整体估值较低，但我们对中国经济的韧性和潜力抱有信心，因此预期未来市场存在较多的结构性投资机会，本基金在 4 季度中后期重点配置了卫星互联网板块。卫星互联网可实现全球、全域、全天候互联网服务，我们预计 2024 年将是我国卫星互联网进入大规模发展的元年，已经有多个地区出台了卫星互联网的产业规划，预计随着产业政策、技术进步和卫星发射数量的催化，行业将迎来黄金发展期。2024 年我们将持续跟踪研究卫星互联网的发展情况，认真评估其中的投资机会，也会根据行业变化或市场(风险)因素及时调整投资策略。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。

报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——红土创新基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对红土创新基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 26111 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	红土创新科技创新股票型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了红土创新科技创新股票型证券投资基金(LOF)(原红土创新科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金,以下简称“红土创新科技创新股票基金(LOF)”)的财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表,2023年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了红土创新科技创新股票基金(LOF)2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于红土创新科技创新股票基金(LOF),并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>红土创新科技创新股票基金(LOF)的基金管理人红土创新基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估红土创新科技创新股票基金(LOF)的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算红土创新科技创新股票基金(LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督红土创新科技创新股票基金(LOF)的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影</p>

	<p>响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对红土创新科技创新股票基金（LOF）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致红土创新科技创新股票基金（LOF）不能持续经营。</p> <p>（五）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波   陶文欣
会计师事务所的地址	中国 上海市
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	9,113,623.33	26,357,865.28

结算备付金		946,065.78	3,209,271.34
存出保证金		158,665.08	389,816.93
交易性金融资产	7.4.7.2	85,987,295.36	354,052,266.79
其中：股票投资		85,987,295.36	354,052,266.79
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		3,005,562.76	-
应收股利		-	-
应收申购款		11,411.96	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		99,222,624.27	384,009,220.34
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		546,996.69	-
应付管理人报酬		127,998.00	494,988.07
应付托管费		21,333.01	82,498.01
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	7.4.7.9	539,823.75	1,535,061.85
负债合计		1,236,151.45	2,112,547.93
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	91,847,570.26	235,445,468.54
未分配利润	7.4.7.12	6,138,902.56	146,451,203.87

净资产合计		97,986,472.82	381,896,672.41
负债和净资产总计		99,222,624.27	384,009,220.34

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0668 元，基金份额总额 91,847,570.26 份。

## 7.2 利润表

会计主体：红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-84,809,293.36	-116,608,740.98
1. 利息收入		100,815.91	164,147.90
其中：存款利息收入	7.4.7.13	100,815.91	164,147.90
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-76,480,333.36	-105,633,690.39
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-77,956,039.86	-107,712,180.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	494,726.68
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	1,475,706.50	1,583,763.59
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-8,443,503.14	-11,139,198.49
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	13,727.23	-
<b>减：二、营业总支出</b>		4,808,874.47	7,462,210.72
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,958,262.86	6,241,136.46
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	659,710.61	1,040,189.39



3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	1.32
8. 其他费用	7.4.7.23	190,901.00	180,883.55
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-89,618,167.83	-124,070,951.70
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-89,618,167.83	-124,070,951.70
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-89,618,167.83	-124,070,951.70

### 7.3 净资产变动表

会计主体：红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	235,445,468.54	-	146,451,203.87	381,896,672.41
二、本期期初净资产	235,445,468.54	-	146,451,203.87	381,896,672.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-143,597,898.28	-	-140,312,301.31	-283,910,199.59
（一）、综合收益总额	-	-	-89,618,167.83	-89,618,167.83
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-143,597,898.28	-	-50,694,133.48	-194,292,031.76
其中：1. 基金申购款	1,075,877.67	-	223,926.30	1,299,803.97
2. 基金赎回款	-144,673,775.95	-	-50,918,059.78	-195,591,835.73

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	91,847,570.26	-	6,138,902.56	97,986,472.82
项目	上年度可比期间			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	235,445,468.54	-	270,522,155.57	505,967,624.11
二、本期期初净资产	235,445,468.54	-	270,522,155.57	505,967,624.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-124,070,951.70	-124,070,951.70
（一）、综合收益总额	-	-	-124,070,951.70	-124,070,951.70
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	235,445,468.54	-	146,451,203.87	381,896,672.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至-财务报表由下列负责人签署：

冀洪涛

周厚桥

焦小川

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

红土创新科技创新股票型证券投资基金(LOF)是根据《红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定,由红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“红土创新科技创新 3 年封闭基金”)转型而来。红土创新科技创新 3 年封闭基金的封闭运作期于 2023 年 7 月 23 日届满,自 2023 年 7 月 24 日起自动转为上市开放式基金(LOF),并更名为红土创新科技创新股票型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为红土创新基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新科技创新股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,在封闭运作期内,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含科创板、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、中央银行票据、信用等级在 AAA(含)以上的债券等)、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具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)。股票及存托凭证资产投资比例为基金资产的 0%-100%,其中,投资于科技创新主题相关证券资产比例不低于非现金基金资产的 80%;封闭运作期届满后,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含科创板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。金股票资产占基金资产的比例为 80%~95%,其中投资于科技创新主题相关证券资产比例不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中国战略新兴产业成分指数收益率 $\times$ 50%+中证全债指数收益率 $\times$ 50%。

本财务报表由本基金的基金管理人红土创新基金管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

### 7.4.2 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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、金融负债或权益工具。

##### (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。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期

信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行

调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：（1）赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；（2）该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；（3）该工具所属的类别中（该类别次于其他所有工具类别），所有工具具有相同的特征（例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同）；（4）除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；（5）该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括本基金的任何影响）。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：（1）现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；（2）实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指

在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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后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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成



部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
活期存款	9,113,623.33	26,357,865.28
等于：本金	9,112,547.95	26,355,274.79
加：应计利息	1,075.38	2,590.49
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	9,113,623.33	26,357,865.28

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	92,182,298.75	-	85,987,295.36	-6,195,003.39
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	92,182,298.75	-	85,987,295.36	-6,195,003.39
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	351,803,767.04	-	354,052,266.79	2,248,499.75
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	351,803,767.04	-	354,052,266.79	2,248,499.75

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

无。

#### 7.4.7.5 其他资产

无。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1.38	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	359,822.37	1,355,061.85
其中：交易所市场	359,822.37	1,355,061.85
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	180,000.00
合计	539,823.75	1,535,061.85

#### 7.4.7.7 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	235,445,468.54	235,445,468.54
本期申购	1,075,877.67	1,075,877.67
本期赎回（以“-”号填列）	-144,673,775.95	-144,673,775.95
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	91,847,570.26	91,847,570.26

注：截至 2023 年 12 月 31 日止，本基金于上交所上市的基金份额为 9,247,002.00 份（2022 年 12 月 31 日：12,616,097.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 82,600,568.26 份（2022 年 12 月 31 日：222,829,371.54 份）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 7.4.7.8 其他综合收益

#### 7.4.7.9 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	144,202,704.12	2,248,499.75	146,451,203.87
本期期初	144,202,704.12	2,248,499.75	146,451,203.87
本期利润	-81,174,664.69	-8,443,503.14	-89,618,167.83
本期基金份额交易产生的变动数	-50,167,257.40	-526,876.08	-50,694,133.48
其中：基金申购款	261,301.66	-37,375.36	223,926.30
基金赎回款	-50,428,559.06	-489,500.72	-50,918,059.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,860,782.03	-6,721,879.47	6,138,902.56

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

活期存款利息收入	70,618.22	104,479.87
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	26,281.11	53,485.03
其他	3,916.58	6,183.00
合计	100,815.91	164,147.90

#### 7.4.7.11 股票投资收益

##### 7.4.7.11.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-77,956,039.86	-107,712,180.66
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	-77,956,039.86	-107,712,180.66

##### 7.4.7.11.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	2,345,244,860.60	4,456,415,941.49
减：卖出股票成本总额	2,417,414,015.06	4,552,521,957.00
减：交易费用	5,786,885.40	11,606,165.15
买卖股票差价收入	-77,956,039.86	-107,712,180.66

##### 7.4.7.11.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.12 债券投资收益

##### 7.4.7.12.1 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12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
债券投资收益——利息收入	-	364.07
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	494,362.61
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	-	494,726.68

##### 7.4.7.12.2 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12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	2,455,535.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	1,960,700.00
减：应计利息总额	-	375.09
减：交易费用	-	98.19
买卖债券差价收入	-	494,362.61

#### 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

无。

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	1,475,706.50	1,583,763.59
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,475,706.50	1,583,763.59

## 7.4.7.17 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 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	-8,443,503.14	-11,139,198.49
股票投资	-8,443,503.14	-11,139,198.49
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	-8,443,503.14	-11,139,198.49

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
基金赎回费收入	13,727.23	-
合计	13,727.23	-

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。

## 7.4.7.19 信用减值损失

无。



#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	901.00	883.55
其他	10,000.00	-
合计	190,901.00	180,883.55

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《红土创新基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2024年1月1日起，本基金的管理费年费率由1.50%调低至1.20%；托管费年费率由0.25%调低至0.20%。

#### 7.4.9 关联方关系

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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,958,262.86	6,241,136.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,693,519.82	2,739,666.06
应支付基金管理人的净管理费	2,264,743.04	3,501,470.40

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：

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	659,710.61	1,040,189.39

注：支付基金托管人中国工商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：

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

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2020 年 7 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	20,004,500.00	20,004,500.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-

报告期末持有的基金份额	20,004,500.00	20,004,500.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	21.78%	8.5000%

注：基金管理人红土创新基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

#### 7.4.10.4.2 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

无。

#### 7.4.10.5 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12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	9,113,623.33	70,618.22	26,357,865.28	104,479.87

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

红土创新科技创新 3 年封闭基金为混合型基金，其预期风险收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，以投资战略配售股票为主要投资策略。红土创新科技创新 3 年封闭基金封闭运作期届满转为本基金，本基金为股票型基金，属于证券投资基金中的较高风险品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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。

##### 7.4.13.2 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易

所进行的交易主要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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2023 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)。

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

于本期末，除卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 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，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，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%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，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。于本期末，本基金确认的净赎回申请未超过 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	9,113,623.33	-	-	-	9,113,623.33
结算备付金	946,065.78	-	-	-	946,065.78
存出保证金	158,665.08	-	-	-	158,665.08
交易性金融资产	-	-	-	85,987,295.36	85,987,295.36
应收申购款	-	-	-	11,411.96	11,411.96
应收清算款	-	-	-	3,005,562.76	3,005,562.76
资产总计	10,218,354.19	-	-	89,004,270.08	99,222,624.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	546,996.69	546,996.69
应付管理人报酬	-	-	-	127,998.00	127,998.00
应付托管费	-	-	-	21,333.01	21,333.01
其他负债	-	-	-	539,823.75	539,823.75
负债总计	-	-	-	1,236,151.45	1,236,151.45

利率敏感度缺口	10,218,354.19	-	-	87,768,118.63	97,986,472.82
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					
货币资金	26,357,865.28	-	-	-	26,357,865.28
结算备付金	3,209,271.34	-	-	-	3,209,271.34
存出保证金	389,816.93	-	-	-	389,816.93
交易性金融资产	-	-	-	-354,052,266.79	354,052,266.79
资产总计	29,956,953.55	-	-	-354,052,266.79	384,009,220.34
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	494,988.07	494,988.07
应付托管费	-	-	-	82,498.01	82,498.01
其他负债	-	-	-	1,535,061.85	1,535,061.85
负债总计	-	-	-	2,112,547.93	2,112,547.93
利率敏感度缺口	29,956,953.55	-	-	-351,939,718.86	381,896,672.41

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2022 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	85,987,295.36	87.75	354,052,266.79	92.71
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	85,987,295.36	87.75	354,052,266.79	92.71

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	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12月31日)	上年度末(2022年12月31日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	10,669,401.94	34,587,903.13
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-10,669,401.94	-34,587,903.13

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。



## 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	85,987,295.36	351,933,606.86
第二层次	-	-
第三层次	-	2,118,659.93
合计	85,987,295.36	354,052,266.79

## 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

## 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

## 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	-	
期初余额	-	2,118,659.93	2,118,659.93
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	89,558.40	89,558.40
转出第三层次	-	2,831,229.15	2,831,229.15
当期利得或损失总额	-	623,010.82	623,010.82
其中：计入损益的利得或损失	-	623,010.82	623,010.82
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,053,981.64	1,053,981.64
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	4,217,098.93	4,217,098.93
转出第三层次	-	-3,395,234.94	-3,395,234.94
当期利得或损失总额	-	242,814.30	242,814.30
其中：计入损益的利得或损失	-	242,814.30	242,814.30
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,118,659.93	2,118,659.93
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-73,680.30	-73,680.30

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有第三层次的交易性金融资产（2022 年 12 月 31 日：本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资）。于 2023 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资（2022 年度：同）。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允	采用的估	不可观察输入值		

	价值	值技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
交易性金融资产-股票投资	2,118,659.93	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.1891-2.4756	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	85,987,295.36	86.66
	其中：股票	85,987,295.36	86.66
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	10,059,689.11	10.14
8	其他各项资产	3,175,639.80	3.20
9	合计	99,222,624.27	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	74,175,243.70	75.70
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	5,997,750.00	6.12
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,814,301.66	5.93
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	85,987,295.36	87.75

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 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	688270	臻镭科技	79,937	5,466,092.06	5.58
2	002465	海格通信	385,200	4,949,820.00	5.05
3	001223	欧克科技	70,001	4,308,561.55	4.40
4	600879	航天电子	556,900	4,293,699.00	4.38
5	688776	国光电气	42,124	4,102,456.36	4.19
6	300455	康拓红外	340,400	4,064,376.00	4.15
7	688636	智明达	61,164	3,987,892.80	4.07
8	300762	上海瀚讯	262,400	3,956,992.00	4.04
9	688311	盟升电子	74,678	3,809,324.78	3.89
10	301306	西测测试	91,500	3,622,485.00	3.70
11	301117	佳缘科技	63,800	3,477,738.00	3.55
12	688523	航天环宇	119,827	3,213,760.14	3.28

13	603712	七一二	98,000	3,087,980.00	3.15
14	002446	盛路通信	366,000	3,037,800.00	3.10
15	301050	雷电微力	51,300	2,988,738.00	3.05
16	688543	国科军工	53,053	2,965,662.70	3.03
17	603305	旭升集团	148,900	2,937,797.00	3.00
18	301517	N 陕华达	52,500	2,934,750.00	3.00
19	688048	长光华芯	45,224	2,834,188.08	2.89
20	002268	电科网安	112,200	2,520,012.00	2.57
21	688053	思科瑞	43,889	2,191,816.66	2.24
22	688375	国博电子	26,869	2,136,891.57	2.18
23	300101	振芯科技	91,400	2,086,662.00	2.13
24	688313	仕佳光子	161,063	2,047,110.73	2.09
25	001270	铖昌科技	32,000	2,006,720.00	2.05
26	688143	长盈通	43,349	1,532,387.15	1.56
27	688439	振华风光	15,998	1,425,581.78	1.45

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	002123	梦网科技	45,561,658.00	11.93
2	300496	中科创达	36,203,711.33	9.48
3	603688	石英股份	34,505,630.00	9.04
4	001223	欧克科技	34,370,250.09	9.00
5	300510	金冠股份	33,531,073.03	8.78
6	300031	宝通科技	24,002,044.00	6.28
7	688676	金盘科技	22,002,016.78	5.76
8	002865	钧达股份	21,805,920.66	5.71
9	002458	益生股份	21,490,651.55	5.63
10	603283	赛腾股份	21,201,100.00	5.55
11	300130	新国都	20,760,530.24	5.44
12	300842	帝科股份	20,664,127.00	5.41
13	002869	金溢科技	19,653,926.00	5.15
14	002234	民和股份	19,599,578.00	5.13
15	300573	兴齐眼药	19,540,076.00	5.12
16	002317	众生药业	19,421,046.00	5.09
17	688390	固德威	18,820,715.41	4.93
18	300144	宋城演艺	18,621,763.60	4.88
19	688036	传音控股	17,933,574.10	4.70
20	600895	张江高科	17,568,177.76	4.60
21	688383	新益昌	17,265,228.21	4.52
22	002129	TCL 中环	17,112,995.00	4.48

23	600685	中船防务	16,624,605.64	4.35
24	688668	鼎通科技	16,300,016.97	4.27
25	600050	中国联通	15,798,947.09	4.14
26	600475	华光环能	15,768,715.44	4.13
27	600415	小商品城	15,713,334.00	4.11
28	603212	赛伍技术	15,493,463.00	4.06
29	688598	金博股份	15,301,963.85	4.01
30	002607	中公教育	15,040,465.00	3.94
31	600537	亿晶光电	14,876,429.88	3.90
32	603081	大丰实业	14,821,039.00	3.88
33	605168	三人行	14,712,481.26	3.85
34	300820	英杰电气	14,549,103.92	3.81
35	301322	绿通科技	13,984,705.52	3.66
36	600732	爱旭股份	13,724,785.00	3.59
37	300533	冰川网络	13,501,520.00	3.54
38	002368	太极股份	13,207,219.45	3.46
39	002472	双环传动	13,190,328.00	3.45
40	300360	炬华科技	13,055,845.00	3.42
41	002121	科陆电子	12,902,991.50	3.38
42	688048	长光华芯	12,849,794.24	3.36
43	688103	国力股份	12,634,954.67	3.31
44	002446	盛路通信	12,420,941.00	3.25
45	601882	海天精工	12,228,267.73	3.20
46	300314	戴维医疗	12,196,782.00	3.19
47	300982	苏文电能	12,133,860.60	3.18
48	600197	伊力特	12,120,005.05	3.17
49	603516	淳中科技	12,064,927.00	3.16
50	603871	嘉友国际	11,939,964.32	3.13
51	688439	振华风光	11,892,997.98	3.11
52	300634	彩讯股份	11,769,335.00	3.08
53	002315	焦点科技	11,551,306.60	3.02
54	002602	世纪华通	11,263,355.00	2.95
55	603108	润达医疗	11,208,512.00	2.93
56	002864	盘龙药业	11,063,118.70	2.90
57	300614	百川畅银	11,029,227.00	2.89
58	688579	山大地纬	10,857,745.38	2.84
59	688029	南微医学	10,763,880.74	2.82
60	603040	新坐标	10,465,612.00	2.74
61	301050	雷电微力	10,458,550.40	2.74
62	002236	大华股份	10,442,753.00	2.73
63	600963	岳阳林纸	10,404,514.46	2.72
64	600062	华润双鹤	10,306,889.00	2.70
65	603773	沃格光电	10,298,905.20	2.70

66	000999	华润三九	10,287,032.00	2.69
67	600705	中航产融	10,202,072.00	2.67
68	002738	中矿资源	10,105,493.76	2.65
69	300161	华中数控	9,938,553.00	2.60
70	603359	东珠生态	9,762,668.00	2.56
71	301030	仕净科技	9,301,167.00	2.44
72	300081	恒信东方	9,279,402.00	2.43
73	603258	电魂网络	9,275,573.00	2.43
74	300033	同花顺	9,237,089.00	2.42
75	301117	佳缘科技	9,159,821.00	2.40
76	002735	王子新材	9,066,385.52	2.37
77	300672	国科微	9,048,254.22	2.37
78	600853	龙建股份	8,971,623.60	2.35
79	301179	泽宇智能	8,881,358.60	2.33
80	688636	智明达	8,877,239.51	2.32
81	300438	鹏辉能源	8,874,179.00	2.32
82	301052	果麦文化	8,862,142.00	2.32
83	600166	福田汽车	8,791,880.00	2.30
84	688305	科德数控	8,784,092.36	2.30
85	300762	上海瀚讯	8,754,922.44	2.29
86	002946	新乳业	8,680,944.25	2.27
87	688111	金山办公	8,662,274.15	2.27
88	000661	长春高新	8,647,353.21	2.26
89	600150	中国船舶	8,515,407.06	2.23
90	002401	中远海科	8,499,003.01	2.23
91	300592	华凯易佰	8,473,925.00	2.22
92	000860	顺鑫农业	8,431,119.20	2.21
93	688392	骄成超声	8,226,471.11	2.15
94	301162	国能日新	8,126,670.86	2.13
95	688539	高华科技	8,080,826.83	2.12
96	002698	博实股份	8,067,623.14	2.11
97	002409	雅克科技	7,958,757.00	2.08
98	000997	新大陆	7,941,824.00	2.08
99	002139	拓邦股份	7,820,790.00	2.05
100	301328	维峰电子	7,791,385.00	2.04
101	600389	江山股份	7,744,591.38	2.03

#### 8.4.2 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	603688	石英股份	60,924,417.91	15.95
2	301030	仕净科技	44,436,056.00	11.64
3	002123	梦网科技	42,863,493.00	11.22

4	002458	益生股份	38,264,012.28	10.02
5	300496	中科创达	34,847,005.21	9.12
6	002865	钧达股份	34,435,672.01	9.02
7	002234	民和股份	32,736,055.55	8.57
8	300510	金冠股份	31,000,283.00	8.12
9	603728	鸣志电器	29,726,673.88	7.78
10	001223	欧克科技	28,662,392.00	7.51
11	300438	鹏辉能源	24,829,927.00	6.50
12	300031	宝通科技	24,570,156.00	6.43
13	300842	帝科股份	21,814,284.57	5.71
14	300672	国科微	21,649,531.94	5.67
15	300779	惠城环保	21,630,978.19	5.66
16	300693	盛弘股份	20,915,427.32	5.48
17	300130	新国都	20,613,923.11	5.40
18	300533	冰川网络	20,175,124.27	5.28
19	603283	赛腾股份	19,739,601.75	5.17
20	688676	金盘科技	19,299,204.46	5.05
21	002869	金溢科技	19,258,832.00	5.04
22	688630	芯碁微装	19,143,048.26	5.01
23	003028	振邦智能	18,771,916.36	4.92
24	300573	兴齐眼药	18,469,303.80	4.84
25	002317	众生药业	18,251,056.49	4.78
26	688036	传音控股	18,107,812.32	4.74
27	600895	张江高科	18,101,334.00	4.74
28	688383	新益昌	17,844,387.91	4.67
29	688103	国力股份	17,523,071.98	4.59
30	300144	宋城演艺	17,241,197.00	4.51
31	600685	中船防务	16,476,888.97	4.31
32	688390	固德威	16,257,536.14	4.26
33	600415	小商品城	16,109,610.00	4.22
34	688668	鼎通科技	16,103,326.02	4.22
35	605168	三人行	15,815,658.35	4.14
36	002129	TCL 中环	14,923,025.00	3.91
37	600050	中国联通	14,837,911.00	3.89
38	002607	中公教育	14,704,498.00	3.85
39	688598	金博股份	14,662,307.11	3.84
40	300820	英杰电气	14,620,012.30	3.83
41	600475	华光环能	14,240,581.78	3.73
42	002965	祥鑫科技	14,110,355.00	3.69
43	002602	世纪华通	13,916,013.00	3.64
44	002335	科华数据	13,899,094.84	3.64
45	600537	亿晶光电	13,426,851.00	3.52
46	688663	新风光	13,371,881.27	3.50



47	603595	东尼电子	13,228,094.00	3.46
48	600732	爱旭股份	13,121,063.90	3.44
49	300360	炬华科技	13,059,370.00	3.42
50	002472	双环传动	12,989,464.00	3.40
51	603081	大丰实业	12,806,323.00	3.35
52	603212	赛伍技术	12,520,862.00	3.28
53	301322	绿通科技	12,450,703.05	3.26
54	603773	沃格光电	12,374,074.00	3.24
55	300161	华中数控	12,266,328.00	3.21
56	600197	伊力特	11,950,312.00	3.13
57	300634	彩讯股份	11,930,420.00	3.12
58	002518	科士达	11,825,337.10	3.10
59	002992	宝明科技	11,754,260.00	3.08
60	300762	上海瀚讯	11,753,067.60	3.08
61	300109	新开源	11,610,464.06	3.04
62	002368	太极股份	11,523,842.00	3.02
63	300314	戴维医疗	11,488,308.00	3.01
64	603108	润达医疗	11,475,221.00	3.00
65	002864	盘龙药业	11,446,895.64	3.00
66	300982	苏文电能	11,175,926.00	2.93
67	688029	南微医学	11,076,634.55	2.90
68	300614	百川畅银	11,075,260.50	2.90
69	000999	华润三九	10,866,986.51	2.85
70	601882	海天精工	10,700,533.50	2.80
71	603040	新坐标	10,529,638.00	2.76
72	600062	华润双鹤	10,411,175.85	2.73
73	603871	嘉友国际	10,310,240.28	2.70
74	603516	淳中科技	10,263,674.80	2.69
75	300629	新劲刚	10,207,846.96	2.67
76	688439	振华风光	10,060,263.49	2.63
77	002738	中矿资源	10,025,730.80	2.63
78	600166	福田汽车	10,004,382.00	2.62
79	002121	科陆电子	9,997,083.00	2.62
80	600963	岳阳林纸	9,943,714.10	2.60
81	603308	应流股份	9,830,503.00	2.57
82	603359	东珠生态	9,790,184.00	2.56
83	600705	中航产融	9,679,224.00	2.53
84	300033	同花顺	9,576,941.00	2.51
85	002315	焦点科技	9,527,870.20	2.49
86	603258	电魂网络	9,519,176.79	2.49
87	600853	龙建股份	9,326,529.00	2.44
88	688048	长光华芯	9,197,655.17	2.41
89	688579	山大地纬	9,125,778.07	2.39

90	002236	大华股份	9,008,539.52	2.36
91	688111	金山办公	8,892,549.67	2.33
92	301179	泽宇智能	8,631,184.80	2.26
93	002946	新乳业	8,579,176.80	2.25
94	300571	平治信息	8,474,245.00	2.22
95	000661	长春高新	8,453,985.44	2.21
96	301162	国能日新	8,266,726.80	2.16
97	002409	雅克科技	8,189,272.00	2.14
98	688539	高华科技	8,035,302.96	2.10
99	600150	中国船舶	8,022,759.00	2.10
100	002139	拓邦股份	7,987,962.00	2.09
101	688305	科德数控	7,948,343.67	2.08
102	300572	安车检测	7,939,843.00	2.08
103	002735	王子新材	7,864,330.00	2.06
104	301328	维峰电子	7,863,563.00	2.06
105	688392	骄成超声	7,758,710.13	2.03
106	301052	果麦文化	7,755,040.45	2.03
107	002446	盛路通信	7,747,170.00	2.03
108	300068	南都电源	7,661,553.35	2.01

#### 8.4.3 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	2,157,792,546.77
卖出股票收入（成交）总额	2,345,244,860.60

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

## 8.10 投资组合报告附注

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

### 8.10.3 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	158,665.08
2	应收清算款	3,005,562.76
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,411.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,175,639.80

### 8.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 8.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 8.10.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 (%)

2,871	31,991.49	20,004,500.00	21.78	71,843,070.26	78.22
-------	-----------	---------------	-------	---------------	-------

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	红土创新基金管理有 限公司	20,004,500.00	21.78
2	钟莹琰	1,992,481.87	2.17
3	吴宇婷	1,712,997.37	1.87
4	杨焯	992,738.49	1.08
5	金勋	791,197.83	0.86
6	黄京俊	693,690.40	0.76
7	徐洪	504,572.22	0.55
8	张兰华	500,008.22	0.54
9	MENGAIDONG	495,493.14	0.54
10	黄珍金	495,425.64	0.54

## 9.3 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	52.62	0.00

## 9.4 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年7月23日） 基金份额总额	235,445,468.54
本报告期期初基金份额总额	235,445,468.54
本报告期基金总申购份额	1,075,877.67
减：本报告期基金总赎回份额	144,673,775.95
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	91,847,570.26

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

## 11.2 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。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

## 11.5 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。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 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到监管部门稽查或处罚。

### 11.6.2 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到监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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 (%)	
华创证券	2	994,282,260.79	22.09	717,177.42	22.02	-
海通证券	1	596,081,704.38	13.24	429,954.82	13.20	-
天风证券	1	541,052,207.09	12.02	391,481.33	12.02	-
国盛证券	1	383,516,634.85	8.52	276,626.05	8.50	-
招商证券	2	278,475,336.22	6.19	204,785.67	6.29	-
浙商证券	1	271,836,074.02	6.04	196,076.38	6.02	-
英大证券	1	234,638,209.	5.21	172,531.49	5.30	-

		08				
华西证券	2	232,134,746.68	5.16	167,438.61	5.14	-
申港证券	2	197,270,226.21	4.38	142,285.43	4.37	-
中泰证券	1	160,089,643.34	3.56	115,480.54	3.55	-
中信建投证券	2	147,446,379.57	3.28	106,353.37	3.27	-
平安证券	1	139,853,174.58	3.11	100,879.36	3.10	-
长江证券	1	90,818,450.46	2.02	65,507.41	2.01	-
东兴证券	1	88,583,923.61	1.97	63,894.50	1.96	-
广发证券	2	75,184,675.30	1.67	54,825.92	1.68	-
东方财富	2	58,503,574.26	1.30	42,196.19	1.30	-
山西证券	1	11,905,687.06	0.26	8,761.22	0.27	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-

11.7.2 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 (%)
华创证券	-	-	-	-	-	-
海通证	-	-	-	-	-	-

券						
天风证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华林证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
信达证	-	-	-	-	-	-

券						
银河证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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、规定报社及本公司网站	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、规定报社及本公司网站	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、规定报社及本公司网站	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、规定报社及本公司网站	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、规定报社及本公司网站	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、规定报社及本公司网站	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、规定报社及本公司网站	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、规定报社及本公司网站	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、规定报社及本公司网站	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、规定报社及本公司网站	2023 年 6 月 27 日
11	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华泰期货为销售机构的	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本	2023 年 6 月 29 日



	公告	公司网站	
12	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增博时财富为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 7 月 18 日
13	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海万得基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 7 月 18 日
14	红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）2023 年第 1 期	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 7 月 20 日
15	关于红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满变更基金名称及相关安排的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 7 月 20 日
16	红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）托管协议	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 7 月 20 日
17	红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金转为上市开放式运作方式暨开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 7 月 20 日
18	红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）基金合同	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 7 月 20 日
19	红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 7 月 20 日
20	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东吴证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 7 月 24 日
21	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国信证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 8 月 9 日
22	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大连网金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 8 月 22 日
23	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增粤开证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 8 月 25 日
24	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国金证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 9 月 4 日
25	红土创新基金管理有限公司关于暂停扬州国信嘉利基金销售有限公司办理	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本	2023 年 11 月 30 日

	旗下基金相关销售业务的公告	公司网站	
26	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国信证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 12 月 13 日
27	红土创新基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 12 月 29 日
28	红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）托管协议（更新）	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 12 月 29 日
29	红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）基金合同（更新）	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 12 月 29 日
30	红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）2023 年第 2 期	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 12 月 29 日
31	红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 12 月 29 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20231031-20231231	20,004,500.00	0.00	0.00	20,004,500.00	21.78

#### 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；

##### 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；

4. 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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- （1）中国证监会批准红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）设立的文件；
- （2）红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）基金合同；
- （3）红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）托管协议；
- （4）红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）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）报告期内红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）在指定报刊上各项公告的原稿。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 13.3 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

2024 年 3 月 29 日